

【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10月19日提出
【計算期間】	第6期(自 2021年7月20日至 2022年7月19日)
【ファンド名】	時間分散型バランスファンド（安定指向）2 0 1 6 - 1 1
【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

主として、日本を含む世界各国の株式、債券、不動産投信およびコモディティ(商品)連動証券などに投資を行なう投資信託証券に投資を行ない、インカム収益の確保と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 債券
	海外	不動産投信
追加型投信	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			ファミリーファンド	あり
一般	年6回	北米		(部分ヘッジ)
公債	(隔月)	欧州		
社債				
その他債券	年12回	アジア		
クレジット属性 ()	(毎月)	オセアニア		
	日々			
不動産投信		中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 ()	その他 ()	アフリカ		
		中近東 (中東)		
資産複合 (その他資産(投資 信託証券(株式、 債券、不動産投 信、その他資産 (商品)))		エマージング		
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。

資産複合 資産配分変更型(その他資産(投資信託証券(株式、債券、不動産投信、その他資産(商品))))

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式、債券、不動産投信およびその他資産(商品)に投資を行いません。

「資産配分変更型」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、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。

年1回

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

グローバル(含む日本)

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

ファンド・オブ・ファンズ

「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。

為替ヘッジあり(部分ヘッジ)

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1 世界の様々な資産に分散投資を行ない、世界経済の成長に沿った収益の獲得をめざします。

- 主として、世界(日本を含む)の資産(株式、債券、不動産、コモディティ(商品)など)を投資対象とします*1。
- 複数の異なる資産への分散投資に加え、市場環境の変化に応じた資産配分の適宜見直しにより、インカム収益の確保と信託財産の成長をめざします。
- 資産配分比率の決定および変更については、三井住友信託銀行株式会社の助言に基づき、日興アセットマネジメント株式会社が行ないます。

*1 世界の資産への投資は、各資産を主要投資対象とする投資信託証券を通じて行ないます。

2 世界の資産への投資を段階的に積み増すことで、投資タイミングを分散します。

- 世界(日本を含む)の資産(株式、債券、不動産、コモディティ(商品)など)への投資比率は、設定当初、純資産総額の25%程度とし、その後、約3ヵ月ごとに25%程度ずつ段階的に引き上げます*2。(設定日から約9ヵ月が経過した後は、世界の資産への投資比率を高位に保つことを原則とします。)

*2 その他の資産については、低リスク資産による安定的な運用を行ないます。

3 運用目的やリスク許容度に応じて、「安定指向」と「成長指向」の2つのファンドから選択できます。

- 「安定指向」は安定性を、「成長指向」は安定性と収益性のバランスを重視した運用を行ないます。

※「安定指向」とは元本保証等を意味するものではなく、「成長指向」と比較して安定的な運用をめざすファンドであることを意味しています。

繰上償還について

- 1万口当たり基準価額(税引前分配金控除後、以下「基準価額」)が、2026年6月30日以前の営業日に13,000円以上となった場合には、投資信託証券への投資比率を引き下げ、短期公社債などによる安定運用に移行後、繰上償還します。

※基準価額や1万口当たり償還価額が13,000円以上になることを保証するものではありません。
※安定運用への移行後も、繰上償還するまでは、基準価額は市況動向などの影響を受けるため、基準価額や償還価額が13,000円を下回ることがあります。

※市況動向および資金動向などにより、上記のような運用が行なえない場合があります。

資産分散について

- 当ファンドは、主として、世界(日本を含む)の資産(株式、債券、不動産、コモディティ(商品)など)を投資対象とします。値動きの異なる複数の資産に分散投資を行なうことで、価格変動リスクの軽減を図りながら、信託財産の成長をめざします。

投資対象資産と期待される収益・効果



※投資対象資産は今後、追加・変更される可能性があります。
 ※各資産への投資は、投資信託証券を通じて行ないます。

(2016年9月末現在)

投資タイミングの分散について

- 資産価格は市況動向などにより変動するため、投資タイミングを分散する「エントリー分散」により、投資資産の短期的な価格変動の影響を小さくすることをめざします。
- 当ファンドでは、世界の資産への分散投資を、設定当初に純資産総額の25%程度から開始し、約3ヵ月ごとに25%程度ずつ段階的に引き上げることで、投資タイミングの分散を図ります。

「エントリー分散」の仕組み



※「エントリー分散」の仕組みは、「安定指向」「成長指向」とも同様です。なお、世界の資産への分散投資における資産配分比率は、「安定指向」と「成長指向」で異なります。

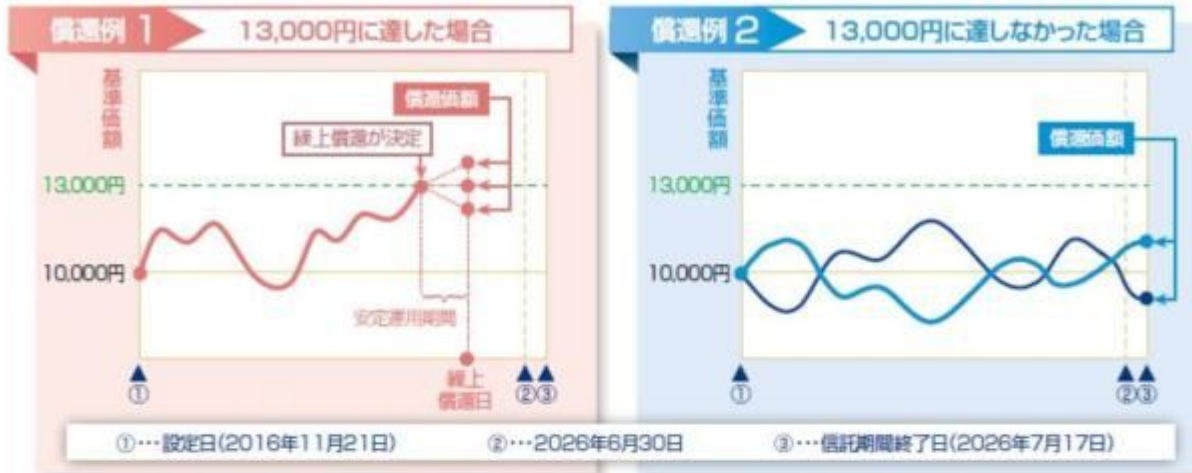
※低リスク資産は、内外のソブリン債を投資対象とし、外貨建資産については為替ヘッジを行なうことで為替変動リスクの低減を図ります。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。また、為替ヘッジを行なうことに伴い、為替ヘッジコストがかかります。

※上記は「エントリー分散」の仕組みについて説明するためのイメージ図です。

※市況動向および資金動向などにより、上記のような運用が行なえない場合があります。

繰上償還について

- 1万口当たり基準価額（税引前分配金控除後、以下「基準価額」）が、2026年6月30日以前の営業日に13,000円以上となった場合には、投資信託証券への投資比率を引き下げ、短期公社債などによる安定運用に移行後、繰上償還します。

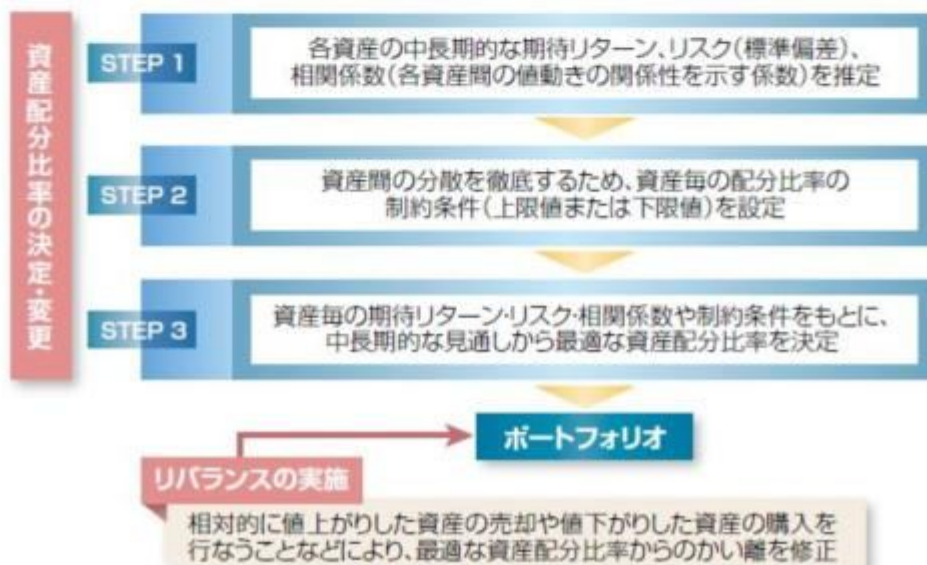


※上記は繰上償還について説明するためのイメージ図です。

- ※ 13,000円の基準価額水準は、あくまで安定運用に切り替えるための水準であり、基準価額が13,000円以上となることを示唆あるいは保証するものではありません。
- ※ 基準価額が13,000円以上となった場合には、安定運用に移行します。安定運用への移行後も繰上償還するまでは、基準価額は市況動向などの影響を受けるため、基準価額や1万口当たり償還価額が13,000円を下回る場合があります。

資産配分の決定プロセス

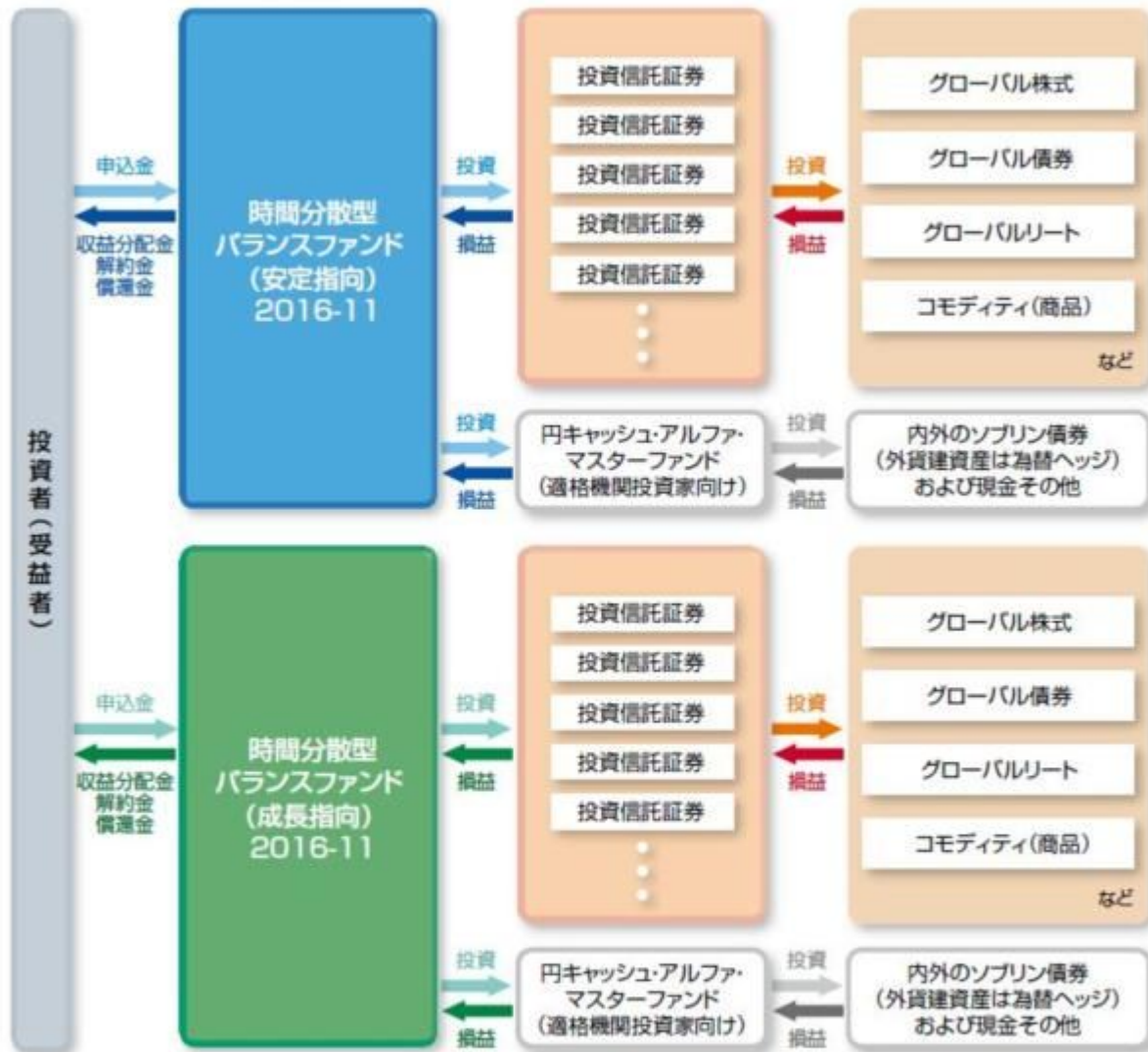
- 当ファンドにおいて、世界の資産への分散投資における資産配分比率の決定および変更は、年金運用などで豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行株式会社からの投資助言に基づき行ないます。



- ※ 各資産への投資は、投資信託証券を通じて行ない、各投資信託証券は、追加・変更される場合があります。
- ※ 上記は、2016年9月末現在のものであり、将来変更される場合があります。

ファンドの仕組み

■当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



※投資先投資信託証券は適宜見直しを行いません。

※投資先投資信託証券の詳細については、後述の追加的記載事項をご覧ください。

〈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、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。

※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。

追加的記載事項

当ファンドが投資対象とする投資信託証券は、資産クラスごとに以下のものを定めています。
※各投資信託証券は、追加、変更される場合があります。

資産クラス	投資信託証券	主な投資資産
株式	インデックス マザーファンドTOPIX	日本の株式
	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)	先進国(日本を除く)の株式
	先進国資本エマージング株式マザーファンド	先進国企業が資本参加している 新興国企業の株式
債券	ソブリン(円ヘッジ)マザーファンド	内外のソブリン債券 (外貨建資産は為替ヘッジ)
	インデックス マザーファンド 海外先進国債券	先進国(日本を除く)のソブリン債券
	インデックスファンド海外新興国債券 (適格機関投資家向け)	新興国のソブリン債券
不動産	インデックス マザーファンドJリート	日本の不動産投資信託
	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)	先進国(日本を除く)の不動産投資信託
コモディティ (商品)	インデックス マザーファンド コモディティ	コモディティ関連のETF
	FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり (適格機関投資家専用)	金のETF

(有価証券報告書提出日現在)

信託金限度額

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

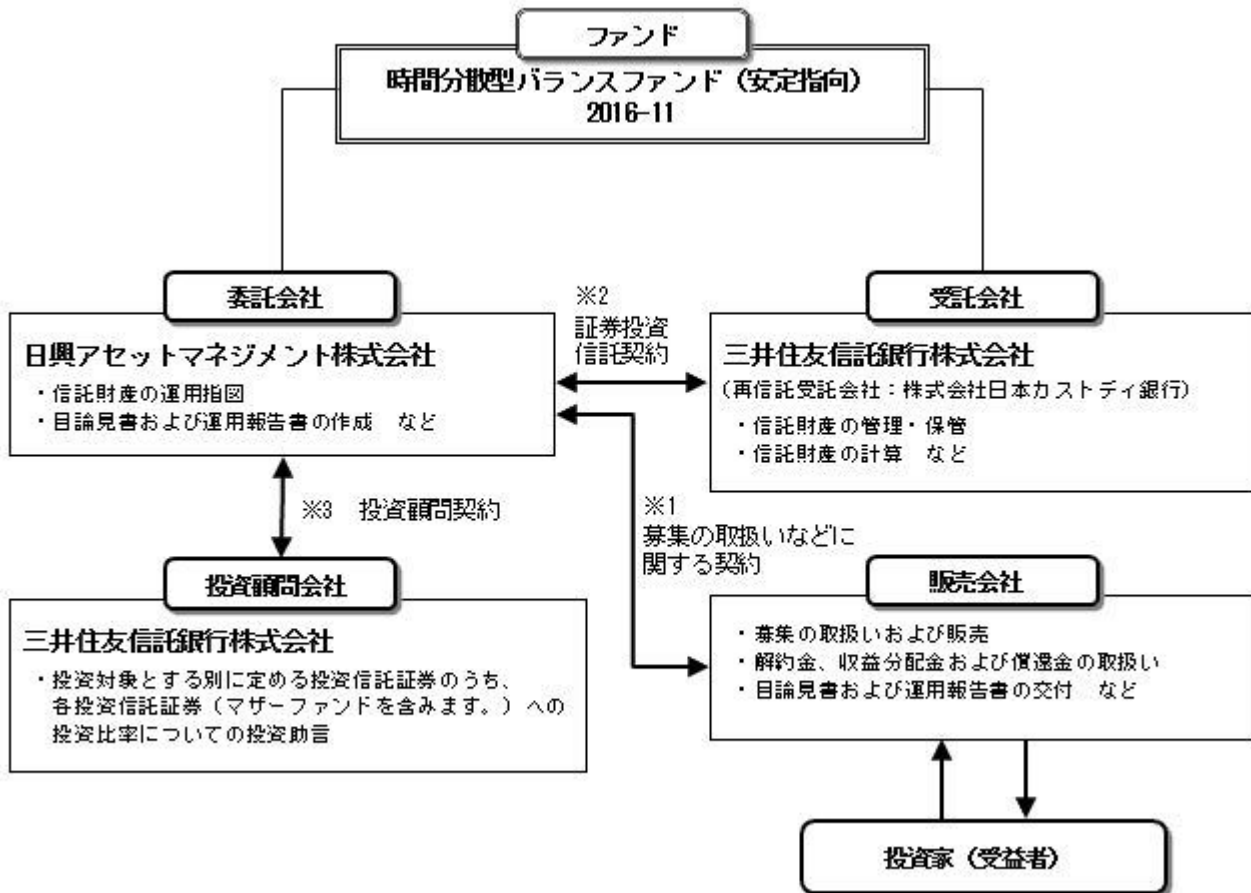
(2) 【ファンドの沿革】

2016年11月21日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

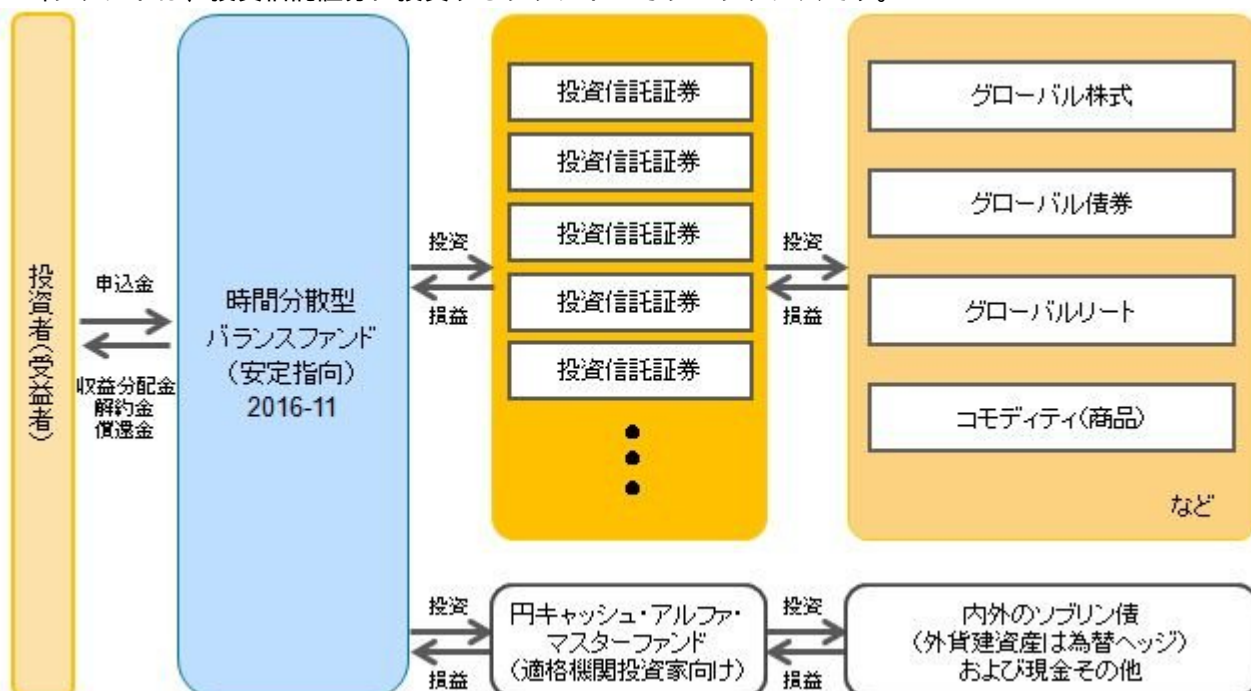
ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものです。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものです。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。
- 3 投資顧問会社から株式、債券などの有価証券に対する投資判断についての助言（有価証券の種類、銘柄、数量、売買時期の判断など）を受けるルールを委託会社と投資顧問会社との間で規定したものです。投資助言を受ける対象資産、助言の内容、報酬の取決めの内容などが含まれています。

<ファンド・オブ・ファンズの仕組み>

当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



投資先投資信託証券は適宜見直しを行ないます。

投資先投資信託証券の詳細については、前述の追加的記載事項をご覧ください。

委託会社の概況（2022年7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、日本を含む世界各国の債券、株式、不動産投信およびコモディティ連動証券などに実質的に投資を行なう別に定める投資信託証券（以下、「別に定める投資信託証券」といいます。）ならびに円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）受益証券の一部、またはすべてに投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行ないます。

- ・各投資信託証券への投資比率の合計は、原則として高位を保ちます。

- ・一方で、原則として、以下の要件にしたがって、信託財産の純資産総額に対する各投資信託証券への投資比率を変更していきます。投資比率を変更するタイミングについては、ファンドの状況などを勘案し、合理的な範囲で決定できるものとします。

当初設定時からの約3ヵ月間において、以下の投資比率を目指します。

別に定める投資信託証券への投資比率の合計 … 25%

円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）… 75%

2017年2月下旬以降の約3ヵ月間において、以下の投資比率を目指します。

別に定める投資信託証券への投資比率の合計 … 50%

円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）… 50%

2017年5月下旬以降の約3ヵ月間において、以下の投資比率を目指します。

別に定める投資信託証券への投資比率の合計 … 75%

円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）… 25%

2017年8月下旬以降の信託期間中において、以下の投資比率を目指します。

別に定める投資信託証券への投資比率の合計 … 100%

円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）… 0%

- ・なお、別に定める投資信託証券については、収益機会の追求やリスクの分散などを目的として、適宜見直しを行ないます。この際、定性評価や定量評価等を勘案のうえ、新たに投資信託証券を指定したり、既に指定されていた投資信託証券を外したりする場合があります。

- ・2026年6月30日以前の毎営業日において、1万口当たり基準価額が13,000円以上となった場合には、各投資信託証券への投資比率を引き下げ、短期有価証券や短期金融商品等の資産による安定運用に切り替えることを基本とします。

- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等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】

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、別に定めるマザーファンドの受益証券および別に定めるマザーファンドを除く投資信託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) 追加型証券投資信託 円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け） 受益証券
- 2) 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
- 3) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、2)の証券の性質を有するもの
- 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

次の取引ができます。

- 1) 外国為替予約取引
- 2) 資金の借入

投資対象とする投資信託証券の概要

<インデックス マザーファンド T O P I X >

運用の基本方針	
基本方針	わが国の長期成長と株式市場の動きをとらえることを目標に、T O P I X（東証株価指数） [*] の動きに連動する投資成果をめざします。
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"> ・投資成果をT O P I X（東証株価指数）の動きにできるだけ連動させるため、「パーラ日本株式モデル」に従い次のポートフォリオ管理を行います。 <ul style="list-style-type: none"> 投資対象銘柄の中から、原則として200銘柄以上に分散投資を行いません。 資金の流入に伴う売買にあたっては、最適ポートフォリオと信託財産のポートフォリオのカイ離を縮小するように売買を行いません。 株式の組入比率は、高位を保ちます。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
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	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2001年10月26日設定）
決算日	毎年2月12日（休業日の場合は翌営業日）

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

TOPIXの指数値およびTOPIXに係る標章または商標は、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。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXに係る標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIX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、JPX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JPXは責任を負いません。

<ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	内外の公社債に投資を行ない、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外のソブリン債券（国債、州政府債、政府保証債、政府機関債、国際機関債などをいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・原則として、日本および世界の高格付け国の中から、為替ヘッジコスト考慮後の利回りや信用力などを勘案して複数国を選定し、当該国通貨建てのソブリン債券に分散投資するとともに、外貨建て資産については為替ヘッジを行なうことにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざします。 ・ポートフォリオの構築にあたっては、為替ヘッジコスト考慮後の利回りの水準や方向性、信用力、流動性などの分析を行ない、組入国やその配分比率、および組入銘柄を決定します。なお、金利動向などによっては、組入債券の一部売却や先物取引などの活用により、実質的な債券組入比率を調整することがあります。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 ・投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
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	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2011年2月28日設定）
決算日	毎年2月10日（休業日の場合は翌営業日）

<インデックス マザーファンド リポート>

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、別に定める日本の不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数（東証REIT指数（配当込み）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）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"> 主として、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に投資を行ない、別に定める日本の不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数に連動する投資成果を目標として運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し委託会社の判断により決定するものとします。 運用にあたって、運用目的を達成するために有用であると判断される場合は、有価証券指数等先物取引（別に定める日本の不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数を対象とする先物取引とします。）を活用したり、対象指数に採用されていない不動産投資信託証券について投資を行なうことがあります。また、対象指数に採用されている不動産投資信託証券の一部または全部の値動きに連動を目指す上場投資信託証券や債券等に投資する場合もあります。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
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	三井住友信託銀行株式会社

信託期間	無期限（2015年3月17日設定）
決算日	毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）

< インデックス マザーファンド 海外先進国債券 >

運用の基本方針	
基本方針	日本を除く先進国の債券に投資を行ない、別に定める日本を除く先進国債券市場を代表する指数（FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）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	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として日本を除く先進国の債券に投資を行ない、別に定める日本を除く先進国債券市場を代表する指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し委託会社の判断により決定するものとします。 運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引等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等の買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ただし、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等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（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	三井住友信託銀行株式会社

信託期間	無期限（2016年8月22日設定）
決算日	毎年7月17日（休業日の場合は翌営業日）

<先進国資本エマージング株式マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	主として、世界の金融商品取引所上場株式に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	世界の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として、世界の金融商品取引所に上場されており、先進国企業が資本参加している新興国企業の株式（預託証券を含みます。以下同じ。）に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 株式の銘柄選定にあたっては、各企業の成長性、収益性、流動性等を勘案して行ないます。 株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。なお、ファンドの状況等によっては、上場投資信託証券等に投資する場合があります。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ただし、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等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
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	三井住友信託銀行株式会社

投資顧問会社	日興アセットマネジメント アジア リミテッド（投資助言）
信託期間	無期限（2016年 6月30日設定）
決算日	毎年 6月21日（休業日の場合は翌営業日）

< インデックス マザーファンド コモディティ >

運用の基本方針	
基本方針	コモディティに関連する上場投資信託証券に投資し、別に定める商品市場を代表する指数（ブルームバーグ・コモディティ・インデックス・トータルリターン（円換算ベース）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）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	コモディティに関連する上場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"> 主として、日本または海外の金融商品取引所に上場されている投資信託証券であって、コモディティ商品指数への連動を目指す投資信託証券に投資し、別に定める商品市場を代表する指数に連動する投資成果を目標として運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し委託会社の判断により決定するものとします。 また、ファンドの状況に応じて、コモディティに関連する上場投資信託証券以外の有価証券に投資を行なう場合があります。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
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	三井住友信託銀行株式会社

信託期間	無期限（2016年8月22日設定）
決算日	毎年7月17日（休業日の場合は翌営業日）

< 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） >

運用の基本方針	
基本方針	別に定める日本を除く先進国株式市場を代表する指数（MSCI-KOKUSAI インデックス（円ヘッジなし・円ベース）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）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	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド受益証券に投資を行ない、別に定める日本を除く先進国株式市場を代表する指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し、委託会社の判断により決定するものとします。 ・マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
ファンドに係る費用	
信託報酬	純資産総額に対し年率0.099%（税抜0.09%）
その他報酬	<ul style="list-style-type: none"> ・有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額 ・投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限り、他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。

その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> 運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、「別に定める日本を除く先進国株式市場を代表する指数」その他これに類する標章の使用料などについては、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、信託財産から支払うことができます。 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については、その都度、信託財産から支払われます。 <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
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（2016年8月23日設定）
決算日	毎月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

その他

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

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

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

< 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） >

運用の基本方針	
基本方針	別に定める日本を除く先進国リート市場を代表する指数（S & P 先進国 REIT 指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）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	海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として、海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド受益証券に投資を行ない、別に定める日本を除く先進国リート市場を代表する指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し、委託者の判断により決定するものとします。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。

ファンドに係る費用

信託報酬	純資産総額に対し年率0.099%（税抜0.09%）
------	---------------------------

その他報酬	<ul style="list-style-type: none"> ・有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額 ・投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> ・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、「別に定める日本を除く先進国リート市場を代表する指数」その他これに類する標章の使用料などについては、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、信託財産から支払うことができます。 ・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については、その都度、信託財産から支払われます。 <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
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（2016年8月23日設定）
決算日	毎月15日（休業日の場合は翌営業日）

（ご参考）＜海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、S & P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・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 & 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。 ・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。 ・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。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・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。 ・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。 ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入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。

<インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）>

運用の基本方針

基本方針	別に定める新興国債券市場を代表する指数（JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバシファイド（円ヘッジなし・円ベース）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）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	海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド受益証券に投資を行ない、別に定める新興国債券市場を代表する指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し、委託者の判断により決定するものとします。 ・マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
ファンドに係る費用	
信託報酬	純資産総額に対し年率0.099%（税抜0.09%）
その他報酬	<ul style="list-style-type: none"> 有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額 投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> 運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、「別に定める新興国債券市場を代表する指数」その他これに類する標章の使用料などについては、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、信託財産から支払うことができます。 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については、その都度、信託財産から支払われます。 <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
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（2016年8月23日設定）
決算日	毎月16日（休業日の場合は翌営業日）

（ご参考）＜海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、新興国の現地通貨建債券に投資し、J Pモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、新興国の現地通貨建債券の騰落率に償還価額などが連動する債券を活用することもあります。 ・運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券、新株予約権証券および新株引受権付社債券を含みます。）への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2008年3月31日設定）
決算日	毎年5月16日（休業日の場合は翌営業日）

* J Pモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバースファイドは、J Pモルガンが発表している、エマージング・カントリーの債券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JPMorgan Chase & Co.に帰属します。また、JPMorgan Chase & Co.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。

<円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）>

運用の基本方針

基本方針	インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
------	---------------------------------

主な投資対象	ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド受益証券に投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 ・マザーファンド受益証券の組入比率は、この信託の純資産総額に対して50%以上となることを原則とし、金利動向等に応じて機動的に変更できるものとします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 ・投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
ファンドに係る費用	
信託報酬	純資産総額に対し年率0.088%（税抜0.08%）
その他報酬	<ul style="list-style-type: none"> ・有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額 ・投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限り、他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> ・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用などについては、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、信託財産から支払うことができます。 ・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については、その都度、信託財産から支払われます。 <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
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	三井住友信託銀行株式会社

信託期間	無期限（2016年8月22日設定）
決算日	毎年8月10日（休業日の場合は翌営業日）

< F O F s用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用） >

運用の基本方針	
基本方針	信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	ゴールド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として、ゴールド・マザーファンド受益証券に投資を行ない、信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。 実質外貨建資産については、為替変動リスクの低減を図るため、原則として対円での為替ヘッジを行ないます。 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等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
ファンドに係る費用	
信託報酬	純資産総額に対し年率0.143%（税抜0.13%）
その他報酬	<ul style="list-style-type: none"> 有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額 投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。

その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> 運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用などについては、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、信託財産から支払うことができます。 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については、その都度、信託財産から支払われます。 <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
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	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	2027年7月8日まで（2017年9月29日設定）
決算日	毎年7月8日（休業日の場合は翌営業日）

（ご参考）＜ゴールド・マザーファンド＞

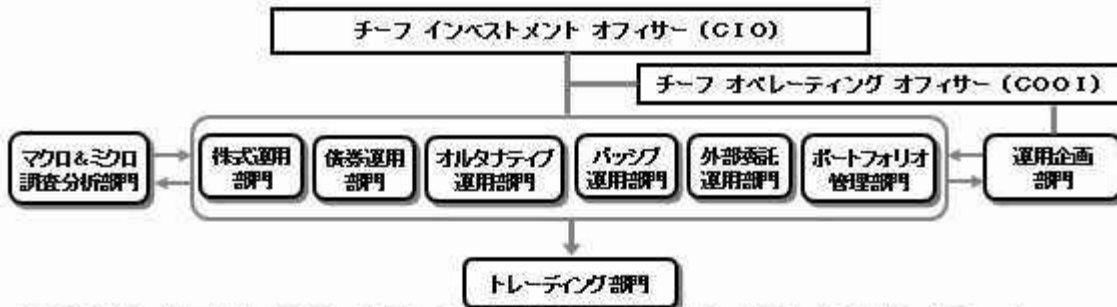
運用の基本方針	
基本方針	主に金地金価格への連動をめざす上場投資信託証券に投資を行ない、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	金地金価格への連動をめざす上場投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場されている投資信託証券であって、金地金価格への連動をめざす投資信託証券に投資を行ない、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。なお、ファンドの状況や投資環境に応じて、金地金価格への連動をめざすために、金先物価格への連動をめざす上場投資信託証券や上場投資信託証券以外の有価証券に投資を行なう場合があります。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。

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	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限(2013年3月25日設定)
決算日	毎年3月8日(休業日の場合は翌営業日)

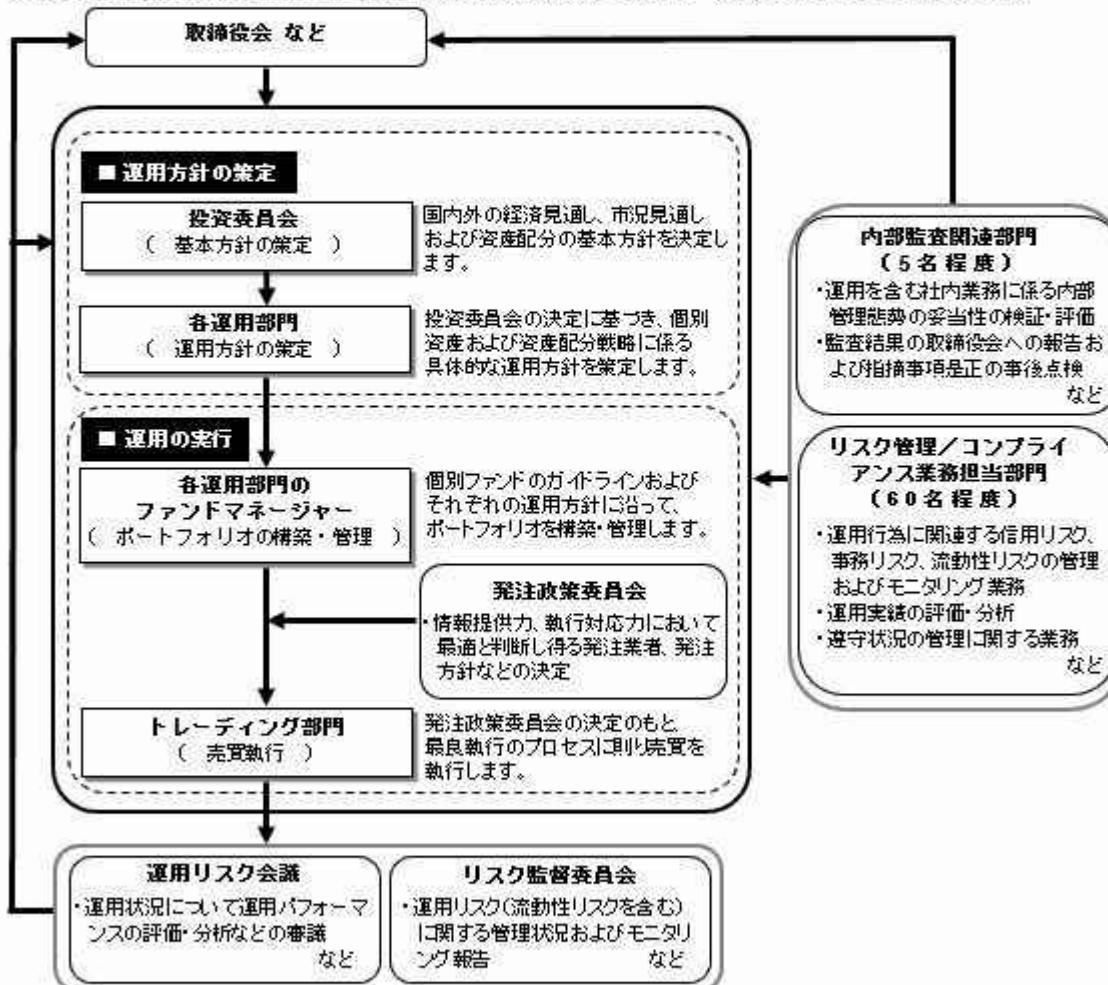
(3) 【運用体制】

<日興アセットマネジメント株式会社(委託会社)における運用体制>

◆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

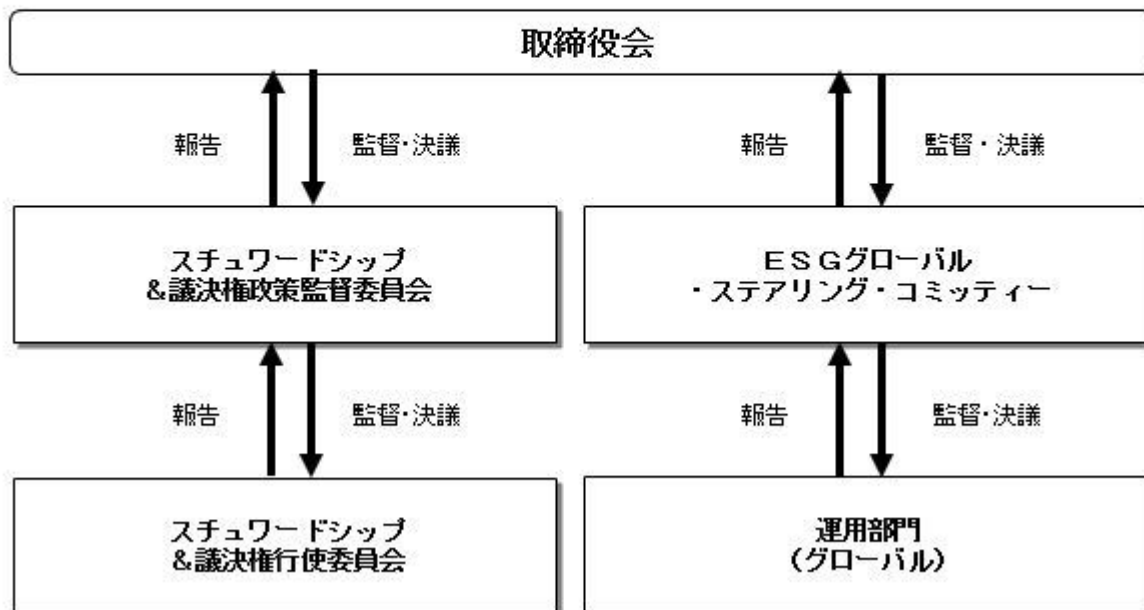
「受託会社」に対しては、日々の純資産照会、月次の勘定残高照会などを行っております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行っており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

「投資顧問会社」については、投資顧問会社の管理体制およびリスク管理状況のモニタリングをリスク管理業務担当部門にて行なっています。また、外部委託運用部門で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7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。

3) 留保益の運用方針

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

収益分配金の支払い

<分配金再投資コース>

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。

<分配金受取りコース>

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

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) 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範囲内
 - 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。
- 6) 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。

- ・投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・当ファンドは、主に債券、株式、不動産投信およびコモディティ連動証券を実質的な投資対象としますので、債券、株式、不動産投信およびコモディティ連動証券の価格の下落や、債券、株式および不動産投信の発行体の財務状況や業績の悪化、不動産、商品（コモディティ）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。
- ・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。

- ・一般に新興国の債券および株式は、先進国の債券および株式に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。
- ・一般にコモディティ連動証券の価格は、投資対象となる商品および当該商品が関係する市況や市況の変化などの要因により価格が変動するリスクがあります。上記事項に関する変動があった場合、ファンドに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。
- ・一般に新興国の債券および株式は、先進国の債券および株式に比べて市場規模や取引量が少ないため、流動性リスクが高まる場合があります。

信用リスク

- ・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。
- ・一般に新興国の債券は、先進国の債券に比べて利回りが高い反面、価格変動が大きく、デフォルトが生じるリスクが高まる場合があります。
- ・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。
- ・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。
- ・上場投資信託証券について、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上場投資信託証券の価格は下がり、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。
- ・格付を有する有価証券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

為替変動リスク

- ・一部の資産を除き、原則として、為替ヘッジを行わないため、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。
- ・一部の資産において、為替ヘッジを行なうにあたっては、円の金利が為替ヘッジを行なう通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替および金利の動向によっては、為替ヘッジに伴うヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。
- ・一般に新興国の通貨は、先進国の通貨に比べて為替変動が大きくなる場合があります。

カントリー・リスク

- ・投資対象国における非常事態など(金融危機、財政上の理由による国自体のデフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など)を含む市況動向や資金動向などによっては、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあり、投資方針に従った運用ができない場合があります。
- ・一般に新興国は、情報の開示などが先進国に比べて充分でない、あるいは正確な情報の入手が遅延

する場合があります。

- ・ファンドの投資対象資産が上場または取引されている諸国の税制は各国によって異なります。また、それらの諸国における税制が一方的に変更されたり、新たな税制が適用されたりすることもあります。以上のような要因は、ファンドの信託財産の価値に影響を与える可能性があります。

有価証券の貸付などにおけるリスク

有価証券の貸付行為などにおいては、取引相手先リスク（取引の相手方の倒産などにより貸付契約が不履行になったり、契約が解除されたりするリスク）を伴ない、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。貸付契約が不履行や契約解除の事態を受けて、貸付契約に基づく担保金を用いて清算手続きを行なう場合においても、買戻しを行なう際に、市場の時価変動などにより調達コストが担保金を上回る可能性もあり、不足金額をファンドが負担することにより、その結果ファンドに損害が発生する恐れがあります。

< 繰上償還に関する事項 >

- ・1万口当たり基準価額が13,000円以上となった場合には、信託約款の規定に基づき、繰上償還します（償還価額が13,000円以上であることを保証するものではありません。）。
- ・13,000円は、あくまでも安定運用に切り替えるための価額水準であり、ファンドの基準価額が13,000円以上となることを示唆あるいは保証するものではありません。また、資産価格の変動の影響および外国為替予約取引等の決済を速やかに行なえないなどの事由により、基準価額が13,000円以上となった日の翌営業日以降（安定運用への切り替え完了後も含みます。）の基準価額が13,000円を下回る場合があります。

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

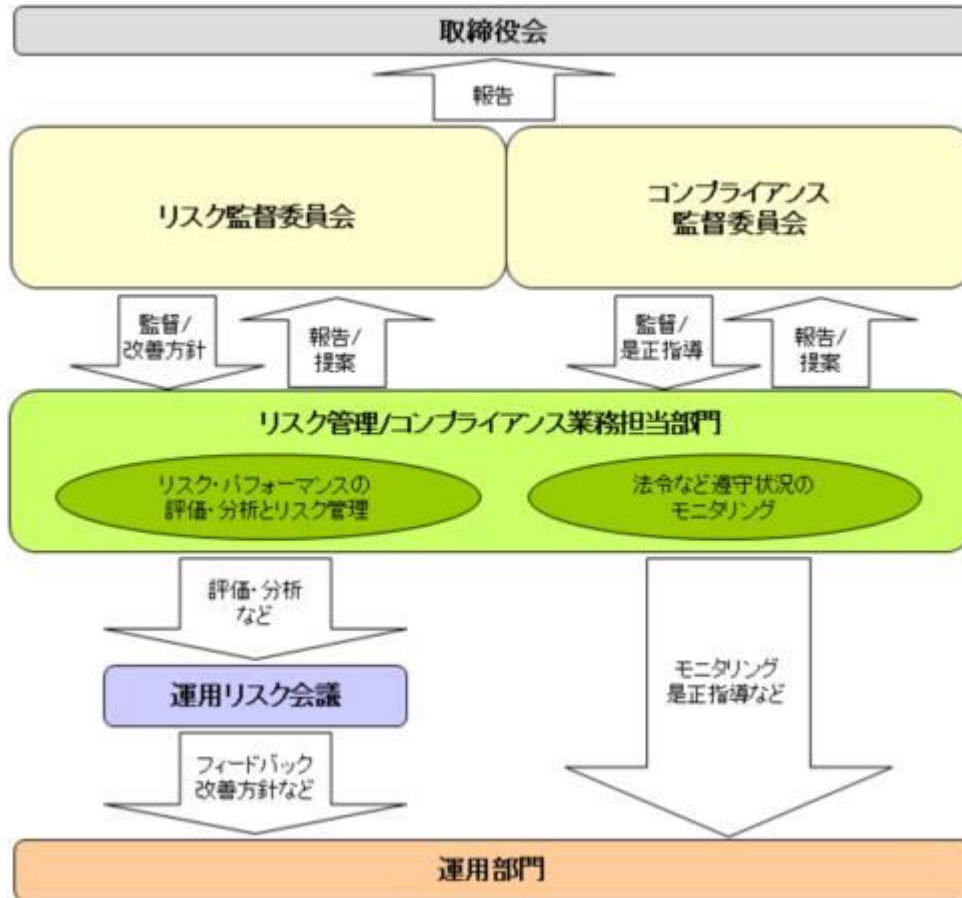
響を及ぼす可能性があります。

- ・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

<日興アセットマネジメント株式会社（委託会社）におけるリスク管理体制>



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7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【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

本書提出日現在、取得申込みの受付は行なっておりません。

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬率（年率）＜純資産総額に対し＞	
当ファンド	0.913%（税抜0.83%）
投資対象とする投資信託証券	0.099%（税抜0.09%）以内 ^{*1}
実質的負担	1.012%（税抜0.92%）以内 ^{*2}

・当ファンドの信託報酬は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.913%（税抜0.83%）の率を乗じて得た額とします。

・投資対象とする投資信託証券の組入れに係る信託報酬率（年率）0.099%（税抜0.09%）以内^{*1}がかり、受益者が実質的に負担する信託報酬率（年率）は1.012%（税抜0.92%）以内^{*2}となります。

*1 投資対象とする投資信託証券の想定される組入比率に基づき委託会社が算出した上限値です。

*1 投資対象とする投資信託証券の信託報酬の詳細については、「第1 ファンドの状況 - 2 投資方針 - (2) 投資対象」 - 「投資対象とする投資信託証券の概要」をご覧ください。

*2 当ファンドの信託報酬率（年率）に投資対象とする投資信託証券の信託報酬率（年率）を加えた、受益者が実質的に負担する信託報酬率（年率）について、委託会社が算出した上限値です。当該上限値は、投資対象とする投資信託証券の想定される組入比率に基づき委託会社が算出したものですが、当該投資信託証券の変更などにより見直すことがあります。

*2 この他に、実質的に不動産投信や上場投資信託証券などに投資する場合には、運用などに係る費用がかかりますが、投資する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

当ファンドの信託報酬の配分（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
0.83%	0.40%	0.40%	0.03%

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。

投資顧問会社が受ける報酬は、上記委託会社が受ける信託報酬の中から支払います。

支払時期

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

ときに、信託財産から支払います。

（４）【その他の手数料等】

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。）なお、 から までに該当する業務を委託する場合は、その委託費用を含みます。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、委託会社が定められた時期に、信託財産から支払います。

ファンドの計理業務（設定解約処理、約定処理、基準価額算出、決算処理等）およびこれに付随する業務（法定帳簿管理、法定報告等）に係る費用。

振替受益権に係る費用ならびに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、半期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。

別に定める投資信託証券の1つである「インデックス マザーファンド」リートの運用の基本方針に規定する「別に定める日本の不動産投資信託証券市場の動きをとらえる指数」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・報酬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。

投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合に限り、その対価としての品貸料（マザーファンド（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるもの）に限ります。）における品貸料については、他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）に0.55（税抜0.5）を乗じて得た貸付有価証券関連報酬。委託会社と受託会社の配分は4：1とし、信託報酬と同時期に支払います。

< 投資対象とする投資信託証券に係る費用 >

「円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）」

「FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」

・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費

用を含みます。)、監査費用などについては、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、信託財産から支払うことができます。

- ・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については、その都度、信託財産から支払われます。
- 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

「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）」

「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）」

「インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）」

- ・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、「各信託約款に定めるベンチマーク指数」その他これに類する標章の使用料などについては、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、信託財産から支払うことができます。
 - ・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については、その都度、信託財産から支払われます。
- 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

「インデックス マザーファンド TOPIX」

「ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド」

「インデックス マザーファンド リート」

「インデックス マザーファンド 海外先進国債券」

「先進国資本エマージング株式マザーファンド」

「インデックス マザーファンド コモディティ」

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

- * 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）^{*}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）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)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

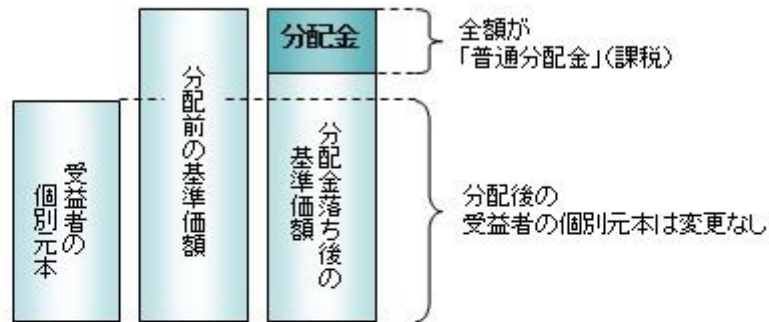
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

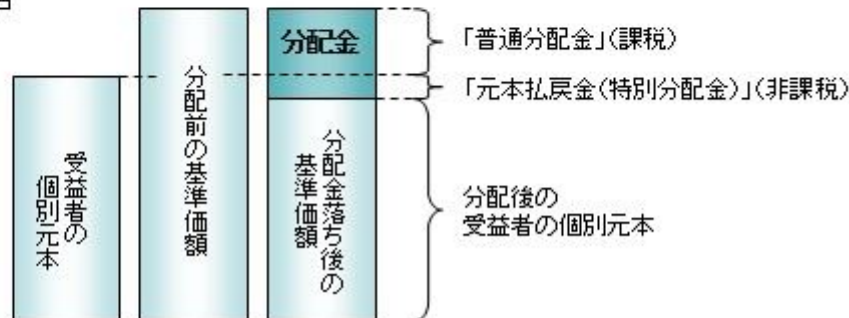
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<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10月19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】

【時間分散型バランスファンド（安定指向）2016 - 11】

以下の運用状況は2022年 7月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	26,976,539	24.05
親投資信託受益証券	日本	81,945,587	73.07
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		3,227,214	2.88
合計(純資産総額)		112,149,340	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	ソブリン(円ヘッジ)マザーファンド	30,757,975	1.1815	36,342,970	1.2196	37,512,426	33.45
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	6,620,538	2.5460	16,855,889	2.5965	17,190,226	15.33
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド 海外先進国債券	12,348,158	1.2591	15,547,780	1.2540	15,484,590	13.81
日本	投資信託受益証券	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)	5,415,138	2.2853	12,375,214	2.3539	12,746,693	11.37
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド J リート	5,994,020	1.4232	8,531,257	1.4605	8,754,266	7.81
日本	投資信託受益証券	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)	4,074,411	1.5704	6,398,455	1.6423	6,691,405	5.97
日本	投資信託受益証券	F O F s 用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	4,775,406	1.1913	5,688,941	1.2234	5,842,231	5.21
日本	投資信託受益証券	インデックスファンド海外新興国債券(適格機関投資家向け)	1,453,106	1.1678	1,696,937	1.1673	1,696,210	1.51
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド コモディティ	1,081,514	1.5266	1,651,039	1.5401	1,665,639	1.49
日本	親投資信託受益証券	先進国資本エマージング株式マザーファンド	979,968	1.3893	1,361,469	1.3658	1,338,440	1.19

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	24.05
親投資信託受益証券	73.07
合 計	97.12

【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1計算期間末 (2017年 7月18日)	1,070	1,070	1.0159	1.0159
第2計算期間末 (2018年 7月17日)	242	242	1.0570	1.0570
第3計算期間末 (2019年 7月17日)	178	178	1.0751	1.0751
第4計算期間末 (2020年 7月17日)	132	132	1.0873	1.0873
第5計算期間末 (2021年 7月19日)	123	123	1.2381	1.2381
第6計算期間末 (2022年 7月19日)	109	109	1.2050	1.2050
2021年 7月末日	124		1.2453	

8月末日	125		1.2558
9月末日	124		1.2451
10月末日	122		1.2633
11月末日	119		1.2467
12月末日	121		1.2698
2022年 1月末日	117		1.2277
2月末日	115		1.2145
3月末日	116		1.2479
4月末日	113		1.2299
5月末日	110		1.2190
6月末日	108		1.1950
7月末日	112		1.2318

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2016年11月21日～2017年 7月18日	0.0000
第2期	2017年 7月19日～2018年 7月17日	0.0000
第3期	2018年 7月18日～2019年 7月17日	0.0000
第4期	2019年 7月18日～2020年 7月17日	0.0000
第5期	2020年 7月18日～2021年 7月19日	0.0000
第6期	2021年 7月20日～2022年 7月19日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2016年11月21日～2017年 7月18日	1.59
第2期	2017年 7月19日～2018年 7月17日	4.05
第3期	2018年 7月18日～2019年 7月17日	1.71
第4期	2019年 7月18日～2020年 7月17日	1.13
第5期	2020年 7月18日～2021年 7月19日	13.87
第6期	2021年 7月20日～2022年 7月19日	2.67

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

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2016年11月21日～2017年 7月18日	1,371,718,426	318,353,054

第2期	2017年 7月19日 ~ 2018年 7月17日	0	823,765,086
第3期	2018年 7月18日 ~ 2019年 7月17日	0	63,196,318
第4期	2019年 7月18日 ~ 2020年 7月17日	0	44,886,784
第5期	2020年 7月18日 ~ 2021年 7月19日	0	21,709,005
第6期	2021年 7月20日 ~ 2022年 7月19日	0	8,764,072

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考)

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)

以下の運用状況は2022年 7月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	63,166,999	99.01
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		631,361	0.99
合計(純資産総額)		63,798,360	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	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-K OKUSAI(ヘッジなし)マザー ファンド	14,848,150	4.2155	62,592,377	4.2542	63,166,999	99.01

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.01
合計	99.01

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 7月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	177,364,030,604	68.84
	カナダ	9,626,892,292	3.74
	ドイツ	5,527,672,633	2.15
	イタリア	1,155,259,099	0.45
	フランス	7,568,273,276	2.94
	オランダ	4,367,231,135	1.70
	スペイン	1,748,653,565	0.68
	ベルギー	590,335,081	0.23
	オーストリア	121,842,185	0.05
	ルクセンブルク	166,092,072	0.06
	フィンランド	873,057,392	0.34
	アイルランド	4,670,297,896	1.81
	ポルトガル	130,073,831	0.05
	イギリス	10,865,931,359	4.22
	スイス	8,590,394,973	3.33
	スウェーデン	2,426,873,259	0.94
	ノルウェー	603,476,643	0.23
	デンマーク	2,087,481,108	0.81
	ケイマン	516,294,023	0.20
	オーストラリア	5,383,018,246	2.09
	バミューダ	113,312,234	0.04
	ニュージーランド	187,686,017	0.07
	香港	1,838,985,608	0.71
	シンガポール	816,360,919	0.32
	イスラエル	655,543,595	0.25
	ジャージー	788,082,808	0.31
アラブ首長国連邦	0	0.00	
マン島	41,342,861	0.02	
小計		248,824,494,714	96.58
投資証券	アメリカ	5,650,818,285	2.19
	カナダ	14,005,062	0.01
	フランス	103,760,432	0.04
	ベルギー	22,336,943	0.01
	イギリス	138,790,142	0.05

	オーストラリア	350,493,121	0.14
	香港	91,285,248	0.04
	シンガポール	127,589,607	0.05
	小計	6,499,078,840	2.52
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		2,312,695,151	0.90
合計（純資産総額）		257,636,268,705	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	3,152,919,551	1.22
	買建	ドイツ	571,529,587	0.22

(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		4,615,564,138	1.79

(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	630,274	20,041.07	12,631,371,153	21,180.88	13,349,760,167	5.18
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	275,064	41,265.47	11,350,646,204	37,207.55	10,234,457,561	3.97
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	353,740	22,037.36	7,795,497,820	16,460.11	5,822,599,594	2.26
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	33,975	135,053.90	4,588,456,413	113,435.84	3,853,982,902	1.50
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	232,520	18,373.32	4,272,164,537	15,375.15	3,575,030,855	1.39
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	219,460	18,540.52	4,068,903,860	15,424.95	3,385,161,700	1.31
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サービス	36,410	61,013.44	2,221,499,709	72,889.96	2,653,923,768	1.03
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	101,651	22,191.64	2,255,803,233	23,449.06	2,383,620,601	0.93
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	96,730	31,040.90	3,002,587,152	24,208.26	2,341,665,222	0.91
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	163,951	8,862.64	1,453,038,895	12,470.27	2,044,513,302	0.79

アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	49,935	39,086.04	1,951,761,834	39,561.87	1,975,522,428	0.77
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	89,240	43,190.56	3,854,326,235	21,634.51	1,930,664,493	0.75
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	92,689	19,024.24	1,763,338,050	19,930.35	1,847,324,823	0.72
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	64,132	31,235.19	2,003,175,744	28,449.82	1,824,544,081	0.71
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	108,890	16,473.36	1,793,784,358	16,505.18	1,797,250,139	0.70
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	114,340	22,661.70	2,591,139,688	15,454.57	1,767,076,003	0.69
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	40,465	49,457.71	2,001,306,544	40,333.19	1,632,082,707	0.63
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	33,760	48,368.47	1,632,919,579	47,443.29	1,601,685,622	0.62
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	75,431	15,694.47	1,183,850,123	20,243.99	1,527,025,006	0.59
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	217,570	5,894.47	1,282,460,136	6,827.41	1,485,441,595	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	31,334	33,516.51	1,050,206,350	44,528.98	1,395,271,310	0.54
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	68,476	14,994.13	1,026,738,491	20,157.84	1,380,328,765	0.54
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	159,312	7,380.52	1,175,805,700	8,623.11	1,373,765,952	0.53
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	281,499	6,299.24	1,773,231,861	4,485.20	1,262,580,779	0.49
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	53,491	21,524.22	1,151,352,452	23,535.21	1,258,922,046	0.49
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	27,233	50,185.20	1,366,693,683	45,741.94	1,245,690,456	0.48
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	17,194	66,123.94	1,136,935,065	72,175.18	1,240,980,213	0.48
アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	15,159	81,414.70	1,234,165,558	80,448.32	1,219,516,089	0.47
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	97,793	11,040.61	1,079,695,028	12,106.82	1,183,962,581	0.46
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	15,752	92,634.58	1,459,180,044	74,856.15	1,179,134,075	0.46

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	5.05
		素材	4.03
		資本財	5.96

	商業・専門サービス	1.21
	運輸	1.96
	自動車・自動車部品	2.30
	耐久消費財・アパレル	1.64
	消費者サービス	1.75
	メディア・娯楽	5.62
	小売	4.79
	食品・生活必需品小売り	1.55
	食品・飲料・タバコ	4.31
	家庭用品・パーソナル用品	1.81
	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	8.99
	銀行	5.62
	各種金融	4.62
	保険	2.99
	不動産	0.36
	ソフトウェア・サービス	11.16
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.64
	電気通信サービス	1.51
	公益事業	3.23
	半導体・半導体製造装置	4.61
投資証券		2.52
合計		99.10

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	115	米ドル	22,123,837.5	2,978,089,766	23,422,625	3,152,919,551	1.22
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2209	買建	115	ユーロ	3,983,520	546,738,119	4,164,150	571,529,587	0.22

(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	28,100,000.00	3,792,721,280	3,774,446,400	1.47
	加ドル	買建	456,000.00	47,918,076	47,902,344	0.02

ユーロ	買建	4,200,000.00	584,371,570	576,251,260	0.22
英ポンド	買建	466,000.00	76,348,368	76,347,016	0.03
スイスフラン	買建	485,000.00	68,418,998	68,418,950	0.03
スウェーデンクローナ	買建	1,120,000.00	14,775,600	14,782,880	0.01
ノルウェークローネ	買建	795,000.00	11,005,503	11,009,239	0.00
デンマーククローネ	買建	1,020,000.00	18,816,144	18,808,800	0.01
香港ドル	買建	540,000.00	9,257,598	9,259,974	0.00
シンガポールドル	買建	188,000.00	18,327,556	18,337,275	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。

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)

以下の運用状況は2022年7月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	32,944,309	99.02
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		326,267	0.98
合計(純資産総額)		33,270,576	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	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	10,880,969	2.8610	31,130,453	3.0277	32,944,309	99.02

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.02
合計	99.02

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 7月29日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	47,317,508,924	77.80
	カナダ	1,118,806,842	1.84
	ドイツ	34,791,393	0.06
	イタリア	16,911,784	0.03
	フランス	948,018,986	1.56
	オランダ	105,414,739	0.17
	スペイン	232,050,316	0.38
	ベルギー	686,021,069	1.13
	アイルランド	27,984,627	0.05
	イギリス	3,079,115,700	5.06
	オーストラリア	3,848,394,081	6.33
	ニュージーランド	128,638,391	0.21
	香港	908,439,278	1.49
	シンガポール	2,195,884,045	3.61
	韓国	120,407,581	0.20
	イスラエル	66,135,530	0.11
ガンジー	162,497,142	0.27	
	小計	60,997,020,428	100.29
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		174,127,315	0.29
合計（純資産総額）		60,822,893,113	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		616,563,482	1.01

(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)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	232,836	15,009.44	3,494,739,105	17,822.36	4,149,687,944	6.82
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	28,632	83,765.49	2,398,373,514	95,749.43	2,741,497,940	4.51
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	48,039	40,277.52	1,934,891,870	45,377.03	2,179,867,192	3.58
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	189,258	8,517.52	1,612,010,264	9,899.21	1,873,506,465	3.08
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	142,815	10,473.25	1,495,738,397	11,573.76	1,652,907,648	2.72
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	89,581	16,837.61	1,508,330,539	18,432.14	1,651,170,187	2.71
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	103,271	13,028.64	1,345,481,621	14,465.19	1,493,834,698	2.46
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	302,589	3,822.51	1,156,651,165	4,549.81	1,376,724,879	2.26
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	44,016	25,046.68	1,102,454,854	28,569.62	1,257,520,676	2.07
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	107,702	9,299.97	1,001,626,188	10,465.92	1,127,201,324	1.85
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	42,227	21,514.83	908,506,884	25,325.52	1,069,420,961	1.76
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	46,720	18,357.66	857,669,994	21,968.35	1,026,361,405	1.69
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORPORATION	120,921	6,951.24	840,552,084	8,406.39	1,016,509,629	1.67
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	191,944	4,553.36	873,991,980	5,198.63	997,847,411	1.64
オーストラ リア	投資証券	GOODMAN GROUP	526,417	1,692.08	890,742,387	1,864.21	981,356,047	1.61
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	125,750	6,545.73	823,125,924	7,177.40	902,558,704	1.48
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	36,324	21,665.92	786,993,125	24,766.89	899,632,654	1.48
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	38,258	20,424.51	781,401,180	21,992.58	841,392,195	1.38
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	20,574	34,611.20	712,090,928	38,336.92	788,743,957	1.30
香港	投資証券	LINK REIT	664,100	1,169.49	776,662,134	1,117.32	742,013,872	1.22
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	60,779	10,921.49	663,797,652	11,418.96	694,033,353	1.14
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	378,156	1,570.85	594,029,752	1,737.73	657,135,030	1.08
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	33,523	17,044.70	571,389,601	19,024.43	637,756,010	1.05
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	170,028	3,180.81	540,827,158	3,700.42	629,176,525	1.03
アメリカ	投資証券	UDR INC	94,215	5,731.49	539,992,989	6,496.27	612,046,888	1.01
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	91,382	6,378.87	582,914,214	6,461.28	590,444,689	0.97
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	194,075	2,596.09	503,837,219	2,942.57	571,080,166	0.94
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	44,904	12,202.43	547,938,239	12,125.66	544,491,032	0.90
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	224,640	2,307.76	518,416,359	2,410.86	541,576,736	0.89
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	54,462	9,279.82	505,397,920	9,823.83	535,025,854	0.88

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	100.29
合 計	100.29

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	3,300,000.00	444,114,660	444,117,300	0.73
	加ドル	買建	100,000.00	10,507,000	10,504,900	0.02
	英ポンド	買建	250,000.00	40,954,250	40,958,700	0.07
	豪ドル	買建	600,000.00	56,516,520	56,507,640	0.09
	ニュージーランドドル	買建	20,000.00	1,693,620	1,692,452	0.00
	香港ドル	買建	850,000.00	14,572,145	14,575,885	0.02
	シンガポールドル	買建	350,000.00	34,120,450	34,138,545	0.06
	韓国ウォン	買建	135,400,000.00	14,031,502	14,068,060	0.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

インデックスファンド海外新興国債券(適格機関投資家向け)

以下の運用状況は2022年7月29日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	8,445,830	99.01
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		84,556	0.99
合計(純資産総額)		8,530,386	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	親投資信託受益証券	海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし)マザーファンド	6,233,545	1.3554	8,448,946	1.3549	8,445,830	99.01

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.01
合計	99.01

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。

海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2022年 7月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	メキシコ	762,244,429	10.04
	ブラジル	754,411,481	9.94
	チリ	155,761,152	2.05
	コロンビア	296,885,185	3.91
	ペルー	163,389,126	2.15
	ウルグアイ	16,294,766	0.21
	ドミニカ共和国	19,651,370	0.26
	トルコ	67,052,728	0.88
	チェコ	368,931,433	4.86
	ハンガリー	205,820,795	2.71
	ポーランド	497,580,133	6.55
	ロシア	0	0.00
	ルーマニア	240,545,079	3.17
	マレーシア	751,024,360	9.89
	タイ	734,709,627	9.68
	インドネシア	743,459,918	9.79
	中国	752,598,493	9.91
	エジプト	103,476,985	1.36
	南アフリカ	738,523,523	9.73
	セルビア	16,281,482	0.21
	小計	7,388,642,065	97.33
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		202,815,361	2.67
合計（純資産総額）		7,591,457,426	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		614,378	0.01
	売建		619,267	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 (%)
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	9,950,000	2,123.48	211,286,873	2,168.75	215,791,039		2024/1/1	2.84
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	15,300,000	880.08	134,653,412	860.71	131,688,968	10.500	2026/12/21	1.73
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	5,600,000	2,305.04	129,082,515	2,305.04	129,082,515		2023/7/1	1.70
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	16,300,000	595.49	97,066,375	601.51	98,046,843	5.750	2026/3/5	1.29
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,430,000	729.10	97,919,041	714.88	96,008,692	8.000	2030/1/31	1.26
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,850,000	656.83	97,539,779	640.65	95,137,793	8.750	2048/2/28	1.25
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	3,700,000	2,372.73	87,791,134	2,356.34	87,184,779	10.000	2027/1/1	1.15
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	3,490,000	2,443.50	85,278,154	2,447.45	85,416,073	10.000	2025/1/1	1.13
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	12,450,000	620.38	77,238,491	625.98	77,935,729	7.750	2031/5/29	1.03
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	12,130,000	629.09	76,308,953	632.21	76,687,358	7.500	2027/6/3	1.01
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10,650,000	704.78	75,060,132	690.45	73,533,679	8.250	2032/3/31	0.97
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	11,300,000	649.22	73,361,938	648.18	73,244,746	8.000	2024/9/5	0.96
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	3,900,000	1,816.41	70,840,087	1,826.77	71,244,192		2025/7/1	0.94
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	3,400,000	2,014.66	68,498,676	2,049.42	69,680,491		2024/7/1	0.92
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,260,000	653.39	67,038,306	657.10	67,418,727	8.500	2029/5/31	0.89
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,600,000	706.02	67,778,067	691.52	66,386,875	8.875	2035/2/28	0.87
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10,010,000	669.99	67,066,181	654.57	65,523,047	8.500	2037/1/31	0.86
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3,100,000	2,064.24	63,991,467	2,067.90	64,105,142	3.290	2029/5/23	0.84
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,010,000	678.46	61,129,852	674.94	60,812,149	10.000	2024/12/5	0.80
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000	2,013.71	60,411,523	2,019.65	60,589,635	2.850	2027/6/4	0.80
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	2,640,000	2,301.49	60,759,412	2,271.12	59,957,829	10.000	2029/1/1	0.79
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000	1,965.93	58,978,156	1,974.27	59,228,354	2.680	2030/5/21	0.78
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,830,000	654.40	57,784,064	651.91	57,564,283	8.000	2023/12/7	0.76
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,830,000	662.12	58,465,324	645.15	56,967,199	8.750	2044/1/31	0.75
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,110,000	2,437.37	51,428,542	2,513.04	53,025,248	2.500	2026/7/25	0.70

メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,190,000	642.37	52,610,584	646.31	52,933,348	8.500	2038/11/18	0.70
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,680,000	600.70	52,141,303	609.60	52,913,602	8.000	2047/11/7	0.70
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,190,000	2,212.73	48,458,945	2,372.89	51,966,354	2.750	2029/10/25	0.68
マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	1,870,000	2,579.33	48,233,564	2,748.56	51,398,099	3.757	2040/5/22	0.68
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1,900,000	2,587.84	49,169,131	2,645.52	50,264,965	3.250	2025/7/25	0.66

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.33
合計	97.33

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	4,565.12	628,322	614,378	0.01
	ルーマニアレイ	売建	22,265.00	628,322	619,267	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。

F O F s用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)

以下の運用状況は2022年7月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	3,595,552,858	96.87
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		116,060,839	3.13
合計(純資産総額)		3,711,613,697	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		3,631,070,850	97.83

(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 (%)
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・マザーファンド	2,408,596,502	1.4962	3,603,971,489	1.4928	3,595,552,858	96.87

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	96.87
合計	96.87

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	27,035,000.00	3,729,057,128	3,631,070,850	97.83

(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。

ゴールド・マザーファンド

以下の運用状況は2022年 7月29日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	160,500,283,539	100.04
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		61,636,578	0.04
合計(純資産総額)		160,438,646,961	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		110,356,420	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	投資信託受益証券	iシェアーズ ゴールド・トラスト	20,825,000	5,108.44	106,383,460,837	4,489.24	93,488,495,887	58.27
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR GOLD MINISHARES TRUST-ETF	12,000,000	5,178.24	62,138,979,149	4,693.85	56,326,208,400	35.11
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR GOLD TRUST-ETF	485,100	22,905.64	11,111,529,713	22,027.58	10,685,579,252	6.66

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	100.04
合計	100.04

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	820,000.00	110,355,518	110,356,420	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。

インデックス マザーファンド TOPIX

以下の運用状況は2022年 7月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	43,751,747,920	99.73
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		116,897,452	0.27
合計(純資産総額)		43,868,645,372	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	116,250,000	0.26

(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	803,300	2,181.17	1,752,137,124	2,137.00	1,716,652,100	3.91
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	110,400	12,419.63	1,371,127,500	11,695.00	1,291,128,000	2.94
日本	株式	キーエンス	電気機器	16,000	56,229.75	899,676,000	52,430.00	838,880,000	1.91
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,017,100	753.41	766,297,736	745.40	758,146,340	1.73
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	193,900	3,378.15	655,024,900	3,807.00	738,177,300	1.68
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	120,600	5,742.10	692,498,367	4,953.00	597,331,800	1.36
日本	株式	任天堂	その他製品	9,900	57,870.60	572,919,000	59,710.00	591,129,000	1.35
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	103,800	5,268.34	546,853,700	5,605.00	581,799,000	1.33
日本	株式	日立製作所	電気機器	84,800	5,865.81	497,420,700	6,704.00	568,499,200	1.30
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	138,500	3,517.59	487,186,700	3,925.00	543,612,500	1.24
日本	株式	KDDI	情報・通信業	126,200	3,766.00	475,269,300	4,292.00	541,650,400	1.23
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	11,200	56,217.14	629,632,000	46,010.00	515,312,000	1.17
日本	株式	信越化学工業	化学	27,400	18,720.80	512,950,166	16,960.00	464,704,000	1.06
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	112,700	4,348.48	490,074,356	4,107.00	462,858,900	1.06
日本	株式	HOYA	精密機器	34,000	15,183.44	516,237,000	13,270.00	451,180,000	1.03
日本	株式	第一三共	医薬品	127,800	2,392.96	305,820,531	3,523.00	450,239,400	1.03
日本	株式	三菱商事	卸売業	113,800	4,058.66	461,875,550	3,948.00	449,282,400	1.02
日本	株式	ダイキン工業	機械	19,200	21,529.40	413,364,552	23,250.00	446,400,000	1.02
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	128,800	3,571.27	459,979,594	3,388.00	436,374,400	0.99
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	262,100	1,440.82	377,641,400	1,538.50	403,240,850	0.92
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	104,000	3,835.52	398,894,616	3,866.00	402,064,000	0.92
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	48,400	7,050.38	341,238,800	7,764.00	375,777,600	0.86
日本	株式	村田製作所	電気機器	48,100	7,992.02	384,416,360	7,747.00	372,630,700	0.85
日本	株式	三井物産	卸売業	125,700	3,059.53	384,583,254	2,925.50	367,735,350	0.84
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	17,900	22,301.24	399,192,274	20,150.00	360,685,000	0.82
日本	株式	日本電産	電気機器	39,100	10,048.60	392,900,448	9,198.00	359,641,800	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	15,500	22,698.87	351,832,500	22,825.00	353,787,500	0.81
日本	株式	S M C	機械	5,200	63,128.65	328,269,000	65,410.00	340,132,000	0.78

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	208,200	1,634.69	340,344,368	1,583.50	329,684,700	0.75
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	58,200	5,699.02	331,683,330	5,429.00	315,967,800	0.72

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	0.30
		建設業	2.20
		食料品	3.36
		繊維製品	0.45
		パルプ・紙	0.18
		化学	6.21
		医薬品	5.33
		石油・石炭製品	0.53
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.71
		鉄鋼	0.77
		非鉄金属	0.70
		金属製品	0.61
		機械	5.31
		電気機器	17.66
		輸送用機器	7.83
		精密機器	2.78
		その他製品	2.49
		電気・ガス業	1.29
		陸運業	3.03
		海運業	0.68
		空運業	0.42
		倉庫・運輸関連業	0.16
		情報・通信業	9.22
		卸売業	5.40
		小売業	4.34
		銀行業	5.30
		証券、商品先物取引業	0.73
		保険業	2.21
その他金融業	1.18		
不動産業	1.99		
サービス業	5.55		
合計			99.73

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		6日本円	113,753,300	116,250,000	0.26

(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。

ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド

以下の運用状況は2022年 7月29日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	ベルギー	21,772,718,836	41.29
	イギリス	2,823,288,956	5.35
	小計	24,596,007,792	46.64
地方債証券	オーストラリア	3,768,352,326	7.15
特殊債券	カナダ	7,692,685,486	14.59
	ドイツ	811,988,184	1.54
	オランダ	1,239,682,933	2.35
	オーストリア	735,215,952	1.39
	ノルウェー	2,371,490,438	4.50
	国際機関	9,013,204,388	17.09
	小計	21,864,267,381	41.46
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		2,504,414,109	4.75
合計（純資産総額）		52,733,041,608	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		49,896,553,367	94.62

(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(%)
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	71,500,000	14,312.42	10,233,387,449	13,472.84	9,633,083,674	1.000	2031/6/22	18.27
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	35,700,000	17,425.94	6,221,062,482	15,779.74	5,633,368,001	3.000	2034/6/22	10.68
国際機関	特殊債券	EUROFIMA	58,560,000	9,831.18	5,757,141,868	8,982.05	5,259,889,072	3.350	2029/5/21	9.97
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	37,200,000	14,634.85	5,444,166,735	13,535.62	5,035,251,551	1.250	2033/4/22	9.55
カナダ	特殊債券	CANADA HOUSING TRUST	38,400,000	9,469.22	3,636,180,922	8,976.59	3,447,012,712	1.100	2031/3/15	6.54
カナダ	特殊債券	CANADA HOUSING TRUST	32,040,000	10,099.23	3,235,796,111	9,584.38	3,070,838,181	1.750	2030/6/15	5.82
ノルウェー	特殊債券	KOMMUNALBANKEN AS	27,990,000	9,276.87	2,596,598,411	8,472.63	2,371,490,438	2.400	2029/11/21	4.50
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	162,000,000	1,603.40	2,597,514,480	1,458.65	2,363,016,894	3.750	2032/6/1	4.48
国際機関	特殊債券	NORDIC INVESTMENT BANK	102,500,000	1,475.91	1,512,812,978	1,356.38	1,390,298,422	2.940	2031/10/17	2.64
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	10,400,000	11,866.56	1,234,122,354	12,383.43	1,287,877,088	0.350	2032/6/22	2.44
イギリス	国債証券	UK TREASURY	5,500,000	19,659.32	1,081,262,982	19,913.90	1,095,264,819	4.250	2032/6/7	2.08
オーストラリア	地方債証券	TREASURY CORP VICTORIA	13,300,000	8,625.89	1,147,243,902	7,794.27	1,036,638,226	1.500	2031/9/10	1.97
イギリス	国債証券	UK TREASURY	7,000,000	14,195.94	993,715,861	14,548.60	1,018,402,353	0.875	2033/7/31	1.93
オランダ	特殊債券	NEDER WATERSCHAPSBANK	10,750,000	9,870.52	1,061,081,099	9,022.36	969,903,896	3.300	2029/5/2	1.84
カナダ	特殊債券	CANADA HOUSING TRUST	10,000,000	9,810.89	981,089,928	9,271.14	927,114,535	1.600	2031/12/15	1.76
ドイツ	特殊債券	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	10,000,000	8,932.12	893,212,925	8,119.88	811,988,184	1.900	2030/1/30	1.54
オーストラリア	地方債証券	WESTERN AUST TREAS CORP	10,000,000	8,863.97	886,397,508	8,024.83	802,483,376	1.750	2031/10/22	1.52
オーストラリア	特殊債券	OEKB OEST. KONTROLLBANK	60,000,000	1,298.72	779,233,688	1,225.35	735,215,952	1.370	2028/11/13	1.39
イギリス	国債証券	UK TREASURY	4,700,000	14,941.17	702,235,139	15,098.33	709,621,784	1.000	2032/1/31	1.35
オーストラリア	地方債証券	QUEENSLAND TREASURY CORP	7,700,000	7,345.05	565,569,358	7,894.05	607,841,933	2.000	2033/8/22	1.15
オーストラリア	地方債証券	TREASURY CORP VICTORIA	6,000,000	10,911.54	654,692,638	9,771.47	586,288,573	4.250	2032/12/20	1.11
オーストラリア	地方債証券	NEW S WALES TREASURY CRP	4,600,000	7,957.83	366,060,634	7,708.99	354,613,843	1.500	2032/2/20	0.67
オランダ	特殊債券	BNG BANK NV	3,000,000	9,871.29	296,138,772	8,992.63	269,779,037	3.300	2029/4/26	0.51
カナダ	特殊債券	CANADA HOUSING TRUST	2,500,000	10,424.98	260,624,670	9,908.80	247,720,058	2.100	2029/9/15	0.47
オーストラリア	地方債証券	TREASURY CORP VICTORIA	3,000,000	8,732.34	261,970,200	7,976.29	239,288,848	1.500	2030/11/20	0.45
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	1,480,000	14,116.16	208,919,205	12,374.22	183,138,522	1.600	2047/6/22	0.35
オーストラリア	地方債証券	QUEENSLAND TREASURY CORP	2,000,000	8,330.36	166,607,233	7,059.87	141,197,527	2.250	2041/11/20	0.27

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	46.64
地方債証券	7.15
特殊債券	41.46
合計	95.25

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	加ドル	売建	72,850,000.00	7,658,647,010	7,613,029,160	14.44
	ユーロ	売建	158,040,000.00	22,453,087,738	21,676,430,904	41.11
	英ポンド	売建	16,950,000.00	2,753,886,955	2,767,512,870	5.25
	スウェーデンクローナ	売建	336,580,000.00	4,421,277,740	4,425,148,084	8.39
	豪ドル	売建	143,130,000.00	13,312,992,450	13,414,432,349	25.44

(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。

インデックス マザーファンド リート

以下の運用状況は2022年 7月29日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	日本	37,285,384,850	98.02
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		751,676,005	1.98
合計（純資産総額）		38,037,060,855	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	745,710,000	1.96

(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	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	3,873	673,000	2,606,529,000	706,000	2,734,338,000	7.19

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	3,320	603,000	2,001,960,000	643,000	2,134,760,000	5.61
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	5,439	318,000	1,729,602,000	346,000	1,881,894,000	4.95
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	16,749	101,000	1,691,649,000	108,400	1,815,591,600	4.77
日本	投資証券	G L P 投資法人 投資証券	10,223	154,200	1,576,386,600	175,100	1,790,047,300	4.71
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	10,735	159,600	1,713,306,000	166,700	1,789,524,500	4.70
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,004	290,027.57	1,451,298,000	320,500	1,603,782,000	4.22
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	6,614	175,100	1,158,111,400	191,100	1,263,935,400	3.32
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,319	334,500	1,110,205,500	367,000	1,218,073,000	3.20
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	7,473	135,000	1,008,855,000	145,000	1,083,585,000	2.85
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	2,270	388,000	880,760,000	406,500	922,755,000	2.43
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	4,961	172,455.57	855,552,100	185,100	918,281,100	2.41
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	10,088	75,500	761,644,000	83,400	841,339,200	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	1,146	641,000	734,586,000	696,000	797,616,000	2.10
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	10,705	61,267.82	655,872,100	69,000	738,645,000	1.94
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	1,753	394,000	690,682,000	417,500	731,877,500	1.92
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	2,238	306,500	685,947,000	320,000	716,160,000	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	4,064	166,200	675,436,800	175,600	713,638,400	1.88
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	976	627,000	611,952,000	715,000	697,840,000	1.83
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	1,311	506,000	663,366,000	523,000	685,653,000	1.80
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,232	505,899.35	623,268,000	543,000	668,976,000	1.76
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	14,611	38,350	560,331,850	41,850	611,470,350	1.61
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	3,903	144,200	562,812,600	153,000	597,159,000	1.57
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	3,675	146,100	536,917,500	156,100	573,667,500	1.51
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	4,491	111,400	500,297,400	125,800	564,967,800	1.49
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	2,381	202,100	481,200,100	223,700	532,629,700	1.40
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	1,544	320,500	494,852,000	336,500	519,556,000	1.37
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,106	153,800	477,702,800	166,700	517,770,200	1.36
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,024	434,393.55	444,819,000	477,500	488,960,000	1.29
日本	投資証券	N T T 都市開発リート投資法人 投資証券	3,191	143,100	456,632,100	152,500	486,627,500	1.28

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.02
合計	98.02

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REIT指数先物 2022年09月	買建	371	日本円	702,772,120	745,710,000	1.96

(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。

インデックス マザーファンド 海外先進国債券

以下の運用状況は2022年 7月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	41,841,231	50.08
	カナダ	1,685,858	2.02
	メキシコ	660,296	0.79
	ドイツ	5,412,789	6.48
	イタリア	6,382,236	7.64
	フランス	7,231,440	8.66
	オランダ	1,416,837	1.70
	スペイン	4,248,295	5.08
	ベルギー	1,673,813	2.00
	オーストリア	987,074	1.18
	フィンランド	416,571	0.50
	アイルランド	558,524	0.67
	イギリス	4,232,271	5.07
	スウェーデン	258,242	0.31
	ノルウェー	186,458	0.22
	デンマーク	312,291	0.37
	ポーランド	326,695	0.39
	オーストラリア	1,317,283	1.58
	シンガポール	388,097	0.46
	マレーシア	451,645	0.54
中国	2,010,910	2.41	
イスラエル	392,285	0.47	
小計		82,391,141	98.61

コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,160,404	1.39
合計（純資産総額）		83,551,545	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 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	81,000	13,241.58	10,725,684	13,324.81	10,793,097	2.375	2024/8/15	12.92
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	75,000	13,023.51	9,767,638	13,239.89	9,929,918	2.375	2027/5/15	11.88
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	39,000	12,999.85	5,069,943	13,046.65	5,088,195	0.250	2023/9/30	6.09
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	31,000	15,786.70	4,893,877	16,214.19	5,026,399	4.375	2038/2/15	6.02
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	24,000	12,130.67	2,911,361	12,374.12	2,969,790	1.250	2028/5/31	3.55
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	17,000	15,940.21	2,709,837	16,042.54	2,727,233	5.250	2029/11/1	3.26
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	17,000	12,613.90	2,144,363	12,856.04	2,185,527	2.875	2049/5/15	2.62
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	15,000	13,600.98	2,040,148	13,725.03	2,058,755	0.500	2025/5/25	2.46
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	10,000	17,371.41	1,737,141	17,807.88	1,780,788	5.500	2029/4/25	2.13
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	12,000	13,708.10	1,644,972	13,728.15	1,647,379	2.000	2025/12/1	1.97
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	18,000	8,919.48	1,605,507	9,087.75	1,635,795	1.375	2050/8/15	1.96
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	8,000	18,366.12	1,469,290	19,361.23	1,548,899	4.500	2041/4/25	1.85
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,000	18,026.82	1,442,146	18,892.18	1,511,375	4.900	2040/7/30	1.81
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,000	17,490.11	1,399,209	17,780.92	1,422,474	6.500	2027/7/4	1.70
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,000	16,447.53	1,315,803	16,868.02	1,349,442	5.150	2028/10/31	1.62
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	7,000	18,021.00	1,261,470	18,789.92	1,315,295	4.750	2035/4/25	1.57
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,000	13,891.70	1,250,253	14,057.95	1,265,216	1.600	2025/4/30	1.51
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	60,000	2,029.78	1,217,868	2,032.41	1,219,450	3.010	2028/5/13	1.46
イギリス	国債証券	UK TREASURY	6,000	19,865.91	1,191,955	20,262.01	1,215,721	4.750	2030/12/7	1.46
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000	16,409.84	1,148,689	16,498.10	1,154,867	4.750	2044/9/1	1.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000	11,456.04	1,031,044	11,682.66	1,051,440	2.500	2046/2/15	1.26
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000	11,734.21	938,737	12,029.71	962,377	1.375	2031/11/15	1.15
オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,000	10,293.78	926,441	10,501.01	945,091	4.500	2033/4/21	1.13
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	5,000	16,988.12	849,406	17,347.66	867,383	5.500	2028/3/28	1.04
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000	13,711.96	822,718	13,824.01	829,441	0.500	2025/2/15	0.99
イギリス	国債証券	UNITED KINGDOM GILT	5,000	16,431.88	821,594	16,560.68	828,034	2.000	2025/9/7	0.99
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000	18,406.32	736,253	19,210.22	768,409	4.000	2037/1/4	0.92
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000	18,662.82	746,513	19,184.52	767,381	5.500	2031/1/4	0.92
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000	12,249.50	734,970	12,390.15	743,409	0.250	2025/10/31	0.89
オーストラリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,000	17,355.20	694,208	18,127.20	725,088	4.150	2037/3/15	0.87

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.61
合 計	98.61

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。

先進国資本エマージング株式マザーファンド

以下の運用状況は2022年 7月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	メキシコ	362,093,931	3.72
	ブラジル	1,114,700,088	11.44
	チリ	509,928,037	5.24
	ギリシャ	174,988,084	1.80
	トルコ	88,223,371	0.91
	チェコ	194,685,078	2.00
	ポーランド	189,460,635	1.95
	ケイマン	878,820,173	9.02
	マレーシア	374,047,619	3.84
	タイ	204,934,635	2.10
	フィリピン	269,495,967	2.77
	インドネシア	549,064,506	5.64
	韓国	180,741,832	1.86
	台湾	50,090,159	0.51
	中国	1,843,120,064	18.92
	インド	1,866,220,394	19.16
	エジプト	47,974,762	0.49
	南アフリカ	589,548,931	6.05
	サウジアラビア	160,059,001	1.64
	小計		9,648,197,267
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		92,391,799	0.95

合計(純資産総額)	9,740,589,066	100.00
-----------	---------------	--------

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		9,420,670	0.10

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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 (%)
中国	株式	YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	食品・飲料・タバコ	376,334	988.58	372,036,655	932.17	350,807,876	3.60
ブラジル	株式	AMBEV SA-ADR	食品・飲料・タバコ	720,878	335.17	241,623,095	387.67	279,467,676	2.87
中国	株式	ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	耐久消費財・アパレル	276,024	1,140.85	314,902,430	950.11	262,255,143	2.69
インドネシア	株式	UNILEVER INDONESIA TBK PT	家庭用品・パーソナル用品	6,118,900	45.72	279,801,999	41.04	251,125,774	2.58
中国	株式	SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	食品・飲料・タバコ	156,090	1,733.77	270,625,633	1,478.91	230,843,486	2.37
メキシコ	株式	WALMART DE MEXICO -SER V	食品・生活必需品小売り	451,800	451.74	204,096,784	488.51	220,710,010	2.27
中国	株式	CHONGQING BREWERY CO-A	食品・飲料・タバコ	86,900	2,624.67	228,084,647	2,513.97	218,464,181	2.24
インド	株式	SIEMENS LTD	資本財	46,839	3,883.82	181,914,245	4,561.77	213,669,213	2.19
ケイマン	株式	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	家庭用品・パーソナル用品	592,000	305.05	180,594,053	355.86	210,670,600	2.16
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	41,000	5,165.58	211,788,780	4,959.78	203,350,980	2.09
ブラジル	株式	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	公益事業	177,650	1,088.52	193,376,075	1,142.49	202,964,209	2.08
ブラジル	株式	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	食品・生活必需品小売り	420,000	421.65	177,095,782	473.81	199,001,168	2.04
インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LTD	家庭用品・パーソナル用品	43,768	3,733.02	163,387,257	4,454.17	194,950,113	2.00
チェコ	株式	KOMERCNI BANKA AS	銀行	56,142	3,866.00	217,045,228	3,467.72	194,685,078	2.00
マレーシア	株式	IHH HEALTHCARE BHD	ヘルスケア機器・サービス	1,000,700	191.40	191,535,457	193.21	193,350,959	1.99
インドネシア	株式	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	自動車・自動車部品	3,472,400	63.01	218,821,967	55.05	191,172,982	1.96
インド	株式	NESTLE INDIA LIMITED	食品・飲料・タバコ	5,877	28,844.06	169,516,599	32,491.07	190,950,077	1.96
ブラジル	株式	TELEFONICA BRASIL-ADR	電気通信サービス	160,047	1,184.56	189,586,554	1,172.45	187,647,601	1.93
チリ	株式	ENEL CHILE SA-ADR	公益事業	952,047	175.26	166,857,858	196.53	187,106,368	1.92
チリ	株式	ENEL AMERICAS SA	公益事業	13,892,700	14.09	195,850,483	13.36	185,686,549	1.91

インド	株式	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	自動車・自動車部品	11,757	13,023.61	153,118,641	14,825.78	174,306,754	1.79
南アフリカ	株式	VODACOM GROUP LTD	電気通信サービス	151,992	1,113.77	169,285,498	1,144.83	174,005,077	1.79
ブラジル	株式	TIM SA-ADR	電気通信サービス	104,940	1,622.05	170,217,979	1,634.16	171,489,317	1.76
南アフリカ	株式	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	素材	16,195	11,773.53	190,672,341	10,099.31	163,558,439	1.68
南アフリカ	株式	KUMBA IRON ORE LTD	素材	42,652	3,981.76	169,830,197	3,806.13	162,339,120	1.67
サウジアラビア	株式	SAUDI BRITISH BANK	銀行	106,154	1,392.91	147,864,029	1,507.79	160,059,001	1.64
フィリピン	株式	GLOBE TELECOM INC	電気通信サービス	31,980	5,040.46	161,194,063	4,987.45	159,498,906	1.64
ケイマン	株式	BEIGENE LTD	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	83,300	1,537.80	128,099,328	1,809.32	150,716,772	1.55
タイ	株式	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	電気通信サービス	200,500	745.01	149,374,505	737.67	147,902,835	1.52
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	127,895	1,089.52	139,345,439	1,133.64	144,987,527	1.49

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	素材	9.58
		資本財	3.30
		商業・専門サービス	0.58
		自動車・自動車部品	7.08
		耐久消費財・アパレル	2.69
		消費者サービス	1.46
		メディア・娯楽	0.45
		小売	2.05
		食品・生活必需品小売り	4.31
		食品・飲料・タバコ	15.90
		家庭用品・パーソナル用品	9.14
		ヘルスケア機器・サービス	3.04
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.55
		銀行	12.31
		各種金融	0.75
		保険	1.57
		ソフトウェア・サービス	1.44
電気通信サービス	15.02		
公益事業	6.34		
半導体・半導体製造装置	0.51		
合計			99.05

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	売建	70,000.00	9,538,200	9,420,670	0.10

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

インデックス マザーファンド コモディティ

以下の運用状況は2022年 7月29日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	ドイツ	8,303,762	99.11
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		74,965	0.89
合計（純資産総額）		8,378,727	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 （%）
ドイツ	投資信託受益証券	ISH DIV COMDTY SWAP DE-ETF	2,010	3,987.79	8,015,475	4,131.22	8,303,762	99.11

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	99.11
合計	99.11

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。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

本書提出日現在、取得申込みの受付は行なっておりません。

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

英国証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

(4) 解約制限

ファンドの規模および商品性格などに基づき、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とします。

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(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7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、投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少など、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。

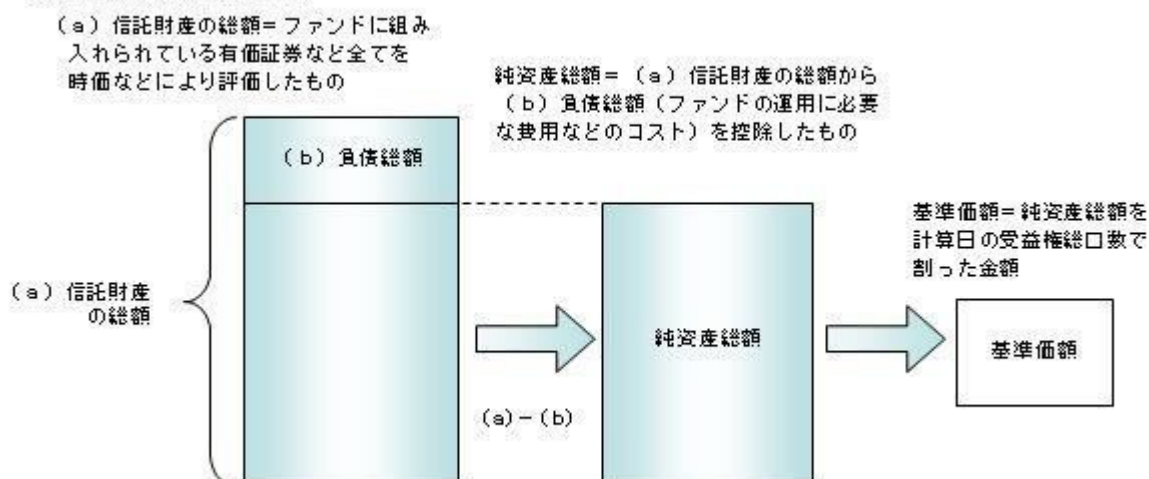
3【資産管理等の概要】

（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1万口当りに換算した価額で表示することがあります。

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

- ・信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。
- <主な資産の評価方法>
投資信託証券（国内籍）
原則として、基準価額計算日の基準価額で評価します。
- ・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。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

2026年7月17日までとします（2016年11月21日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

毎年7月18日から翌年7月17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純資産総額が10億円を下回ることとなった場合
 - 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、委託会社は書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行ないます。(後述の「書面決議」をご覧ください。)
 - 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」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) 2026年6月30日以前の毎営業日において、この信託の1万口当たり基準価額が13,000円以上となった場合
 - ロ) 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、書面決議が困難な場合
 - ハ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ニ) 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たときは、書面決議で可決された場合、存続します。)
 - ホ) 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
 - 4) 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。

信託約款の変更など

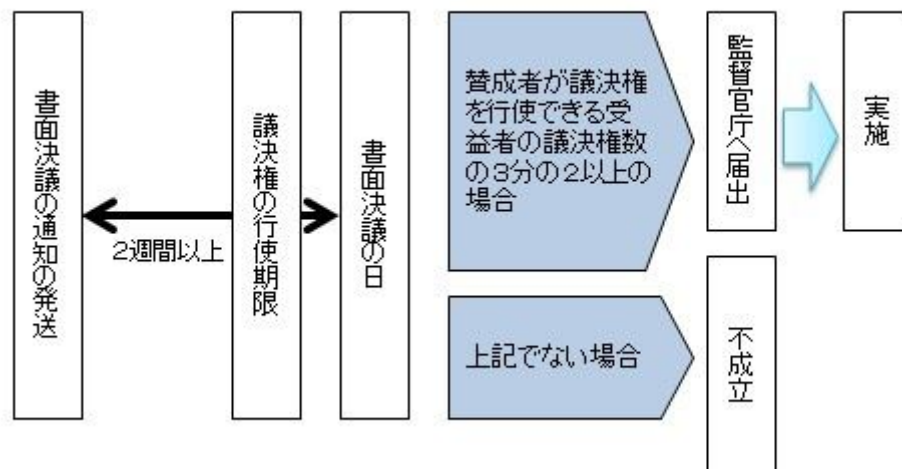
- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合(以下「併合」といいます。)を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものまたは併合(受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。)については、書面決議を行ないます。(後述の「書面決議」をご覧ください。)
- 3) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「書面決議」の規定を適用します。

書面決議

- 1) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の2週間前までに知っている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- 2) 受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。
- 3) 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
- 4) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行ないません。
- 5) 当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。

- 6) 当ファンドは、受益者からの換金請求に対して、投資信託契約の一部を解約することにより応じることができると、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、書面決議において反対した受益者からの買取請求は受け付けません。

<書面決議の主な流れ>



公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

なお、やむを得ない事由によって公告を電子公告によって行なうことができない場合には、公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

- ・販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より1年間とします。ただし、期間満了の3ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長されるものとし、以後も同様とします。
- ・投資顧問会社との投資顧問契約は、当ファンドの信託期間終了まで存続します。ただし、投資顧問会社、委託会社が重大な契約違反を行なったとき、その他契約を継続し難い重大な事由があるときは、相手方に通知をなすことにより契約を終了することができます。

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

受益者は、委託会社または受託会社に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行なうことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2021年7月20日から2022年7月19日まで)の財務諸表について、PWCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-11】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 2021年 7月19日現在	第6期 2022年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,059,300	4,966,342
投資信託受益証券	32,169,706	26,159,547
親投資信託受益証券	87,975,830	79,858,257
未収入金	-	338,768
流動資産合計	124,204,836	111,322,914
資産合計	124,204,836	111,322,914
負債の部		
流動負債		
未払金	-	1,040,762
未払受託者報酬	20,651	18,651
未払委託者報酬	552,360	498,990
未払利息	3	2
その他未払費用	62,637	56,585
流動負債合計	635,651	1,614,990
負債合計	635,651	1,614,990
純資産の部		
元本等		
元本	99,808,179	91,044,107
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	23,761,006	18,663,817
(分配準備積立金)	23,484,719	22,065,638
元本等合計	123,569,185	109,707,924
純資産合計	123,569,185	109,707,924
負債純資産合計	124,204,836	111,322,914

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期		第6期	
	自	2020年 7月18日	自	2021年 7月20日
	至	2021年 7月19日	至	2022年 7月19日
営業収益				
受取利息		-		1
有価証券売買等損益		17,986,071		1,756,373
営業収益合計		17,986,071		1,756,372
営業費用				
支払利息		525		380
受託者報酬		42,550		38,834
委託者報酬		1,138,018		1,038,680
その他費用		129,073		117,791
営業費用合計		1,310,166		1,195,685
営業利益又は営業損失()		16,675,905		2,952,057
経常利益又は経常損失()		16,675,905		2,952,057
当期純利益又は当期純損失()		16,675,905		2,952,057
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()		1,629,583		58,715
期首剰余金又は期首欠損金()		10,610,208		23,761,006
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,895,524		2,086,417
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,895,524		2,086,417
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		23,761,006		18,663,817

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年7月18日から翌年7月17日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2021年7月20日から2022年7月19日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

		第5期 2021年7月19日現在	第6期 2022年7月19日現在
1.	期首元本額	121,517,184円	99,808,179円
	期中追加設定元本額	- 円	- 円
	期中一部解約元本額	21,709,005円	8,764,072円
2.	受益権の総数	99,808,179口	91,044,107口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2020年7月18日 至 2021年7月19日		第6期 自 2021年7月20日 至 2022年7月19日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	1,670,212円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 643,076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	13,376,110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	276,287円	C 信託約款に定める収益調整金 12,331円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	8,438,397円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 21,422,562円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	23,761,006円	E 分配対象収益(A+B+C+D) 22,077,969円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,380円	F 分配対象収益(1万口当たり) 2,424円
G	分配金額	0円	G 分配金額 0円
H	分配金額(1万口当たり)	0円	H 分配金額(1万口当たり) 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第5期 自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19日	第6期 自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第5期 2021年 7月19日現在	第6期 2022年 7月19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。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

第5期（2021年 7月19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
投資信託受益証券	7,140,815
親投資信託受益証券	7,668,062
合計	14,808,877

第6期（2022年 7月19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
投資信託受益証券	1,214,765
親投資信託受益証券	4,166,124
合計	2,951,359

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

第5期 2021年 7月19日現在		第6期 2022年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.2381円	1口当たり純資産額	1.2050円
(1万口当たり純資産額)	(12,381円)	(1万口当たり純資産額)	(12,050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
投資信託受益証券	F O F s用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	4,775,406	5,688,941	
	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）	5,415,138	12,375,214	
	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）	4,074,411	6,398,455	
	インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）	1,453,106	1,696,937	
投資信託受益証券 合計		15,718,061	26,159,547	
親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	6,620,538	16,855,889	
	ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド	30,571,588	36,123,388	
	インデックス マザーファンド Jリート	5,963,890	8,488,404	
	先進国資本エマージング株式マザーファンド	979,968	1,361,469	
	インデックス マザーファンド 海外先進国債券	12,213,540	15,378,068	
	インデックス マザーファンド コモディティ	1,081,514	1,651,039	
親投資信託受益証券 合計		57,431,038	79,858,257	
合計		73,149,099	106,017,804	

(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、「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）」「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）」「インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）」「F O F s用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」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「投資信託受益証券」は同投資信託です。なお、同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。

また、当ファンドは、「インデックス マザーファンド T O P I X」「ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド」「インデックス マザーファンド Jリート」「インデックス マザーファンド 海外先進国債券」

「先進国資本エマージング株式マザーファンド」「インデックス マザーファンド コモディティ」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)

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)

貸借対照表

(単位:円)

	2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,250,814	688,142
親投資信託受益証券	113,399,444	61,642,176
未収入金	-	1,199,065
流動資産合計	114,650,258	63,529,383
資産合計	114,650,258	63,529,383
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	1,215,570
未払受託者報酬	2,190	1,212
未払委託者報酬	4,395	2,440
その他未払費用	121,972	50,880
流動負債合計	128,557	1,270,102
負債合計	128,557	1,270,102
純資産の部		
元本等		
元本	54,480,642	27,243,816
剰余金		
剰余金又は欠損金()	60,041,059	35,015,465
(分配準備積立金)	48,639,932	29,161,181
元本等合計	114,521,701	62,259,281
純資産合計	114,521,701	62,259,281
負債純資産合計	114,650,258	63,529,383

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)

	2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
1. 期首	2020年 7月18日	2021年 7月20日
期首元本額	118,306,879円	54,480,642円
期首からの追加設定元本額	853,158円	3,363,413円
期首からの一部解約元本額	64,679,395円	30,600,239円

2. 受益権の総数	54,480,642口	27,243,816口
-----------	-------------	-------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19日	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19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 7月19日現在	2022年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

(有価証券に関する注記)

(2021年 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	660,398
合計	660,398

(2022年 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	341,900
合計	341,900

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当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 7月19日現在		2022年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	2,102円	1口当たり純資産額	2,285円
(1万口当たり純資産額)	(21,021円)	(1万口当たり純資産額)	(22,853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
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	14,930,166	61,642,176	
合計		14,930,166	61,642,176	

(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。

「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）」は、「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。

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 7月19日現在	2022年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,280,759,899	452,385,570
コール・ローン	3,017,323,964	2,730,080,206
株式	229,180,032,954	239,771,048,701
投資証券	5,507,243,160	6,090,965,329

派生商品評価勘定	52,479,352	144,422,675
未収入金	1,484,823	764,932
未収配当金	145,692,290	178,382,581
差入委託証拠金	593,309,159	441,773,392
流動資産合計	239,778,325,601	249,809,823,386
資産合計	239,778,325,601	249,809,823,386
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	18,819,890	38,318,184
未払解約金	17,954,359	6,971,538
未払利息	2,270	1,026
流動負債合計	36,776,519	45,290,748
負債合計	36,776,519	45,290,748
純資産の部		
元本等		
元本	63,462,796,864	60,494,412,485
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	176,278,752,218	189,270,120,153
元本等合計	239,741,549,082	249,764,532,638
純資産合計	239,741,549,082	249,764,532,638
負債純資産合計	239,778,325,601	249,809,823,386

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
1.	期首	2020年 7月18日	2021年 7月20日
	期首元本額	88,927,779,693円	63,462,796,864円
	期首からの追加設定元本額	4,959,704,340円	9,270,216,157円
	期首からの一部解約元本額	30,424,687,169円	12,238,600,536円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	23,953,446,187円	28,551,471,403円
	DCインデックスバランス（株式20）	113,679,085円	120,181,833円
	DCインデックスバランス（株式40）	296,611,572円	318,610,273円
	DCインデックスバランス（株式60）	585,577,778円	626,764,448円
	DCインデックスバランス（株式80）	627,986,873円	679,784,429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	1,521,002,234円	1,459,858,283円
	日興五大陸株式ファンド	4,122,332,976円	3,762,309,764円
	インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）	30,018,118円	14,930,166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）	105,528,201円	89,961,945円
	インデックスファンド先進国株式（適格機関投資家向け）	6,469,886,348円	5,954,670,878円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	18,703,327,505円	12,526,533,975円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	3,821,303円	3,492,987円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	2,963,353円	3,026,041円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	4,067,868円	3,783,811円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	3,517,920円	3,246,717円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	2,533,639,551円	1,955,861,635円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	20,797,394円	19,197,996円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	59,173,963円	53,519,130円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	89,225,692円	81,033,822円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	86,137,582円	79,602,959円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,130,055,361円	4,186,569,990円
	計	63,462,796,864円	60,494,412,485円
2.	受益権の総数	63,462,796,864口	60,494,412,485口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19日	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19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 7月19日現在	2022年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

(2021年 7月19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	44,828,940,557
投資証券	1,195,891,246
合計	46,024,831,803

(2022年 7月19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	44,922,611,201
投資証券	975,774,276
合計	45,898,385,477

(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 7月19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	5,178,564,664	-	5,231,044,016	52,479,352
	合計	5,178,564,664	-	5,231,044,016	52,479,352

(2022年 7月19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	3,916,577,963	-	3,925,186,859	8,608,896
	合計	3,916,577,963	-	3,925,186,859	8,608,896

(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 7月19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	3,353,771,580	-	3,334,951,690	18,819,890
	米ドル	2,655,612,050	-	2,647,334,760	8,277,290
	ユーロ	698,159,530	-	687,616,930	10,542,600
	合計	3,353,771,580	-	3,334,951,690	18,819,890

(2022年 7月19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	2,992,596,800	-	3,090,156,425	97,559,625
	米ドル	2,509,726,720	-	2,606,796,680	97,069,960
	ユーロ	482,870,080	-	483,359,745	489,665
	売建	13,946,000	-	14,010,030	64,030
	ユーロ	13,946,000	-	14,010,030	64,030
	合計	3,006,542,800	-	3,104,166,455	97,495,595

(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 7月19日現在		2022年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	3.7777円	1口当たり純資産額	4.1287円
(1万口当たり純資産額)	(37,777円)	(1万口当たり純資産額)	(41,287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	13,850	32.80	454,280.00	
	BAKER HUGHES CO	37,155	27.16	1,009,129.80	
	CHENIERE ENERGY INC	9,010	126.49	1,139,674.90	
	CHEVRON CORP	74,761	139.58	10,435,140.38	
	CONOCOPHILLIPS	50,006	85.07	4,254,010.42	
	COTERRA ENERGY INC	33,840	27.42	927,892.80	
	DEVON ENERGY CORPORATION	24,690	54.62	1,348,567.80	

DIAMONDBACK ENERGY INC	6,600	112.52	742,632.00
EOG RESOURCES INC	22,572	99.53	2,246,591.16
EQT CORP	12,460	37.86	471,735.60
EXXON MOBIL CORP	162,511	86.10	13,992,197.10
HALLIBURTON CO	33,827	28.85	975,908.95
HESS CORP	10,280	99.79	1,025,841.20
KINDER MORGAN INC	77,230	16.93	1,307,503.90
MARATHON OIL CORP	26,600	21.57	573,762.00
MARATHON PETROLEUM CORP	21,572	85.23	1,838,581.56
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	35,571	60.05	2,136,038.55
ONEOK INC	17,270	56.96	983,699.20
PHILLIPS 66	18,185	82.75	1,504,808.75
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,890	211.00	1,875,790.00
SCHLUMBERGER LTD	54,771	33.13	1,814,563.23
TARGA RESOURCES CORP	8,640	60.51	522,806.40
VALERO ENERGY CORP	15,632	106.31	1,661,837.92
WILLIAMS COS INC	47,104	31.91	1,503,088.64
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,505	223.56	1,901,377.80
ALBEMARLE CORP	4,260	203.88	868,528.80
ALCOA CORP	6,700	43.42	290,914.00
AMCOR PLC	59,510	12.33	733,758.30
AVERY DENNISON CORP	3,200	165.26	528,832.00
BALL CORP	11,780	67.04	789,731.20
CELANESE CORP	4,030	109.63	441,808.90
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,060	83.63	674,057.80
CLEVELAND-CLIFFS INC	19,100	15.53	296,623.00
CORTEVA INC	28,102	52.24	1,468,048.48
CROWN HOLDINGS INC	4,855	88.32	428,793.60
DOW INC	28,595	50.47	1,443,189.65
DUPONT DE NEMOURS INC	19,162	54.36	1,041,646.32
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,095	88.99	453,404.05
ECOLAB INC	9,990	151.71	1,515,582.90
FMC CORP	4,840	100.37	485,790.80
FREEMPORT-MCMORAN INC	56,018	27.42	1,536,013.56
INTERNATIONAL PAPER CO	13,840	41.42	573,252.80

INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,645	114.44	1,103,773.80
LINDE PLC	19,705	277.13	5,460,846.65
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,050	86.42	868,521.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,360	314.40	741,984.00
MOSAIC CO/THE	14,160	45.71	647,253.60
NEWMONT CORP	31,112	54.81	1,705,248.72
NUCOR CORP	10,389	114.47	1,189,228.83
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	134.29	480,758.20
PPG INDUSTRIES INC	8,774	114.91	1,008,220.34
RPM INTERNATIONAL INC	5,270	81.01	426,922.70
SEALED AIR CORP	5,746	55.83	320,799.18
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,521	243.25	2,315,983.25
STEEL DYNAMICS INC	7,510	67.71	508,502.10
VULCAN MATERIALS CO	4,923	148.40	730,573.20
WESTLAKE CORP	1,650	92.30	152,295.00
WESTROCK CO	9,989	39.05	390,070.45
3M CO	21,796	128.91	2,809,722.36
AERCAP HOLDINGS NV	4,850	41.06	199,141.00
ALLEGION PLC	3,340	95.65	319,471.00
AMETEK INC	9,113	109.10	994,228.30
BOEING CO/THE	21,142	147.72	3,123,096.24
CARRIER GLOBAL CORP	30,498	35.55	1,084,203.90
CATERPILLAR INC	20,606	173.49	3,574,934.94
CUMMINS INC	5,365	197.62	1,060,231.30
DEERE & CO	11,110	297.95	3,310,224.50
DOVER CORP	5,350	119.98	641,893.00
EATON CORP PLC	15,446	126.88	1,959,788.48
EMERSON ELECTRIC CO	23,010	79.36	1,826,073.60
FASTENAL CO	21,616	47.89	1,035,190.24
FORTIVE CORP	12,674	54.27	687,817.98
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,050	63.12	318,756.00
GENERAC HOLDINGS INC	2,440	223.70	545,828.00
GENERAL DYNAMICS CORP	9,012	209.79	1,890,627.48
GENERAL ELECTRIC CO	41,967	63.68	2,672,458.56
HEICO CORP	2,000	135.32	270,640.00

HEICO CORP-CLASS A	2,480	108.49	269,055.20
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	26,356	170.95	4,505,558.20
HOWMET AEROSPACE INC	14,603	33.00	481,899.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,530	201.83	308,799.90
IDEX CORP	2,830	182.76	517,210.80
ILLINOIS TOOL WORKS	12,185	180.29	2,196,833.65
INGERSOLL-RAND INC	15,268	41.22	629,346.96
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,370	52.15	436,495.50
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	26,334	46.69	1,229,534.46
KORNIT DIGITAL LTD	1,640	25.41	41,672.40
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,590	220.12	1,670,710.80
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,270	212.23	269,532.10
LOCKHEED MARTIN CORP	9,421	387.28	3,648,564.88
MASCO CORP	9,729	53.06	516,220.74
NORDSON CORP	2,010	207.01	416,090.10
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,664	449.26	2,544,608.64
OTIS WORLDWIDE CORP	16,564	68.96	1,142,253.44
OWENS CORNING	4,030	80.51	324,455.30
PACCAR INC	13,274	80.31	1,066,034.94
PARKER HANNIFIN CORP	4,895	247.76	1,212,785.20
PENTAIR PLC	6,838	45.92	314,000.96
PLUG POWER INC	20,280	16.42	332,997.60
QUANTA SERVICES INC	5,300	126.96	672,888.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	57,326	89.80	5,147,874.80
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,303	204.70	880,824.10
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,470	40.16	259,835.20
SMITH (A.O.) CORP	4,770	55.46	264,544.20
SNAP-ON INC	2,080	200.31	416,644.80
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,156	106.81	657,522.36
TEXTRON INC	7,956	60.13	478,394.28
TRANE TECHNOLOGIES PLC	8,996	126.47	1,137,724.12
TRANSDIGM GROUP INC	1,980	541.70	1,072,566.00
UNITED RENTALS INC	2,740	257.05	704,317.00
WABTEC CORP	7,030	82.57	580,467.10
WW GRAINGER INC	1,667	453.26	755,584.42

XYLEM INC	6,808	75.88	516,591.04
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,070	90.04	456,502.80
CINTAS CORP	3,667	378.93	1,389,536.31
CLARIVATE PLC	13,360	13.22	176,619.20
COPART INC	8,140	116.30	946,682.00
COSTAR GROUP INC	14,910	59.08	880,882.80
EQUIFAX INC	4,654	191.67	892,032.18
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,880	125.06	610,292.80
LEIDOS HOLDINGS INC	5,240	97.88	512,891.20
REPUBLIC SERVICES INC	8,130	126.75	1,030,477.50
ROBERT HALF INTL INC	4,055	78.15	316,898.25
ROLLINS INC	9,015	35.18	317,147.70
TRANSUNION	7,270	82.62	600,647.40
VERISK ANALYTICS INC	5,800	175.50	1,017,900.00
WASTE CONNECTIONS INC	9,566	122.80	1,174,704.80
WASTE MANAGEMENT INC	16,104	149.27	2,403,844.08
AMERCO	375	476.78	178,792.50
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,930	98.55	485,851.50
CSX CORP	84,689	28.83	2,441,583.87
DELTA AIR LINES INC	5,105	31.14	158,969.70
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,527	96.59	630,442.93
FEDEX CORP	9,583	217.98	2,088,902.34
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	38,100	2.73	104,013.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,280	168.10	551,368.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,180	48.38	298,988.40
LYFT INC-A	10,570	13.41	141,743.70
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,280	229.06	2,125,676.80
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,655	261.50	955,782.50
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	39.95	218,526.50
UBER TECHNOLOGIES INC	54,310	22.58	1,226,319.80
UNION PACIFIC CORP	24,491	210.22	5,148,498.02
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	28,137	180.08	5,066,910.96
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	2,920	47.76	139,459.20
APTIV PLC	10,610	90.82	963,600.20
BORGWARNER INC	9,890	34.16	337,842.40

FORD MOTOR COMPANY	150,375	11.96	1,798,485.00
GENERAL MOTORS CORP	53,255	32.62	1,737,178.10
LEAR CORP	2,140	129.56	277,258.40
LUCID GROUP INC	16,510	19.96	329,539.60
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	6,450	31.80	205,110.00
TESLA INC	33,685	721.64	24,308,443.40
DR HORTON INC	12,876	72.57	934,411.32
GARMIN LTD	5,865	99.77	585,151.05
HASBRO INC	4,668	79.42	370,732.56
LENNAR CORP-CL A	10,240	77.26	791,142.40
LULULEMON ATHLETICA INC	4,470	284.64	1,272,340.80
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,118	125.49	265,787.82
NEWELL BRANDS INC	14,466	19.43	281,074.38
NIKE INC -CL B	49,018	103.94	5,094,930.92
NVR INC	125	4,363.97	545,496.25
PELOTON INTERACTIVE INC-A	10,230	8.63	88,284.90
PULTE GROUP INC	10,010	43.46	435,034.60
VF CORP	13,010	45.56	592,735.60
WHIRLPOOL CORP	2,259	161.32	364,421.88
AIRBNB INC-CLASS A	12,100	97.67	1,181,807.00
ARAMARK	9,910	30.71	304,336.10
BOOKING HOLDINGS INC	1,558	1,738.79	2,709,034.82
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,970	38.60	307,642.00
CARNIVAL CORP	30,727	9.65	296,515.55
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,080	1,319.16	1,424,692.80
DARDEN RESTAURANTS INC	5,043	116.43	587,156.49
DOMINO'S PIZZA INC	1,375	406.81	559,363.75
EXPEDIA GROUP INC	5,922	94.29	558,385.38
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,800	117.42	1,268,136.00
LAS VEGAS SANDS CORP	12,900	34.65	446,985.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,633	144.59	1,537,425.47
MCDONALD'S CORP	28,531	252.42	7,201,795.02
MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,080	29.51	415,500.80
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,748	34.36	300,581.28
STARBUCKS CORP	43,874	80.23	3,520,011.02

VAIL RESORTS INC	1,520	218.03	331,405.60
WYNN RESORTS LTD	4,180	56.55	236,379.00
YUM! BRANDS INC	10,804	118.48	1,280,057.92
ACTIVISION BLIZZARD INC	29,820	76.99	2,295,841.80
ALPHABET INC-CL A	11,520	109.03	1,256,025.60
ALPHABET INC-CL A(N)	218,880	109.03	23,864,486.40
ALPHABET INC-CL C	10,880	109.91	1,195,820.80
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	19,410	16.54	321,041.40
CABLE ONE INC	240	1,351.68	324,403.20
CHARTER COMMUNICATION-A	4,556	474.01	2,159,589.56
COMCAST CORP-CLASS A	172,954	40.54	7,011,555.16
DISH NETWORK CORP-A	9,279	17.76	164,795.04
ELECTRONIC ARTS INC	10,884	123.62	1,345,480.08
FOX CORP - CLASS A	12,624	33.23	419,495.52
FOX CORP- CLASS B	5,466	30.73	167,970.18
IAC/INTERACTIVECORP	3,090	69.99	216,269.10
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,096	28.51	430,386.96
LIBERTY BROADBAND-C	5,630	118.21	665,522.30
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	3,325	36.75	122,193.75
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	7,896	36.68	289,625.28
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	7,680	60.24	462,643.20
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,420	86.08	552,633.60
MATCH GROUP INC	9,892	65.13	644,265.96
META PLATFORMS INC-CLASS A	88,450	167.23	14,791,493.50
NETFLIX INC	16,845	190.92	3,216,047.40
NEWS CORP - CLASS A	16,290	15.71	255,915.90
OMNICOM GROUP	7,807	65.49	511,280.43
PARAMOUNT GLOBAL	22,823	24.52	559,619.96
PINTEREST INC- CLASS A	20,950	20.25	424,237.50
ROBLOX CORP -CLASS A	12,670	39.75	503,632.50
ROKU INC	4,350	88.22	383,757.00
SEA LTD-ADR	13,870	69.25	960,497.50
SIRIUS XM HOLDINGS INC	30,280	6.35	192,278.00
SNAP INC - A	40,460	13.92	563,203.20
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	6,220	123.65	769,103.00

THE WALT DISNEY CO.	69,622	95.70	6,662,825.40
TWITTER INC	30,590	38.41	1,174,961.90
WARNER BROS DISCOVERY INC	86,760	13.88	1,204,228.80
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	10,760	36.24	389,942.40
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,268	185.27	420,192.36
AMAZON.COM INC	351,190	113.76	39,951,374.40
AUTOZONE INC	807	2,191.80	1,768,782.60
BATH & BODY WORKS INC	9,970	28.58	284,942.60
BEST BUY CO INC	8,354	73.34	612,682.36
BURLINGTON STORES INC	2,585	142.40	368,104.00
CARMAX INC	6,249	92.82	580,032.18
CHEWY INC - CLASS A	3,410	42.98	146,561.80
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	8,960	244.15	2,187,584.00
DOLLAR TREE INC	8,706	169.50	1,475,667.00
DOORDASH INC - A	6,960	72.44	504,182.40
EBAY INC	22,417	43.59	977,157.03
ETSY INC	4,780	84.72	404,961.60
GENUINE PARTS CO	5,321	138.13	734,989.73
HOME DEPOT INC	40,095	293.05	11,749,839.75
LKQ CORP	10,810	50.17	542,337.70
LOWE'S COS INC	25,792	185.79	4,791,895.68
MERCADOLIBRE INC	1,740	691.84	1,203,801.60
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,600	672.74	1,749,124.00
POOL CORP	1,540	372.71	573,973.40
ROSS STORES INC	13,162	79.12	1,041,377.44
TARGET CORP	18,300	149.36	2,733,288.00
TJX COMPANIES INC	45,556	60.49	2,755,682.44
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,230	203.49	860,762.70
ULTA BEAUTY INC	1,945	393.59	765,532.55
WAYFAIR INC- CLASS A	2,840	52.21	148,276.40
COSTCO WHOLESALE CORP	17,034	516.30	8,794,654.20
KROGER CO	26,620	47.53	1,265,248.60
SYSCO CORP	19,586	86.35	1,691,251.10
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	27,082	38.32	1,037,782.24
WALMART INC	58,462	128.77	7,528,151.74

ALTRIA GROUP INC	69,308	42.27	2,929,649.16
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	21,403	72.55	1,552,787.65
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,680	70.22	820,169.60
BUNGE LTD	5,157	87.71	452,320.47
CAMPBELL SOUP CO	7,885	48.18	379,899.30
COCA-COLA CO/THE	157,872	61.65	9,732,808.80
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	8,260	49.50	408,870.00
CONAGRA BRANDS INC	18,040	33.41	602,716.40
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,245	243.45	1,520,345.25
GENERAL MILLS INC	23,369	73.95	1,728,137.55
HERSHEY CO/THE	5,535	215.06	1,190,357.10
HORMEL FOODS CORP	11,500	47.37	544,755.00
JM SMUCKER CO/THE	4,100	130.57	535,337.00
KELLOGG CO	9,778	71.71	701,180.38
KEURIG DR PEPPER INC	32,060	36.16	1,159,289.60
KRAFT HEINZ CO/THE	28,081	38.43	1,079,152.83
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,250	80.95	748,787.50
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,200	58.11	418,392.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	53,065	60.06	3,187,083.90
MONSTER BEVERAGE CORP	15,130	95.02	1,437,652.60
PEPSICO INC	53,021	168.26	8,921,313.46
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	59,428	89.51	5,319,400.28
TYSON FOODS INC-CL A	11,216	81.88	918,366.08
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,090	93.98	854,278.20
CLOROX COMPANY	4,646	145.73	677,061.58
COLGATE-PALMOLIVE CO	30,580	77.12	2,358,329.60
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,070	245.77	2,229,133.90
KIMBERLY-CLARK CORP	12,763	132.07	1,685,609.41
PROCTER & GAMBLE CO	91,799	143.31	13,155,714.69
ABBOTT LABORATORIES	67,746	107.02	7,250,176.92
ABIOMED INC	1,770	263.04	465,580.80
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,840	254.08	721,587.20
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,774	140.40	810,669.60
BAXTER INTERNATIONAL INC	19,499	64.36	1,254,955.64
BECTON DICKINSON AND CO	10,877	234.31	2,548,589.87

BOSTON SCIENTIFIC CORP	55,178	37.17	2,050,966.26	
CARDINAL HEALTH INC	10,715	54.74	586,539.10	
CENTENE CORP	22,267	89.72	1,997,795.24	
CIGNA CORP	12,240	268.35	3,284,604.00	
COOPER COS INC/THE	1,840	294.14	541,217.60	
CVS HEALTH CORP	50,368	94.29	4,749,198.72	
DAVITA INC	2,108	84.96	179,095.68	
DENTSPLY SIRONA INC	8,222	34.78	285,961.16	
DEXCOM INC	14,640	76.99	1,127,133.60	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	23,750	97.45	2,314,437.50	
ELEVANCE HEALTH INC	9,281	480.80	4,462,304.80	
HCA HEALTHCARE INC	9,240	171.69	1,586,415.60	
HENRY SCHEIN INC	5,280	76.59	404,395.20	
HOLOGIC INC	9,208	68.47	630,471.76	
HUMANA INC	4,880	484.46	2,364,164.80	
IDEXX LABORATORIES INC	3,310	360.60	1,193,586.00	
INSULET CORP	2,585	225.37	582,581.45	
INTUITIVE SURGICAL INC	13,665	206.26	2,818,542.90	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,575	240.88	861,146.00	
MASIMO CORP	2,020	126.31	255,146.20	
MCKESSON CORP	5,819	326.03	1,897,168.57	
MEDTRONIC PLC	51,578	87.90	4,533,706.20	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,230	298.02	664,584.60	
NOVOCURE LTD	3,430	71.87	246,514.10	
QUEST DIAGNOSTICS	4,656	133.65	622,274.40	
RESMED INC	5,515	218.76	1,206,461.40	
STERIS PLC	3,710	207.93	771,420.30	
STRYKER CORP	12,973	189.27	2,455,399.71	
TELADOC HEALTH INC	6,610	39.50	261,095.00	
TELEFLEX INC	1,760	244.38	430,108.80	
UNITEDHEALTH GROUP INC	36,110	519.37	18,754,450.70	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,730	103.75	283,237.50	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	5,240	200.14	1,048,733.60	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,952	103.48	822,872.96	
ABBVIE INC	67,866	149.57	10,150,717.62	

AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,650	115.11	1,341,031.50
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,520	140.64	635,692.80
AMGEN INC	21,391	243.84	5,215,981.44
AVANTOR INC	23,770	28.10	667,937.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	860	475.79	409,179.40
BIO-TECHNE CORP	1,480	336.24	497,635.20
BIOGEN INC	5,543	214.34	1,188,086.62
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,140	85.50	610,470.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	83,555	73.74	6,161,345.70
CATALENT INC	6,520	99.93	651,543.60
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,910	212.60	406,066.00
DANAHER CORP	26,109	247.06	6,450,489.54
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	16,526	20.00	330,520.00
ELI LILLY & CO	31,064	321.77	9,995,463.28
EXACT SCIENCES CORP	6,510	45.31	294,968.10
GILEAD SCIENCES INC	47,864	60.90	2,914,917.60
HORIZON THERAPEUTICS PLC	7,990	82.30	657,577.00
ILLUMINA INC	6,075	187.29	1,137,786.75
INCYTE CORP	7,110	78.86	560,694.60
IQVIA HOLDINGS INC	7,408	212.87	1,576,940.96
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,230	155.71	347,233.30
JOHNSON & JOHNSON	100,791	174.23	17,560,815.93
MERCK & CO. INC.	96,953	92.34	8,952,640.02
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	860	1,122.80	965,608.00
MODERNA INC	12,955	163.40	2,116,847.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,630	93.90	340,857.00
PERKINELMER INC	4,920	132.37	651,260.40
PFIZER INC	215,690	50.75	10,946,267.50
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,055	586.70	2,379,068.50
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	13,010	43.71	568,667.10
SEAGEN INC	5,320	168.47	896,260.40
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43,590	7.06	307,745.40
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	15,019	520.76	7,821,294.44
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,805	286.06	2,804,818.30
VIATRIS INC	45,819	9.83	450,400.77

WATERS CORP	2,336	323.39	755,439.04
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,830	291.98	826,303.40
ZOETIS INC	18,215	171.76	3,128,608.40
BANK OF AMERICA CORP	279,019	32.26	9,001,152.94
CITIGROUP INC	75,637	50.07	3,787,144.59
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,740	37.17	733,735.80
FIFTH THIRD BANCORP	25,549	33.77	862,789.73
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	450	681.28	306,576.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,750	153.12	1,033,560.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	56,330	12.58	708,631.40
JPMORGAN CHASE & CO	113,330	111.79	12,669,160.70
KEYCORP	35,998	17.70	637,164.60
M & T BANK CORP	6,343	157.97	1,002,003.71
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	15,990	154.67	2,473,173.30
REGIONS FINANCIAL CORP	37,044	19.46	720,876.24
SIGNATURE BANK	2,390	196.12	468,726.80
SVB FINANCIAL GROUP	2,155	413.81	891,760.55
TRUIST FINANCIAL CORP	51,270	47.10	2,414,817.00
US BANCORP	54,181	46.68	2,529,169.08
WEBSTER FINANCIAL CORP	7,660	43.93	336,503.80
WELLS FARGO & CO	146,620	41.19	6,039,277.80
ALLY FINANCIAL INC	12,900	34.57	445,953.00
AMERICAN EXPRESS CO	24,614	142.33	3,503,310.62
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,265	230.18	981,717.70
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	16,980	51.30	871,074.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	30,662	42.77	1,311,413.74
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	49,475	276.26	13,667,963.50
BLACKROCK INC	5,860	597.53	3,501,525.80
BLACKSTONE INC	26,760	93.15	2,492,694.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	16,085	110.49	1,777,231.65
CARLYLE GROUP INC/THE	6,070	32.19	195,393.30
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,940	118.18	465,629.20
CME GROUP INC	13,790	200.44	2,764,067.60
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	4,270	58.67	250,520.90
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,860	105.26	1,143,123.60

EQUITABLE HOLDINGS INC	14,420	25.52	367,998.40
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,460	390.85	570,641.00
FRANKLIN RESOURCES INC	10,315	24.50	252,717.50
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	1,800	46.14	83,052.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	12,998	301.26	3,915,777.48
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	21,340	94.88	2,024,739.20
INVESCO LTD	13,527	16.19	219,002.13
KKR & CO INC -A	20,050	48.71	976,635.50
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,150	178.96	563,724.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,420	266.92	379,026.40
MOODY'S CORP	6,442	280.85	1,809,235.70
MORGAN STANLEY	51,363	78.86	4,050,486.18
MSCI INC	3,115	412.01	1,283,411.15
NASDAQ INC	4,485	154.78	694,188.30
NORTHERN TRUST CORP	7,340	97.82	717,998.80
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,010	89.58	627,955.80
S&P GLOBAL INC	13,615	345.36	4,702,076.40
SCHWAB (CHARLES) CORP	55,673	61.24	3,409,414.52
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,575	52.45	292,408.75
STATE STREET CORP	15,257	64.96	991,094.72
SYNCHRONY FINANCIAL	20,820	31.48	655,413.60
T ROWE PRICE GROUP INC	8,125	113.69	923,731.25
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,200	67.92	285,264.00
UPSTART HOLDINGS INC	3,190	26.10	83,259.00
AFLAC INC	23,484	54.17	1,272,128.28
ALLEGHANY CORP	500	834.34	417,170.00
ALLSTATE CORP	10,523	119.77	1,260,339.71
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,900	130.35	378,015.00
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	31,705	49.89	1,581,762.45
AON PLC	8,192	267.10	2,188,083.20
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,055	43.09	605,629.95
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,940	161.88	1,285,327.20
ASSURANT INC	2,170	164.27	356,465.90
BROWN & BROWN INC	9,090	58.76	534,128.40
CHUBB LTD	16,385	181.18	2,968,634.30

CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,900	108.96	642,864.00
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,055	189.77	200,207.35
EVEREST RE GROUP LTD	1,554	261.63	406,573.02
FNF GROUP	10,241	36.64	375,230.24
GLOBE LIFE INC	3,856	98.16	378,504.96
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,382	61.91	766,569.62
LINCOLN NATIONAL CORP	6,453	47.46	306,259.38
LOEWS CORP	7,105	56.24	399,585.20
MARKEL CORP	525	1,253.78	658,234.50
MARSH & MCLENNAN COS	19,193	148.35	2,847,281.55
METLIFE INC	27,305	59.10	1,613,725.50
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,930	62.53	620,922.90
PROGRESSIVE CORP	22,520	110.29	2,483,730.80
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,442	92.66	1,338,195.72
TRAVELERS COS INC/THE	9,144	154.99	1,417,228.56
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,538	191.64	869,662.32
WR BERKLEY CORP	8,091	62.21	503,341.11
CBRE GROUP INC - A	12,410	77.87	966,366.70
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	49,200	4.92	242,064.00
ZILLOW GROUP INC - C	6,370	34.20	217,854.00
ACCENTURE PLC-CL A	24,238	268.65	6,511,538.70
ADOBE INC	18,094	375.23	6,789,411.62
AFFIRM HOLDINGS INC	6,670	23.84	159,012.80
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,030	88.12	531,363.60
ALPHABET INC-CL C(N)	206,720	109.91	22,720,595.20
ANSYS INC	3,295	236.93	780,684.35
APPLOVIN CORP-CLASS A	3,960	34.33	135,946.80
AUTODESK INC	8,515	177.22	1,509,028.30
AUTOMATIC DATA PROCESSING	16,021	211.31	3,385,397.51
AVALARA INC	3,310	82.88	274,332.80
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,530	34.13	256,998.90
BILL.COM HOLDINGS INC	3,630	125.16	454,330.80
BLACK KNIGHT INC	5,860	62.45	365,957.00
BLOCK INC	20,030	66.27	1,327,388.10
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,400	147.07	647,108.00

CADENCE DESIGN SYS INC	10,710	155.06	1,660,692.60
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,280	49.34	260,515.20
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,050	121.15	490,657.50
CITRIX SYSTEMS INC	4,968	102.17	507,580.56
CLOUDFLARE INC-CLASS A	9,750	48.83	476,092.50
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	19,868	65.10	1,293,406.80
COUPA SOFTWARE INC	2,800	59.87	167,636.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	7,490	177.25	1,327,602.50
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,890	128.19	242,279.10
DATADOG INC-CLASS A	8,220	91.04	748,348.80
DOCUSIGN INC	7,340	62.06	455,520.40
DROPBOX INC-CLASS A	11,660	21.72	253,255.20
DYNATRACE INC	7,560	36.28	274,276.80
EPAM SYSTEMS INC	2,205	305.86	674,421.30
FAIR ISAAC CORP	1,055	425.40	448,797.00
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	23,268	94.16	2,190,914.88
FISERV INC	23,604	93.97	2,218,067.88
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,910	212.39	618,054.90
FORTINET INC	26,325	58.00	1,526,850.00
GARTNER INC	3,050	238.77	728,248.50
GLOBAL PAYMENTS INC	11,159	113.24	1,263,645.16
GODADDY INC-CLASS A	6,420	70.53	452,802.60
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,870	70.32	201,818.40
HUBSPOT INC	1,725	274.79	474,012.75
INTL BUSINESS MACHINES CORP	34,482	138.13	4,762,998.66
INTUIT INC	10,251	388.25	3,979,950.75
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,840	190.93	542,241.20
MASTERCARD INC	33,470	331.01	11,078,904.70
MICROSOFT CORP	272,984	254.25	69,406,182.00
MONGODB INC	2,520	281.17	708,548.40
NORTONLIFELOCK INC	22,205	23.78	528,034.90
OKTA INC	5,670	95.46	541,258.20
ORACLE CORP	61,033	70.21	4,285,126.93
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	61,210	9.03	552,726.30
PALO ALTO NETWORKS INC	3,740	505.84	1,891,841.60

PAYCHEX INC	12,502	114.59	1,432,604.18
PAYCOM SOFTWARE INC	1,930	299.78	578,575.40
PAYPAL HOLDINGS INC	42,487	74.13	3,149,561.31
PTC INC	4,450	102.41	455,724.50
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,990	49.57	148,214.30
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,065	391.84	1,592,829.60
SALESFORCE INC	37,776	167.89	6,342,212.64
SERVICENOW INC	7,690	426.74	3,281,630.60
SNOWFLAKE INC-CLASS A	8,740	146.47	1,280,147.80
SPLUNK INC	6,120	96.06	587,887.20
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	58.55	495,918.50
SYNOPSYS INC	5,837	310.43	1,811,979.91
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	16,510	43.62	720,166.20
TWILIO INC - A	7,425	85.31	633,426.75
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,570	340.18	534,082.60
UNITY SOFTWARE INC	6,770	35.28	238,845.60
VERISIGN INC	3,690	175.63	648,074.70
VISA INC-CLASS A SHARES	63,572	207.21	13,172,754.12
VMWARE INC-CLASS A	7,697	110.90	853,597.30
WESTERN UNION CO	14,561	16.36	238,217.96
WIX.COM LTD	2,280	61.66	140,584.80
WORKDAY INC-CLASS A	7,550	138.74	1,047,487.00
ZENDESK INC	4,780	74.54	356,301.20
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	9,290	98.92	918,966.80
ZSCALER INC	3,120	150.82	470,558.40
AMPHENOL CORP-CL A	23,480	65.22	1,531,365.60
APPLE INC	625,664	147.07	92,016,404.48
ARISTA NETWORKS INC	8,720	100.58	877,057.60
ARROW ELECTRONICS INC	2,750	112.94	310,585.00
CDW CORP/DE	5,150	159.67	822,300.50
CISCO SYSTEMS INC	159,740	42.60	6,804,924.00
COGNEX CORP	6,480	44.93	291,146.40
CORNING INC	29,878	32.77	979,102.06
DELL TECHNOLOGIES -C	10,172	42.90	436,378.80
F5 INC	2,385	147.28	351,262.80

HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	48,285	13.16	635,430.60
HP INC	40,565	31.50	1,277,797.50
JUNIPER NETWORKS INC	12,663	28.17	356,716.71
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,950	141.23	981,548.50
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,505	211.89	1,378,344.45
NETAPP INC	8,686	65.57	569,541.02
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	8,274	77.51	641,317.74
TE CONNECTIVITY LTD	12,695	115.07	1,460,813.65
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,750	382.04	668,570.00
TRIMBLE INC	9,520	58.30	555,016.00
WESTERN DIGITAL CORP	11,818	46.90	554,264.20
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,025	295.84	599,076.00
AT&T INC	271,857	20.53	5,581,224.21
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,395	21.07	155,812.65
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	11,131	22.09	245,883.79
LUMEN TECHNOLOGIES INC	34,386	10.78	370,681.08
T-MOBILE US INC	23,949	134.47	3,220,422.03
VERIZON COMMUNICATIONS INC	160,707	50.28	8,080,347.96
AES CORP	25,138	20.28	509,798.64
ALLIANT ENERGY CORP	8,260	56.81	469,250.60
AMEREN CORPORATION	9,572	86.42	827,212.24
AMERICAN ELECTRIC POWER	19,618	93.37	1,831,732.66
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,705	145.07	972,694.35
ATMOS ENERGY CORP	4,880	111.90	546,072.00
CENTERPOINT ENERGY INC	22,262	29.56	658,064.72
CMS ENERGY CORP	11,100	64.81	719,391.00
CONSOLIDATED EDISON INC	12,896	91.63	1,181,660.48
CONSTELLATION ENERGY	12,568	54.81	688,852.08
DOMINION ENERGY INC	31,291	78.01	2,441,010.91
DTE ENERGY COMPANY	7,188	123.67	888,939.96
DUKE ENERGY CORP	29,356	105.43	3,095,003.08
EDISON INTERNATIONAL	14,439	60.98	880,490.22
ENERGY CORP	7,507	109.27	820,289.89
ESSENTIAL UTILITIES INC	9,190	46.89	430,919.10
EVERGY INC	8,720	64.43	561,829.60

EVERSOURCE ENERGY	13,070	82.45	1,077,621.50
EXELON CORP	38,206	43.76	1,671,894.56
FIRSTENERGY CORP	21,265	37.39	795,098.35
NEXTERA ENERGY INC	75,530	77.51	5,854,330.30
NISOURCE INC	16,520	28.39	469,002.80
NRG ENERGY INC	9,580	35.59	340,952.20
P G & E CORP	57,890	10.35	599,161.50
PPL CORP	31,208	27.19	848,545.52
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	19,908	60.06	1,195,674.48
SEMPRA ENERGY	12,317	149.36	1,839,667.12
SOUTHERN CO	40,475	71.69	2,901,652.75
UGI CORP	7,720	40.36	311,579.20
VISTRA CORP	16,750	22.82	382,235.00
WEC ENERGY GROUP INC	12,040	98.81	1,189,672.40
XCEL ENERGY INC	21,274	68.55	1,458,332.70
ADVANCED MICRO DEVICES	62,824	81.43	5,115,758.32
ANALOG DEVICES INC	19,967	155.25	3,099,876.75
APPLIED MATERIALS INC	33,703	93.14	3,139,097.42
BROADCOM INC	15,715	491.06	7,717,007.90
ENPHASE ENERGY INC	5,190	206.43	1,071,371.70
ENTEGRIS INC	5,050	95.18	480,659.00
INTEL CORP	156,122	38.71	6,043,482.62
KLA CORP	5,749	329.49	1,894,238.01
LAM RESEARCH CORP	5,382	423.16	2,277,447.12
MARVELL TECHNOLOGY INC	32,664	48.62	1,588,123.68
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	21,248	61.75	1,312,064.00
MICRON TECHNOLOGY INC	42,787	60.45	2,586,474.15
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,705	409.04	697,413.20
NVIDIA CORP	95,920	161.01	15,444,079.20
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,037	161.92	1,625,191.04
ON SEMICONDUCTOR CORP	16,640	54.95	914,368.00
QORVO INC	4,150	97.90	406,285.00
QUALCOMM INC	43,252	141.69	6,128,375.88
SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,210	99.96	620,751.60
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	2,005	280.68	562,763.40

	TERADYNE INC	6,190	93.29	577,465.10	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	35,402	159.67	5,652,637.34	
米ドル小計		13,033,467		1,274,669,749.59	(176,223,092,880)
加ドル	ARC RESOURCES LTD	24,800	15.65	388,120.00	
	CAMECO CORP	14,032	29.38	412,260.16	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	45,404	63.33	2,875,435.32	
	CENOVUS ENERGY INC	49,873	21.84	1,089,226.32	
	ENBRIDGE INC	77,937	55.12	4,295,887.44	
	IMPERIAL OIL LTD	9,622	55.22	531,326.84	
	KEYERA CORP	8,460	30.93	261,667.80	
	PARKLAND CORP	6,170	33.76	208,299.20	
	PEMBINA PIPELINE CORP	21,272	46.72	993,827.84	
	SUNCOR ENERGY INC	55,669	39.74	2,212,286.06	
	TC ENERGY CORP	37,383	67.67	2,529,707.61	
	TOURMALINE OIL CORP	11,250	68.56	771,300.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	17,586	55.43	974,791.98	
	BARRICK GOLD CORP	66,724	20.55	1,371,178.20	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	60.81	349,657.50	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	21.55	488,107.50	
	FRANCO-NEVADA CORP	7,335	163.65	1,200,372.75	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	24,510	6.94	170,099.40	
	KINROSS GOLD CORP	46,025	4.15	191,003.75	
	LUNDIN MINING CORP	25,010	7.65	191,326.50	
	NUTRIEN LTD	21,298	97.22	2,070,591.56	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	7,660	23.95	183,457.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,975	35.33	635,056.75	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,450	107.94	264,453.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	17,985	43.94	790,260.90	
	CAE INC	12,305	32.75	402,988.75	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,260	100.46	327,499.60	
	WSP GLOBAL INC	4,590	142.86	655,727.40	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,410	32.70	242,307.00	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,040	87.25	352,490.00	
	THOMSON REUTERS CORP	6,546	136.17	891,368.82	

AIR CANADA	7,190	16.95	121,870.50
CANADIAN NATL RAILWAY CO	22,898	145.91	3,341,047.18
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	35,791	92.66	3,316,394.06
TFI INTERNATIONAL INC	3,210	110.31	354,095.10
MAGNA INTERNATIONAL INC	11,178	73.57	822,365.46
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,930	35.18	278,977.40
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	11,578	67.02	775,957.56
QUEBECOR INC -CL B	6,110	27.94	170,713.40
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	17,465	34.59	604,114.35
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,260	167.92	379,499.20
DOLLARAMA INC	11,190	76.77	859,056.30
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-A	32,620	51.44	1,677,972.80
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	39.32	273,274.00
LOBLAW COMPANIES LTD	5,509	118.43	652,430.87
METRO INC	9,920	69.99	694,300.80
WESTON (GEORGE) LTD	3,038	153.42	466,089.96
SAPUTO INC	9,620	29.72	285,906.40
BAUSCH HEALTH COS INC	11,634	11.20	130,300.80
BANK OF MONTREAL	24,941	121.25	3,024,096.25
BANK OF NOVA SCOTIA	46,669	73.34	3,422,704.46
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	35,590	60.40	2,149,636.00
NATIONAL BANK OF CANADA	13,200	85.13	1,123,716.00
ROYAL BANK OF CANADA	54,259	120.80	6,554,487.20
TORONTO-DOMINION BANK	70,050	79.66	5,580,183.00
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	54,339	58.32	3,169,050.48
IGM FINANCIAL INC	3,335	35.11	117,091.85
ONEX CORPORATION	2,765	64.69	178,867.85
TMX GROUP LTD	2,170	127.23	276,089.10
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	679.13	611,217.00
GREAT-WEST LIFECO INC	8,904	30.41	270,770.64
IA FINANCIAL CORP INC	3,895	62.75	244,411.25
INTACT FINANCIAL CORP	6,745	180.57	1,217,944.65
MANULIFE FINANCIAL CORP	73,821	22.38	1,652,113.98
POWER CORP OF CANADA	20,479	33.40	683,998.60
SUN LIFE FINANCIAL INC	21,544	56.29	1,212,711.76

	FIRSTSERVICE CORP	1,500	164.88	247,320.00	
	BLACKBERRY LTD	22,208	7.46	165,671.68	
	CGI INC	8,530	107.60	917,828.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	740	1,908.72	1,412,452.80	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	4,390	24.19	106,194.10	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,250	41.40	93,150.00	
	OPEN TEXT CORP	10,940	50.39	551,266.60	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	46,200	42.24	1,951,488.00	
	BCE INC	3,000	63.31	189,930.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	13,875	60.15	834,581.25	
	TELUS CORP	12,662	28.54	361,373.48	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	17.30	468,484.00	
	ALTAGAS LTD	11,170	27.97	312,424.90	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	47.68	259,617.60	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	39.94	182,126.40	
	EMERA INC	10,460	60.54	633,248.40	
	FORTIS INC	17,195	60.48	1,039,953.60	
	HYDRO ONE LTD	13,230	34.89	461,594.70	
	NORTHLAND POWER INC	8,600	40.27	346,322.00	
	加ドル小計	1,566,713		85,550,566.67 (9,108,568,833)	
ユーロ	ENI SPA	94,656	11.01	1,042,541.18	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	18,705	9.90	185,291.73	
	NESTE OYJ	15,550	44.98	699,439.00	
	OMV AG	5,480	41.34	226,543.20	
	REPSOL SA	57,559	12.06	694,161.54	
	TENARIS SA	15,625	12.68	198,203.12	
	TOTALENERGIES SE	95,367	48.64	4,639,127.71	
	AIR LIQUIDE SA	19,959	127.00	2,534,793.00	
	AKZO NOBEL	6,937	64.24	445,632.88	
	ARCELORMITTAL	22,612	21.92	495,768.10	
	ARKEMA	2,215	87.10	192,926.50	
	BASF SE	34,455	42.72	1,471,917.60	
	COVESTRO AG	7,410	32.88	243,640.80	
	CRH PLC	29,210	34.45	1,006,284.50	

EVONIK INDUSTRIES AG	9,940	20.10	199,794.00
HEIDELBERGCEMENT AG	5,715	47.77	273,005.55
KONINKLIJKE DSM NV	6,392	144.80	925,561.60
OCI NV	3,520	29.94	105,388.80
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,890	32.69	323,304.10
SOLVAY SA	2,811	81.10	227,972.10
STORA ENSO OYJ-R SHS	21,835	15.71	343,137.02
SYMRISE AG	4,910	105.70	518,987.00
UMICORE	7,960	33.37	265,625.20
UPM-KYMMENE OYJ	19,568	29.83	583,713.44
VOESTALPINE AG	4,249	20.40	86,679.60
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,386	21.77	182,563.22
AIRBUS GROUP SE	22,418	104.34	2,339,094.12
ALSTOM	11,635	24.79	288,431.65
BOUYGUES SA	9,460	28.41	268,758.60
BRENTAG SE	6,075	62.86	381,874.50
CNH INDUSTRIAL NV	41,610	11.20	466,032.00
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	19,146	42.36	811,024.56
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	17,696	24.79	438,683.84
DASSAULT AVIATION SA	900	142.80	128,520.00
EIFFAGE	3,250	88.10	286,325.00
FERROVIAL SA	18,485	26.04	481,349.40
GEA GROUP AG	6,020	33.54	201,910.80
IMCD NV	2,090	139.15	290,823.50
KINGSPAN GROUP PLC	5,900	55.10	325,090.00
KION GROUP AG	2,874	42.27	121,483.98
KNORR-BREMSE AG	2,970	56.58	168,042.60
KONE OYJ-B	13,114	45.81	600,752.34
LEGRAND SA	10,178	74.02	753,375.56
MTU AERO ENGINES AG	2,020	185.75	375,215.00
PRYSMIAN SPA	9,565	26.59	254,333.35
RATIONAL AG	230	659.50	151,685.00
RHEINMETALL AG	1,730	189.40	327,662.00
SAFRAN SA	13,110	104.28	1,367,110.80
SCHNEIDER ELECTRIC SE	20,648	118.62	2,449,265.76

SIEMENS AG-REG	29,496	101.20	2,984,995.20
SIEMENS ENERGY AG	15,843	14.53	230,278.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	10,210	17.97	183,524.75
THALES SA	4,245	122.90	521,710.50
VINCI SA	20,900	87.83	1,835,647.00
WARTSILA OYJ ABP	18,180	7.81	141,985.80
BUREAU VERITAS SA	10,920	25.54	278,896.80
RANDSTAD NV	4,965	49.43	245,419.95
TELEPERFORMANCE	2,235	321.50	718,552.50
WOLTERS KLUWER	9,987	99.78	996,502.86
ADP	1,090	125.85	137,176.50
AENA SA	2,870	122.80	352,436.00
ATLANTIA SPA	18,740	22.36	419,026.40
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	6.14	146,814.24
DEUTSCHE POST AG-REG	37,463	36.68	1,374,330.15
GETLINK	19,210	19.41	372,866.10
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	12,385	76.00	941,260.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,740	70.50	193,170.00
CONTINENTAL AG	4,385	68.24	299,232.40
FERRARI NV	4,474	195.45	874,443.30
MERCEDES-BENZ GROUP AG	31,422	53.97	1,695,845.34
MICHELIN (CGDE)	24,556	27.43	673,693.86
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	69.08	391,683.60
RENAULT SA	6,837	24.79	169,523.41
STELLANTIS NV	85,606	12.25	1,049,015.92
VALEO SA	7,420	18.95	140,646.10
VOLKSWAGEN AG	1,151	187.20	215,467.20
VOLKSWAGEN AG-PFD	7,123	135.96	968,443.08
ADIDAS AG	6,781	165.18	1,120,085.58
ESSILORLUXOTTICA	11,025	149.45	1,647,686.25
HERMES INTERNATIONAL	1,202	1,139.50	1,369,679.00
KERING	2,877	510.80	1,469,571.60
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	10,669	614.30	6,553,966.70
MONCLER SPA	8,080	40.88	330,310.40
PUMA SE	4,200	65.24	274,008.00

SEB SA	987	91.35	90,162.45
ACCOR SA	5,916	27.51	162,749.16
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,356	92.40	587,294.40
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	32.49	126,711.00
SODEXO	3,570	74.34	265,393.80
BOLLORE SE	33,530	4.69	157,389.82
PUBLICIS GROUPE	8,645	44.50	384,702.50
SCOUT24 SE	2,970	53.50	158,895.00
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,510	40.81	143,243.10
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	27,730	21.13	586,073.55
VIVENDI SE	26,070	9.77	254,703.90
D' IETEREN GROUP	830	151.40	125,662.00
DELIVERY HERO SE	6,600	39.06	257,796.00
INDITEX	40,125	24.38	978,247.50
JUST EAT TAKEAWAY	6,460	14.60	94,316.00
PROSUS	32,300	65.82	2,125,986.00
ZALANDO SE	8,260	27.02	223,185.20
CARREFOUR SA	27,903	16.83	469,747.00
HELLOFRESH SE	6,070	32.47	197,092.90
JERONIMO MARTINS	9,035	21.30	192,445.50
KESKO OYJ-B SHS	10,930	23.92	261,445.60
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	38,478	26.06	1,002,929.07
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	32,791	54.44	1,785,142.04
DANONE	24,684	53.52	1,321,087.68
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,850	10.17	201,973.75
HEINEKEN HOLDING NV	4,025	73.80	297,045.00
HEINEKEN NV	9,673	93.02	899,782.46
JDE PEET'S NV	4,010	27.52	110,355.20
KERRY GROUP PLC-A	6,180	96.10	593,898.00
PERNOD-RICARD SA	7,926	180.75	1,432,624.50
REMY COINTREAU	810	179.70	145,557.00
BEIERSDORF AG	3,805	98.80	375,934.00
HENKEL AG & CO KGAA	4,030	60.90	245,427.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,413	61.20	392,475.60
L'OREAL	9,286	342.20	3,177,669.20

AMPLIFON SPA	4,830	29.80	143,934.00
BIOMERIEUX	1,690	103.45	174,830.50
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	130.40	209,944.00
DIASORIN ITALIA SPA	930	132.20	122,946.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,613	45.01	342,661.13
FRESENIUS SE & CO KGAA	15,695	27.19	426,747.05
KONINKLIJKE PHILIPS NV	34,620	20.71	717,153.30
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,020	370.90	378,318.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,640	47.86	509,230.40
ARGENX SE	1,755	364.20	639,171.00
BAYER AG-REG	37,534	55.43	2,080,509.62
EUROFINS SCIENTIFIC	5,050	78.42	396,021.00
GRIFOLS SA	12,050	16.19	195,149.75
IPSEN	1,350	92.15	124,402.50
MERCK KGAA	4,950	165.35	818,482.50
ORION OYJ-CLASS B	4,010	45.83	183,778.30
QIAGEN N.V.	8,944	45.64	408,204.16
RECORDATI SPA	3,920	43.15	169,148.00
SANOFI	43,766	99.85	4,370,035.10
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	327.40	353,592.00
UCB SA	4,928	84.74	417,598.72
ABN AMRO BANK NV-CVA	15,170	9.58	145,419.62
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	260,223	4.10	1,066,914.30
BANCO SANTANDER SA	675,749	2.41	1,629,906.58
BNP PARIBAS	42,532	42.45	1,805,483.40
CAIXABANK S.A	163,050	2.72	444,800.40
COMMERZBANK AG	38,844	6.17	239,900.54
CREDIT AGRICOLE SA	40,742	8.44	344,188.41
ERSTE GROUP BANK AG	11,458	24.22	277,512.76
FINECOBANK SPA	23,540	11.37	267,649.80
ING GROEP NV-CVA	152,015	8.85	1,345,788.79
INTESA SANPAOLO	630,593	1.67	1,055,612.68
KBC GROEP NV	9,719	49.21	478,271.99
MEDIOBANCA SPA	20,880	7.97	166,455.36
SOCIETE GENERALE	31,389	20.17	633,116.13

UNICREDIT SPA	83,276	8.71	725,916.89
AMUNDI SA	2,140	51.15	109,461.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	79,235	8.07	639,505.68
DEUTSCHE BOERSE AG	7,190	161.00	1,157,590.00
EURAZEO SE	1,487	63.65	94,647.55
EURONEXT NV	4,080	75.70	308,856.00
EXOR NV	4,164	62.96	262,165.44
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,062	81.50	331,053.00
SOFINA	655	206.40	135,192.00
WENDEL	1,000	85.10	85,100.00
AEGON NV	69,679	4.05	282,757.38
AGEAS	6,794	41.47	281,747.18
ALLIANZ SE-REG	15,748	173.68	2,735,112.64
ASSICURAZIONI GENERALI	42,248	14.54	614,497.16
AXA SA	74,692	21.11	1,577,121.58
HANNOVER RUECK SE-REG	2,275	138.80	315,770.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,176	220.70	1,142,343.20
NN GROUP NV	10,990	43.51	478,174.90
POSTE ITALIANE SPA	19,560	8.31	162,582.72
SAMPO OYJ-A SHS	18,999	40.34	766,419.66
AROUNDTOWN SA	35,980	2.99	107,616.18
LEG IMMOBILIEN SE	2,470	79.60	196,612.00
VONOVIA SE	27,119	28.65	776,959.35
ADYEN NV	890	1,550.00	1,379,500.00
AMADEUS IT GROUP SA	17,090	55.06	940,975.40
BECHTLE AG	3,070	36.68	112,607.60
CAP GEMINI SA	6,109	165.40	1,010,428.60
DASSAULT SYSTEMES SE	24,650	38.40	946,683.25
EDENRED	9,626	46.11	443,854.86
NEMETSCHEK SE	2,350	56.98	133,903.00
NEXI SPA	21,240	8.05	171,024.48
SAP SE	40,082	87.72	3,515,993.04
WORLDLINE SA	8,950	36.25	324,437.50
NOKIA OYJ	203,856	4.54	926,015.88
CELLNEX TELECOM SA	19,720	40.82	804,970.40

DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	124,766	18.94	2,363,068.04	
ELISA OYJ	5,465	53.18	290,628.70	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	9.99	151,578.64	
KONINKLIJKE KPN NV	131,606	3.40	448,644.85	
ORANGE S.A.	76,994	10.50	808,437.00	
PROXIMUS	5,600	13.86	77,616.00	
TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.22	90,515.93	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	32,470	2.82	91,695.28	
TELEFONICA SA	195,629	4.61	902,436.57	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,000	26.52	106,080.00	
ACCIONA SA	1,080	183.10	197,748.00	
E.ON SE	82,679	8.05	665,565.95	
EDF	19,505	10.22	199,438.62	
EDP RENOVAVEIS SA	11,010	24.34	267,983.40	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	105,831	4.64	491,373.33	
ELIA GROUP SA/NV	1,026	147.60	151,437.60	
ENAGAS SA	10,860	18.84	204,602.40	
ENDESA SA	12,050	17.80	214,550.25	
ENEL SPA	314,737	4.90	1,545,043.93	
ENGIE	70,164	11.19	785,696.47	
FORTUM OYJ	16,755	11.71	196,201.05	
IBERDROLA SA	223,492	9.78	2,187,539.69	
NATURGY ENERGY GROUP SA	6,252	28.41	177,619.32	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	17,000	18.07	307,275.00	
RWE AG	24,345	37.11	903,442.95	
SNAM SPA	72,420	4.89	354,133.80	
TERNA SPA	53,627	7.23	387,937.71	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,600	23.43	576,378.00	
VERBUND AG	2,780	104.50	290,510.00	
ASM INTERNATIONAL NV	1,865	232.70	433,985.50	
ASML HOLDING NV	15,592	476.20	7,424,910.40	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	50,255	23.67	1,189,535.85	
STMICROELECTRONICS NV	26,093	32.64	851,675.52	
ユーロ小計	7,041,307		154,947,643.28	(21,708,164,823)

英bond	HALEON PLC	194,651	3.08	600,206.35
	BP PLC	749,268	3.82	2,864,826.19
	SHELL PLC-NEW	292,017	20.37	5,948,386.29
	ANGLO AMERICAN PLC	48,914	26.37	1,290,106.75
	ANTOFAGASTA PLC	14,330	10.37	148,602.10
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,031	68.34	343,818.54
	GLENCORE PLC	374,873	4.19	1,573,716.85
	JOHNSON MATTHEY PLC	8,559	20.87	178,626.33
	MONDI PLC	18,370	14.68	269,671.60
	RIO TINTO PLC	43,355	47.11	2,042,454.05
	ASHTED GROUP PLC	17,230	39.04	672,659.20
	BAE SYSTEMS PLC ORD	121,015	8.10	980,221.50
	BUNZL PLC	12,896	29.02	374,241.92
	DCC PLC	3,820	52.06	198,869.20
	FERGUSON PLC	8,202	95.26	781,322.52
	MELROSE INDUSTRIES PLC	162,972	1.63	266,214.76
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	321,031	0.92	295,958.47
	SMITHS GROUP PLC	15,443	14.65	226,239.95
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,890	107.85	311,686.50
	EXPERIAN PLC	35,738	27.68	989,227.84
	INTERTEK GROUP PLC	6,025	43.75	263,593.75
	RELX PLC	73,985	22.96	1,698,695.60
	RENTOKIL INITIAL PLC	73,630	5.13	377,721.90
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	4.81	196,229.68
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,515	39.99	180,554.85
	BURBERRY GROUP PLC	15,504	16.43	254,808.24
	PERSIMMON PLC	12,440	17.76	220,934.40
	TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.19	147,977.32
	COMPASS GROUP PLC	68,988	18.26	1,260,065.82
	ENTAIN PLC	21,400	11.19	239,573.00
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,203	46.95	338,180.85
	WHITBREAD PLC	8,260	26.55	219,303.00
AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	5.88	214,502.40	
INFORMA PLC	56,580	5.37	303,834.60	
PEARSON PLC	32,329	7.70	248,933.30	

WPP PLC	44,814	8.11	363,441.54
JD SPORTS FASHION PLC	97,350	1.32	128,502.00
KINGFISHER PLC	78,137	2.55	199,483.76
NEXT PLC	5,097	64.02	326,309.94
OCADO GROUP PLC	22,670	7.79	176,780.66
SAINSBURY (J) PLC	70,601	2.15	152,145.15
TESCO PLC	293,318	2.60	762,626.80
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,125	16.18	212,428.12
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	83,147	34.84	2,897,257.21
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	19.22	147,801.80
DIAGEO PLC	88,612	36.56	3,239,654.72
IMPERIAL BRANDS PLC	34,492	18.60	641,551.20
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	27,415	63.58	1,743,045.70
UNILEVER PLC	97,842	38.65	3,781,593.30
NMC HEALTH PLC	8,090	-	-
SMITH & NEPHEW PLC	31,596	11.58	366,039.66
ASTRAZENECA PLC	59,402	110.96	6,591,245.92
GSK PLC	194,651	13.89	2,705,259.59
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,690	16.78	129,038.20
BARCLAYS PLC	633,451	1.54	976,908.13
HSBC HOLDINGS PLC	777,201	5.19	4,039,890.79
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,799,136	0.42	1,197,470.38
NATWEST GROUP PLC	207,830	2.21	459,304.30
STANDARD CHARTERED PLC	99,570	5.66	563,566.20
3I GROUP PLC	36,819	11.90	438,330.19
ABRDN PLC	88,515	1.55	137,375.28
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	8.30	108,170.16
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	12,467	76.50	953,725.50
M&G PLC	99,522	2.05	204,020.10
SCHRODERS PLC	4,131	27.34	112,941.54
ST JAMES'S PLACE PLC	20,540	11.50	236,210.00
ADMIRAL GROUP PLC	6,795	17.38	118,097.10
AVIVA PLC	109,854	3.90	429,309.43
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	228,301	2.48	568,241.18
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	24,810	5.96	147,867.60

	PRUDENTIAL PLC	105,872	10.10	1,069,836.56	
	AVEVA GROUP PLC	4,515	22.95	103,619.25	
	SAGE GROUP PLC/THE	38,840	6.79	263,956.64	
	HALMA PLC	14,690	21.04	309,077.60	
	BT GROUP PLC	302,152	1.78	540,247.77	
	VODAFONE GROUP PLC	1,043,328	1.30	1,357,578.39	
	NATIONAL GRID PLC	137,568	11.06	1,522,189.92	
	SEVERN TRENT PLC	9,023	28.20	254,448.60	
	SSE PLC	39,837	17.95	715,074.15	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	10.41	271,883.57	
英債券小計		11,182,385		68,185,511.22	(11,249,927,496)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	9,640	17.29	166,675.60	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	730.50	197,235.00	
	GIVAUDAN-REG	353	3,295.00	1,163,135.00	
	HOLCIM LTD	21,589	41.24	890,330.36	
	SIKA AG-REG	5,505	225.70	1,242,478.50	
	ABB LTD-REG	62,865	26.73	1,680,381.45	
	GEBERIT AG-REG	1,380	481.60	664,608.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,070	181.20	193,884.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	184.30	272,764.00	
	VAT GROUP AG	1,135	237.20	269,222.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,637	33.22	220,481.14	
	SGS SA-REG	258	2,245.00	579,210.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,990	237.90	473,421.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	19,929	101.95	2,031,761.55	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,270	231.80	294,386.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,850	43.14	79,809.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	125	2,074.00	259,250.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	40	9,670.00	386,800.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	99,900.00	399,600.00	
	NESTLE SA-REG	107,940	114.94	12,406,623.60	
	ALCON INC	19,484	69.32	1,350,630.88	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,051	330.60	678,060.60	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,050	122.70	496,935.00	

	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,400	58.30	81,620.00	
	LONZA GROUP AG-REG	2,873	562.60	1,616,349.80	
	NOVARTIS AG-REG	84,193	82.11	6,913,087.23	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,020	394.40	402,288.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	26,983	329.00	8,877,407.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	99,708	5.34	533,038.96	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,420	44.29	372,921.80	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	880	878.40	772,992.00	
	UBS GROUP AG-REG	135,412	15.72	2,129,353.70	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,940	154.50	299,730.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,270	479.50	608,965.00	
	SWISS RE AG	11,379	72.44	824,294.76	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,751	413.40	2,377,463.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,081	86.75	267,276.75	
	TEMENOS AG	2,640	77.94	205,761.60	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	53.18	354,178.80	
	SWISSCOM AG-REG	1,029	528.80	544,135.20	
	スイスフラン小計	665,554		53,578,546.68	(7,572,256,002)
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	10,090	321.20	3,240,908.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	4,160	426.40	1,773,824.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	22,680	152.50	3,458,700.00	
	ALFA LAVAL AB	12,200	263.40	3,213,480.00	
	ASSA ABLOY AB-B	38,560	227.10	8,756,976.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	102,900	101.84	10,479,336.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	63,700	91.40	5,822,180.00	
	EPIROC AB-A	24,905	167.35	4,167,851.75	
	EPIROC AB-B	15,450	148.00	2,286,600.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	76.68	1,150,200.00	
	INDUTRADE AB	12,110	210.60	2,550,366.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	224.70	1,527,960.00	
	LIFCO AB-B SHS	8,470	172.90	1,464,463.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	56,120	87.32	4,900,398.40	
	SANDVIK AB	37,320	166.55	6,215,646.00	
	SKANSKA AB-B SHS	14,390	155.85	2,242,681.50	

	SKF AB-B SHARES-B	14,079	166.00	2,337,114.00	
	VOLVO AB-A SHS	7,120	175.30	1,248,136.00	
	VOLVO AB-B SHS-B	59,920	169.48	10,155,241.60	
	SECURITAS AB-B SHS	14,629	89.90	1,315,147.10	
	VOLVO CAR AB-B	20,400	77.50	1,581,000.00	
	ELECTROLUX AB-B	8,095	142.94	1,157,099.30	
	EVOLUTION AB	7,110	944.60	6,716,106.00	
	EMBRACER GROUP AB	23,940	77.54	1,856,307.60	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,848	131.22	3,654,214.56	
	SWEDISH MATCH AB	60,180	105.80	6,367,044.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	26,555	268.00	7,116,740.00	
	GETINGE AB-B SHS	9,750	235.50	2,296,125.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	5,560	217.80	1,210,968.00	
	NORDEA BANK ABP	122,382	95.21	11,651,990.22	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	62,450	105.75	6,604,087.50	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	47,710	86.36	4,120,235.60	
	SWEDBANK AB - A SHARES	34,550	130.05	4,493,227.50	
	EQT AB	10,680	223.40	2,385,912.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	243.10	1,211,610.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	239.40	1,431,612.00	
	INVESTOR AB-A SHS	19,180	195.80	3,755,444.00	
	INVESTOR AB-B SHS	69,350	176.06	12,209,761.00	
	KINNEVIK AB - B	8,285	162.65	1,347,555.25	
	LUNDBERGS AB-B SHS	2,260	447.00	1,010,220.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	23,220	57.67	1,339,097.40	
	SAGAX AB-B	7,910	230.00	1,819,300.00	
	ERICSSON LM-B SHS	111,765	75.00	8,382,375.00	
	HEXAGON AB-B SHS	77,800	110.45	8,593,010.00	
	TELE2 AB-B SHS	23,245	116.35	2,704,555.75	
	TELIA CO AB	94,230	39.58	3,729,623.40	
	スウェーデンクローナ小計	1,456,022		187,052,430.83 (2,482,185,757)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	11,980	338.30	4,052,834.00	
	EQUINOR ASA	36,424	342.00	12,457,008.00	
	NORSK HYDRO A S	50,660	54.70	2,771,102.00	

	YARA INTERNATIONAL ASA	6,670	411.20	2,742,704.00	
	ADEVINTA ASA	11,400	66.00	752,400.00	
	MOWI ASA	16,360	221.00	3,615,560.00	
	ORKLA ASA	27,860	82.58	2,300,678.80	
	SALMAR ASA	2,760	672.50	1,856,100.00	
	DNB BANK ASA	35,845	185.00	6,631,325.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	9,580	199.40	1,910,252.00	
	TELENOR ASA	23,915	132.70	3,173,520.50	
	ノルウェークローネ小計	233,454		42,263,484.30	(577,741,830)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,840	450.60	1,730,304.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,915	441.00	3,490,515.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	315	1,683.00	530,145.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	38,290	166.62	6,379,879.80	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	110	18,320.00	2,015,200.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	208	18,475.00	3,842,800.00	
	DSV A/S	7,650	1,089.50	8,334,675.00	
	PANDORA A/S	3,290	491.50	1,617,035.00	
	CARLSBERG AS-B	3,950	966.40	3,817,280.00	
	COLOPLAST-B	4,485	825.60	3,702,816.00	
	DEMANT A/S	4,410	269.70	1,189,377.00	
	GN STORE NORD A/S	4,970	239.40	1,189,818.00	
	GENMAB A/S	2,485	2,538.00	6,306,930.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	64,695	845.30	54,686,683.50	
	DANSKE BANK A/S	26,635	97.76	2,603,837.60	
	TRYG A/S	13,945	160.05	2,231,897.25	
	ORSTED A/S	7,410	830.90	6,156,969.00	
	デンマーククローネ小計	194,603		109,826,162.15	(2,066,928,371)
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	32.36	283,959.00	
	SANTOS LTD	121,660	7.16	871,085.60	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,370	24.19	202,470.30	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	71,206	31.30	2,228,747.80	
	BHP GROUP LTD	194,667	36.97	7,196,838.99	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	15.84	290,030.40	

EVOLUTION MINING LTD	69,000	2.31	159,390.00
FORTESCUE METALS GROUP LTD	64,055	16.89	1,081,888.95
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	16,955	34.38	582,912.90
MINERAL RESOURCES LTD	6,240	45.12	281,548.80
NEWCREST MINING LTD	35,409	18.66	660,731.94
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42,190	6.77	285,626.30
ORICA LIMITED	17,675	16.20	286,335.00
RIO TINTO LTD	14,138	95.27	1,346,927.26
SOUTH32 LTD	188,687	3.48	656,630.76
REECE LTD	10,200	13.95	142,290.00
BRAMBLES LTD	54,798	11.35	621,957.30
AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	3.86	283,980.20
QANTAS AIRWAYS LTD	43,800	4.50	197,100.00
TRANSURBAN GROUP	113,696	14.31	1,626,989.76
ARISTOCRAT LEISURE LTD	22,000	36.70	807,400.00
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,130	70.67	150,527.10
IDP EDUCATION LTD	7,220	26.10	188,442.00
LOTTERY CORP LTD/THE	85,554	4.51	385,848.54
REA GROUP LTD	1,820	121.57	221,257.40
SEEK LTD	10,700	22.06	236,042.00
WESFARMERS LTD	42,745	46.15	1,972,681.75
COLES GROUP LTD	52,085	18.82	980,239.70
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	50,462	7.94	400,668.28
WOOLWORTHS GROUP LTD	45,862	37.42	1,716,156.04
TREASURY WINE ESTATES LTD	34,216	11.49	393,141.84
COCHLEAR LTD	2,527	211.77	535,142.79
RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,105	70.57	501,399.85
SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	34.20	603,972.00
CSL LTD	18,452	296.66	5,473,970.32
AUST AND NZ BANKING GROUP	106,839	21.64	2,311,995.96
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	65,347	94.24	6,158,301.28
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	125,023	29.00	3,625,667.00
WESTPAC BANKING CORP	136,331	20.15	2,747,069.65
ASX LTD	7,105	84.59	601,011.95
MACQUARIE GROUP LTD	13,964	173.33	2,420,380.12

	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	4.45	423,306.25	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	108,430	3.33	361,071.90	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	55,210	11.72	647,061.20	
	SUNCORP GROUP LTD	51,856	11.78	610,863.68	
	COMPUTERSHARE LTD	20,910	25.68	536,968.80	
	WISETECH GLOBAL LTD	6,970	47.29	329,611.30	
	XERO LTD	6,380	88.03	561,631.40	
	TELSTRA CORPORATION LTD	163,984	3.95	647,736.80	
	APA GROUP	45,818	11.74	537,903.32	
	ORIGIN ENERGY LTD	68,320	5.63	384,641.60	
豪ドル小計		2,651,551		56,759,553.08	(5,343,911,922)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,165	7.35	346,662.75	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,130	20.40	471,852.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	5.00	382,885.00	
	MERCURY NZ LTD	20,400	6.00	122,400.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	45,980	4.86	223,462.80	
ニュージーランドドル小計		213,252		1,547,262.55	(131,594,679)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	102,208	53.45	5,463,017.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	52,500	87.70	4,604,250.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	71,000	17.12	1,215,520.00	
	MTR CORP	57,500	41.85	2,406,375.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	24.80	1,289,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	86,000	45.80	3,938,800.00	
	SANDS CHINA LTD	96,600	17.30	1,671,180.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	22.45	1,524,355.00	
	WH GROUP LTD	339,394	5.89	1,999,030.66	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	134,500	27.85	3,745,825.00	
	HANG SENG BANK LTD	29,100	128.30	3,733,530.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	46,100	355.80	16,402,380.00	
	AIA GROUP LTD	465,390	83.70	38,953,143.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	77,038	55.80	4,298,720.40	
	ESR GROUP LTD	75,800	20.55	1,557,690.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	14.02	1,093,560.00		

	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	28.05	1,624,123.05	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	61,666	26.55	1,637,232.30	
	SINO LAND CO	143,050	11.80	1,687,990.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	55,980	92.65	5,186,547.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	17,517	45.80	802,278.60	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	18.76	780,416.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	35.00	2,233,000.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	11.02	1,653,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	48.90	1,222,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	59,500	66.90	3,980,550.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	95,000	7.10	674,500.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	436,237	8.35	3,642,578.95	
	POWER ASSETS HOLDINGS	55,000	51.15	2,813,250.00	
香港ドル小計		3,093,281		121,834,942.56 (2,145,513,338)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	53,360	6.49	346,306.40	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	63,300	4.03	255,099.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	5.31	286,209.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.79	166,769.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	4.05	299,538.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	71,695	29.96	2,147,982.20	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	131,740	11.34	1,493,931.60	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	41,800	26.41	1,103,938.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	29,700	9.78	290,466.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	105,000	3.80	399,000.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	7.62	131,826.00	
	UOL GROUP LTD	15,550	7.29	113,359.50	
	VENTURE CORP LTD	9,900	16.83	166,617.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	304,780	2.66	810,714.80	
シンガポールドル小計		1,183,085		8,011,756.50 (792,122,365)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	26,090	32.38	844,794.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,010	797.80	805,778.00	
	BANK HAPUALIM BM	41,135	31.40	1,291,639.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	62,565	32.26	2,018,346.90	

	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	48,330	19.06	921,169.80	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,900	124.00	607,600.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,780	261.80	466,004.00	
	NICE LTD	2,440	685.80	1,673,352.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	3,740	158.40	592,416.00	
イスラエルシェケル小計		191,990		9,221,099.90 (369,040,405)	
合 計		42,706,664		239,771,048,701 (239,771,048,701)	

(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	5,940	842,648.40	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	12,380	443,575.40	
		AMERICAN TOWER CORP	17,509	4,364,118.25	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	56,650	349,530.50	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,375	1,027,915.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,717	500,923.54	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,040	529,805.60	
		CROWN CASTLE INTL CORP	16,510	2,808,846.30	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,005	1,320,489.95	
		DUKE REALTY CORPORATION	14,585	819,385.30	
		EQUINIX INC	3,493	2,148,090.21	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,980	510,447.40	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	13,690	970,210.30	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	651,198.40	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,110	861,546.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	529,750.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	27,179	444,376.65	
		INVITATION HOMES INC	22,810	811,579.80	
		IRON MOUNTAIN INC	11,435	518,691.60	
		KIMCO REALTY CORP	24,630	501,466.80	

		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	23,470	371,060.70	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,490	747,315.60	
		PROLOGIS INC	28,228	3,364,777.60	
		PUBLIC STORAGE	6,039	1,865,809.44	
		REALTY INCOME CORP	22,221	1,543,692.87	
		REGENCY CENTERS CORP	6,005	364,383.40	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,210	1,319,877.10	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	12,504	1,233,394.56	
		SUN COMMUNITIES INC	4,380	697,164.60	
		UDR INC	12,100	539,660.00	
		VENTAS INC	15,485	779,669.75	
		VICI PROPERTIES INC	38,010	1,223,922.00	
		VORNADO REALTY TRUST	6,851	198,610.49	
		WELLTOWER INC	17,230	1,392,011.70	
		WEYERHAEUSER CO	27,758	952,654.56	
		WP CAREY INC	7,310	607,899.60	
米ドル小計			524,184	38,156,499.37	(5,275,136,037)
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	122,332.00	
加ドル小計			2,800	122,332.00	(13,024,688)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	107,030.00	
		GECINA SA	1,950	177,937.50	
		KLEPIERRE	8,402	175,937.88	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,940	243,887.80	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	5,160	155,419.20	
ユーロ小計			22,377	860,212.38	(120,515,754)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	36,981	170,445.42	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	181,895.16	
		SEGRO PLC	45,033	457,310.11	
英ポンド小計			108,638	809,650.69	(133,584,267)
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	35,587	332,026.71	
		GOODMAN GROUP	63,582	1,213,780.38	

		GPT GROUP	71,335	316,727.40	
		LENDLEASE GROUP	28,927	274,806.50	
		MIRVAC GROUP	135,075	279,605.25	
		SCENTRE GROUP	198,271	543,262.54	
		STOCKLAND	96,900	365,313.00	
		VICINITY CENTRES	154,902	299,735.37	
豪ドル小計			784,579	3,625,257.15	(341,317,960)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	81,700	5,298,245.00	
香港ドル小計			81,700	5,298,245.00	(93,302,094)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	116,243	335,942.27	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	440,067.60	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	72,200	129,238.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	144,556	248,636.32	
シンガポールドル小計			542,555	1,153,884.19	(114,084,529)
合計				6,090,965,329	(6,090,965,329)

(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 604銘柄	97.1%		71.8%
	投資証券 36銘柄		2.9%	2.1%
加ドル	株式 85銘柄	99.9%		3.7%
	投資証券 1銘柄		0.1%	0.0%
ユーロ	株式 222銘柄	99.4%		8.8%
	投資証券 5銘柄		0.6%	0.0%
英ポンド	株式 80銘柄	98.8%		4.6%
	投資証券 3銘柄		1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.0%		3.1%

スウェーデンクローナ	株式	46銘柄	100.0%		1.0%
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	51銘柄	94.0%		2.2%
	投資証券	8銘柄		6.0%	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	95.8%		0.9%
	投資証券	1銘柄		4.2%	0.0%
シンガポールドル	株式	14銘柄	87.4%		0.3%
	投資証券	4銘柄		12.6%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	100.0%		0.2%

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。

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）

貸借対照表

（単位：円）

	2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	480,504	339,440
親投資信託受益証券	44,874,518	31,865,996
未収入金	-	107,772
流動資産合計	45,355,022	32,313,208
資産合計	45,355,022	32,313,208
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	108,801
未払受託者報酬	162	115
未払委託者報酬	328	230
その他未払費用	36,448	19,303
流動負債合計	36,938	128,449
負債合計	36,938	128,449
純資産の部		

元本等		
元本	32,023,021	20,495,177
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	13,295,063	11,689,582
（分配準備積立金）	13,641,373	14,013,050
元本等合計	45,318,084	32,184,759
純資産合計	45,318,084	32,184,759
負債純資産合計	45,355,022	32,313,208

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)

		2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
1.	期首	2020年 7月18日	2021年 7月20日
	期首元本額	71,210,194円	32,023,021円
	期首からの追加設定元本額	5,797,048円	1,819,544円
	期首からの一部解約元本額	44,984,221円	13,347,388円
2.	受益権の総数	32,023,021口	20,495,177口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19日	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19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 7月19日現在	2022年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

(2021年 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	6,915
合計	6,915

(2022年 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
----	-------------------

親投資信託受益証券	357,921
合計	357,921

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当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 7月19日現在		2022年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.4152円	1口当たり純資産額	1.5704円
(1万口当たり純資産額)	(14,152円)	(1万口当たり純資産額)	(15,704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
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	11,012,959	31,865,996	
合計		11,012,959	31,865,996	

(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。

「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）」は、「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

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 7月19日現在	2022年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
預金	628,484,684	430,957,940
コール・ローン	22,500,503	36,906,989
投資証券	75,971,366,832	57,561,082,946
未収入金	880,542	-
未収配当金	129,177,567	92,708,732
流動資産合計	76,752,410,128	58,121,656,607
資産合計	76,752,410,128	58,121,656,607
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	229,792
未払利息	16	13
流動負債合計	16	229,805
負債合計	16	229,805
純資産の部		
元本等		
元本	29,567,818,913	20,086,743,422
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	47,184,591,199	38,034,683,380
元本等合計	76,752,410,112	58,121,426,802
純資産合計	76,752,410,112	58,121,426,802
負債純資産合計	76,752,410,128	58,121,656,607

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</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 7月19日現在	2022年 7月19日現在
1.	期首	2020年 7月18日	2021年 7月20日
	期首元本額	69,758,679,027円	29,567,818,913円
	期首からの追加設定元本額	90,636,247円	3,107,333,234円
	期首からの一部解約元本額	40,281,496,361円	12,588,408,725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	2,236,296,361円	2,079,035,201円
	インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）	17,287,356円	11,012,959円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	26,987,171,766円	17,723,269,179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）	327,063,430円	273,426,083円
	計	29,567,818,913円	20,086,743,422円
2.	受益権の総数	29,567,818,913口	20,086,743,422口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19日	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

(2021年 7月19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	16,374,456
合計	16,374,456

（2022年 7月19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	1,851,543,863
合計	1,851,543,863

(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 7月19日現在		2022年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	2.5958円	1口当たり純資産額	2.8935円
(1万口当たり純資産額)	(25,958円)	(1万口当たり純資産額)	(28,935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	29,564	483,667.04	
		AGREE REALTY CORPORATION	23,251	1,737,547.23	

ALEXANDER & BALDWIN INC	22,095	384,011.10	
ALEXANDER'S INC	747	173,864.25	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	45,948	6,518,183.28	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,963	53,126.59	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	16,129	476,289.37	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	43,175	2,811,556.00	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	91,377	3,274,037.91	
AMERICOLD REALTY TRUST INC	83,342	2,577,768.06	
APARTMENT INCOME REIT CO	48,613	2,031,537.27	
APARTMENT INVT&MGMT CO -A	46,127	325,195.35	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	65,479	1,026,710.72	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	20,024	259,711.28	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,550	102,157.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	43,277	8,276,293.48	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	8,876	231,841.12	
BOSTON PROPERTIES INC	44,129	3,866,582.98	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	21,777	106,489.53	
BRANDYWINE REALTY TRUST	53,007	484,483.98	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	92,237	1,914,840.12	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	52,444	1,125,972.68	
BRT APARTMENTS CORP	4,080	92,983.20	
CAMDEN PROPERTY TRUST	32,969	4,323,554.66	
CARETRUST REIT INC	29,906	580,774.52	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,667	207,085.67	
CEDAR REALTY TRUST INC	3,783	109,669.17	
CENTERSPACE	4,751	379,652.41	
CHATHAM LODGING TRUST	14,649	166,998.60	
CITY OFFICE REIT INC	12,836	167,253.08	
CLIPPER REALTY INC	3,403	28,244.90	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	7,401	262,735.50	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	34,895	918,785.35	
COUSINS PROPERTIES INC	45,913	1,327,803.96	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	5,241	37,211.10	
CTO REALTY GROWTH INC	5,055	105,952.80	
CUBESMART	69,423	2,878,971.81	

DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	64,612	549,202.00	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	99,300	74,475.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	88,094	10,570,399.06	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	78,915	138,101.25	
DOUGLAS EMMETT INC	54,439	1,195,480.44	
DUKE REALTY CORPORATION	118,949	6,682,554.82	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	68,595.90	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	28,918	560,430.84	
EASTGROUP PROPERTIES INC	12,884	1,979,497.76	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	41,014	303,913.74	
EPR PROPERTIES	23,174	1,166,115.68	
EQUINIX INC	28,160	17,317,555.20	
EQUITY COMMONWEALTH	35,052	968,136.24	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	53,550	3,916,111.50	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	105,900	7,505,133.00	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	40,479	898,229.01	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	20,229	5,311,730.82	
EXTRA SPACE STORAGE INC	41,538	7,003,306.80	
FARMLAND PARTNERS INC	9,080	125,213.20	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	22,081	2,173,432.83	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	40,827	1,914,378.03	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	25,137	691,518.87	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	28,941	107,949.93	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	72,659	3,592,260.96	
GETTY REALTY CORPORATION	12,439	335,231.05	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	11,676	219,742.32	
GLADSTONE LAND CORP	9,817	235,313.49	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	18,148	201,987.24	
GLOBAL NET LEASE INC	32,060	465,511.20	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	47,041	1,148,741.22	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	71,048	2,076,022.56	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	167,125	4,345,250.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	10,016	98,056.64	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	32,447	1,094,761.78	
HOST HOTELS & RESORTS INC	220,919	3,612,025.65	

HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	44,737	636,607.51	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	68,066	1,400,798.28	
INDUS REALTY TRUST INC	2,000	119,480.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	19,467	188,829.90	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	8,584	787,667.84	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	21,196	557,878.72	
INVITATION HOMES INC	188,800	6,717,504.00	
IRON MOUNTAIN INC	89,859	4,076,004.24	
JBG SMITH PROPERTIES	34,145	819,480.00	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	260,200	183,441.00	
KILROY REALTY CORPORATION	32,480	1,684,737.60	
KIMCO REALTY CORP	190,784	3,884,362.24	
KITE REALTY GROUP TRUST	67,514	1,201,074.06	
LIFE STORAGE INC	26,070	2,926,878.90	
LTC PROPERTIES INC	12,143	479,891.36	
LXP INDUSTRIAL TRUST	88,911	904,224.87	
MACERICH CO/THE	67,598	636,097.18	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	582,747	326,338.32	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	185,630	2,934,810.30	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	35,726	5,946,235.44	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	54,379	2,437,810.57	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	25,937	1,284,140.87	
NATL HEALTH INVESTORS INC	14,303	866,046.65	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	39,998	301,984.90	
NETSTREIT CORP	13,959	285,321.96	
NEXPOINT RESIDENTIAL	7,271	431,388.43	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	14,414	291,162.80	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	72,777	2,206,598.64	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,120	132,249.60	
ORION OFFICE REIT INC	18,157	187,561.81	
PARAMOUNT GROUP INC	50,256	359,330.40	
PARK HOTELS & RESORTS INC	71,987	1,027,974.36	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	41,122	742,663.32	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	1,694	6,945.40	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	35,233	1,186,647.44	

PHYSICIANS REALTY TRUST	69,806	1,166,458.26	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	38,404	500,020.08	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	11,837	203,833.14	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	5,657	87,117.80	
PRIME US REIT	199,000	135,320.00	
PROLOGIS INC	228,977	27,294,058.40	
PS BUSINESS PARKS INC	6,248	1,170,750.24	
PUBLIC STORAGE	47,246	14,597,124.16	
REALTY INCOME CORP	186,107	12,928,853.29	
REGENCY CENTERS CORP	47,948	2,909,484.64	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	37,871	604,042.45	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	50,963	2,998,662.92	
RLJ LODGING TRUST	50,984	592,434.08	
RPT REALTY	26,254	264,377.78	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	16,997	1,365,369.01	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	71,477	1,033,557.42	
SAFEHOLD INC	4,946	194,872.40	
SAUL CENTERS INC	4,054	191,673.12	
SERVICE PROPERTIES TRUST	52,425	330,277.50	
SIMON PROPERTY GROUP INC	101,550	10,016,892.00	
SITE CENTERS CORP	56,316	756,323.88	
SL GREEN REALTY CORP	19,947	926,338.68	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	41,381	1,689,586.23	
STAG INDUSTRIAL INC	55,423	1,636,641.19	
STORE CAPITAL CORP	77,975	2,078,033.75	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	33,491	252,857.05	
SUN COMMUNITIES INC	37,629	5,989,407.93	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	66,087	661,530.87	
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	32,062	475,158.84	
TERRENO REALTY CORP	23,334	1,300,870.50	
UDR INC	92,662	4,132,725.20	
UMH PROPERTIES INC	15,402	297,258.60	
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	4,004	204,804.60	
URBAN EDGE PROPERTIES	34,685	516,112.80	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	9,386	158,529.54	

		VENTAS INC	123,657	6,226,129.95	
		VERIS RESIDENTIAL INC	24,488	321,037.68	
		VICI PROPERTIES INC	297,563	9,581,528.60	
		VORNADO REALTY TRUST	49,324	1,429,902.76	
		WASHINGTON REIT	27,024	557,505.12	
		WELLTOWER INC	140,451	11,347,036.29	
		WHITESTONE REIT	14,812	156,710.96	
		WP CAREY INC	59,729	4,967,063.64	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	34,829	533,231.99	
米ドル小計			8,540,147	321,417,583.35 (44,435,980,898)	
加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	19,491	639,109.89	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,260	216,482.40	
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	5,633	71,088.46	
		BOARDWALK EQUITIES INC	6,814	289,731.28	
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	16,361	57,917.94	
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	26,623	1,163,158.87	
		CHOICE PROPERTIES REIT	51,235	698,333.05	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,489	259,371.97	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	16,360	258,488.00	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	38,115	456,998.85	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	7,681	146,169.43	
		EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	14,405	52,290.15	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	34,337	510,934.56	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	9,814	735,166.74	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	41,631	522,052.74	
		INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	6,035	43,391.65	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	21,457	251,690.61	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,346	305,093.98	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	6,740	97,460.40	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	6,174	99,216.18	
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	9,165	86,059.35	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	35,778	449,371.68	
		PLAZA RETAIL REIT	16,858	67,263.42	
		PRIMARIS REIT	14,543	181,060.35	

		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	45,966	905,070.54	
		SLATE GROCERY REIT	8,330	117,619.60	
		SLATE OFFICE REIT	16,716	75,389.16	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	21,949	607,109.34	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	29,198	492,570.26	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	15,675	100,947.00	
加ドル小計			597,179	9,956,607.85	(1,060,080,037)
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	12,180	1,140,657.00	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4,684	53,631.80	
		ALTAREA	1,241	173,243.60	
		BEFIMMO S.C.A.	1,316	62,312.60	
		CARE PROPERTY INVEST	8,630	201,079.00	
		CARMILA	13,401	202,355.10	
		COFINIMMO	9,202	959,768.60	
		COIMA RES SPA	5,887	58,457.91	
		COVIVIO	14,697	817,153.20	
		CROMWELL REIT EUR	96,360	189,829.20	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	12,596	276,860.08	
		GECINA SA	16,864	1,538,840.00	
		HAMBORNER REIT AG	23,156	193,815.72	
		ICADE	10,044	456,198.48	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	13,183	46,997.39	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	84,949	518,188.90	
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	7,178	187,345.80	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	149,923	202,396.05	
		KLEPIERRE	60,147	1,259,478.18	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	21,005	102,189.32	
		MERCIALYS	15,186	130,295.88	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	103,794	1,008,358.71	
		MONTEA	3,111	284,656.50	
		NSI NV	5,814	185,757.30	
		RETAIL ESTATES	3,406	228,883.20	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	36,011	1,777,863.07	
		VASTNED RETAIL	5,393	125,656.90	

		WAREHOUSES DE PAUW SCA	43,673	1,315,430.76	
		WERELDHAVE NV	12,186	184,252.32	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	6,625	281,893.75	
ユーロ小計			801,842	14,163,846.32 (1,984,354,869)	
英ポンド	投資証券	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	136,831	105,907.19	
		AEW UK REIT PLC	45,281	49,627.97	
		ASSURA PLC	922,229	620,199.00	
		BALANCED COMM PROPERTY TRUST	244,798	276,621.74	
		BIG YELLOW GROUP PLC	53,830	734,241.20	
		BRITISH LAND COMPANY PLC	288,877	1,331,434.09	
		CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	261,764	379,819.56	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	215,524	173,927.86	
		CUSTODIAN REIT PLC	136,467	142,471.54	
		DERWENT LONDON PLC	34,680	950,925.60	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	183,125	162,431.87	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	79,011	467,350.06	
		HAMMERSON PLC	1,123,690	229,569.86	
		HOME REIT PLC	243,689	280,729.72	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	126,314	147,787.38	
		INTU PROPERTIES PLC	758,746		
		LAND SECURITIES GROUP PLC	231,596	1,582,263.87	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	304,570	724,876.60	
		LXI REIT PLC	582,245	847,748.72	
		NEWRIVER REIT PLC	92,155	84,966.91	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	176,225	153,668.20	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	423,012	586,717.64	
		PRS REIT PLC/THE	171,020	187,437.92	
		REGIONAL REIT LTD	134,627	98,412.33	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	65,315	706,708.30	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	194,718	102,226.95	
SEGRO PLC	371,717	3,774,786.13			
SHAFTESBURY PLC	88,311	450,386.10			
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	385,755	478,336.20			
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	116,006	106,725.52			

		TRITAX BIG BOX REIT PLC	575,479	1,073,268.33	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	280,353	209,423.69	
		UNITE GROUP PLC	122,756	1,406,783.76	
		WORKSPACE GROUP PLC	42,815	233,769.90	
英債券小計			9,213,531	18,861,551.71	(3,111,967,416)
豪ドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	137,287	378,912.12	
		ARENA REIT	108,649	498,698.91	
		BWP TRUST	156,276	645,419.88	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	203,516	399,908.94	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	173,959	511,439.46	
		CENTURIA OFFICE REIT	140,685	246,198.75	
		CHARTER HALL GROUP	146,149	1,701,174.36	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	197,450	882,601.50	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	163,418	640,598.56	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	105,094	381,491.22	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	459,623	360,804.05	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	74,408	207,598.32	
		DEXUS/AU	335,030	3,125,829.90	
		GDI PROPERTY GROUP	177,407	172,971.82	
		GOODMAN GROUP	526,417	10,049,300.53	
		GPT GROUP	594,830	2,641,045.20	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	98,326	356,923.38	
		HEALTHCO REIT	87,968	141,628.48	
		HOME CONSORTIUM LTD	57,590	293,709.00	
		HOMEEO DAILY NEEDS REIT	472,487	642,582.32	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	58,540	194,352.80	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	117,244	521,735.80	
		MIRVAC GROUP	1,225,107	2,535,971.49	
		NATIONAL STORAGE REIT	335,804	748,842.92	
		RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	123,766	100,250.46	
		RURAL FUNDS GROUP	116,819	299,056.64	
		SCENTRE GROUP	1,608,648	4,407,695.52	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	356,914	1,020,774.04	
		STOCKLAND	739,546	2,788,088.42	

		VICINITY CENTRES	1,199,779	2,321,572.36	
		WAYPOINT REIT	234,230	590,259.60	
豪ドル小計			10,532,966	39,807,436.75	(3,747,870,170)
ニュー ジーラン ドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	424,273	882,487.84	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	217,104	594,864.96	
ニュージーランドドル小計			641,377	1,477,352.80	(125,648,855)
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	599,000	2,096,500.00	
		FORTUNE REIT	446,600	2,920,764.00	
		LINK REIT	654,000	42,411,900.00	
		PROSPERITY REIT	407,000	980,870.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	325,000	1,202,500.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	756,110	2,275,891.10	
香港ドル小計			3,187,710	51,888,425.10	(913,755,166)
シンガ ポールド ル	投資証券	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	149,725	205,123.25	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,046,432	3,024,188.48	
		ASCOTT TRUST	598,892	676,747.96	
		CAPITALAND CHINA TRUST	352,185	401,490.90	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,583,092	3,324,493.20	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	243,800	304,750.00	
		DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	83,500	55,945.00	
		EC WORLD REIT	113,900	58,658.50	
		ESR-LOGOS REIT	1,596,718	646,670.79	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	318,000	205,110.00	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	415,740	114,328.50	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	336,805	761,179.30	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERC	908,360	1,217,202.40	
		IREIT GLOBAL	169,833	101,899.80	
		KEPPEL DC REIT	415,777	819,080.69	
		KEPPEL REIT	613,800	662,904.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	559,752	447,801.60	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	686,831	1,229,427.49	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	610,508	1,593,425.88			

		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	998,987	1,718,257.64	
		QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	744,035	290,173.65	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	119,700	563,787.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	169,400	129,591.00	
		SPH REIT	296,100	270,931.50	
		STARHILL GLOBAL REIT	455,600	264,248.00	
		SUNTEC REIT	684,800	1,075,136.00	
シンガポールドドル小計			14,272,272	20,162,552.53	(1,993,471,568)
韓国ウォ ン	投資証券	D&D PLATFORM REIT CO LTD	15,480	65,170,800.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	45,652	235,564,320.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,383	54,866,060.00	
		JR REIT XXVII	37,368	165,540,240.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	12,992	71,456,000.00	
		LOTTE REIT CO LTD	40,192	203,371,520.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	8,226	36,975,870.00	
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	8,818	39,240,100.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,720	152,830,000.00	
		SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	9,014	44,979,860.00	
		SK REITS CO LTD	17,084	94,816,200.00	
		SK REITS CO LTD-RIGHTS	4,577		
韓国ウォン小計			230,506	1,164,810,970.00	(122,305,151)
イスラエ ルシュケ ル	投資証券	REIT 1 LTD	55,001	1,059,869.27	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	60,783	580,477.65	
イスラエルシュケル小計			115,784	1,640,346.92	(65,648,816)
合計				57,561,082,946	(57,561,082,946)

(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%	77.3%
加ドル	投資証券 30銘柄	100.0%	1.8%
ユーロ	投資証券 30銘柄	100.0%	3.4%
英ポンド	投資証券 34銘柄	100.0%	5.4%
豪ドル	投資証券 31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%	1.6%
シンガポールドル	投資証券 26銘柄	100.0%	3.5%
韓国ウォン	投資証券 12銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	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

該当事項はありません。

インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）

貸借対照表

（単位：円）

	2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	109,151	118,473
親投資信託受益証券	10,598,705	8,448,946
流動資産合計	10,707,856	8,567,419
資産合計	10,707,856	8,567,419
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	26,864
未払受託者報酬	28	241
未払委託者報酬	58	519

その他未払費用	8,986	5,833
流動負債合計	9,072	33,457
負債合計	9,072	33,457
純資産の部		
元本等		
元本	9,085,632	7,307,768
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,613,152	1,226,194
（分配準備積立金）	2,554,611	2,256,665
元本等合計	10,698,784	8,533,962
純資産合計	10,698,784	8,533,962
負債純資産合計	10,707,856	8,567,419

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)

		2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
1.	期首	2020年 7月18日	2021年 7月20日
	期首元本額	12,781,905円	9,085,632円
	期首からの追加設定元本額	815,497円	902,799円
	期首からの一部解約元本額	4,511,770円	2,680,663円
2.	受益権の総数	9,085,632口	7,307,768口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19日	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19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 7月19日現在	2022年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

(2021年 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	12,438
合計	12,438

（2022年 7月19日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	58,597
合計	58,597

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当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 7月19日現在		2022年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.1775円	1口当たり純資産額	1.1678円
(1万口当たり純資産額)	(11,775円)	(1万口当たり純資産額)	(11,678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
親投資信託受益証券	海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド	6,233,545	8,448,946	

合計	6,233,545	8,448,946	
----	-----------	-----------	--

(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。

「インデックスファンド海外新興国債券(適格機関投資家向け)」は、「海外新興国債券インデックスLocal(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。

海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし)マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
預金	19,499,438	50,716,637
コール・ローン	48,663,597	46,887,690
国債証券	6,691,362,111	7,367,156,915
派生商品評価勘定	-	92,021
未収利息	97,287,071	112,888,029
前払費用	4,325,642	8,801,671
流動資産合計	6,861,137,859	7,586,542,963
資産合計	6,861,137,859	7,586,542,963
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	150,963	40,906
未払金	35,065,033	28,636,947
未払解約金	1,098,422	-
未払利息	36	17
流動負債合計	36,314,454	28,677,870
負債合計	36,314,454	28,677,870
純資産の部		
元本等		
元本	5,006,114,052	5,576,007,441
剰余金		
剰余金又は欠損金()	1,818,709,353	1,981,857,652
元本等合計	6,824,823,405	7,557,865,093
純資産合計	6,824,823,405	7,557,865,093
負債純資産合計	6,861,137,859	7,586,542,963

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
1.	期首	2020年 7月18日	2021年 7月20日
	期首元本額	4,445,728,274円	5,006,114,052円
	期首からの追加設定元本額	804,403,355円	855,749,540円
	期首からの一部解約元本額	244,017,577円	285,856,151円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外新興国（エマージング）債券（1年決算型）	4,998,339,750円	5,569,773,896円
	インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）	7,774,302円	6,233,545円
	計	5,006,114,052円	5,576,007,441円
2.	受益権の総数	5,006,114,052口	5,576,007,441口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19日	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19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 7月19日現在	2022年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

(2021年 7月19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	2,659,535
合計	2,659,535

(2022年 7月19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	47,301,369
合計	47,301,369

(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 7月19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	61,778,220	-	61,615,047	163,173
	米ドル	26,376,000	-	26,370,960	5,040
	ブラジルリアル	11,979,101	-	11,898,374	80,727
	コロンビアペソ	11,711,361	-	11,654,102	57,259
	ウルグアイペソ	11,711,758	-	11,691,611	20,147
	売建	35,402,220	-	35,390,010	12,210
米ドル	35,402,220	-	35,390,010	12,210	
合計		97,180,440	-	97,005,057	150,963

(2022年 7月19日現在)

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	20,333,770	-	20,378,203	44,433
	米ドル	929,512	-	921,558	7,954
	チェココルナ	8,441,236	-	8,466,002	24,766
	ポーランドズロチ	4,797,400	-	4,857,973	60,573
	南アフリカランド	6,165,622	-	6,132,670	32,952
	売建	929,512	-	922,830	6,682
	エジプト債券	929,512	-	922,830	6,682
合計		21,263,282	-	21,301,033	51,115

（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 7月19日現在		2022年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.3633円	1口当たり純資産額	1.3554円
(1万口当たり純資産額)	(13,633円)	(1万口当たり純資産額)	(13,554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
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-6.75%- 23/03/09	3,500,000.00	3,439,843.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	8,830,000.00	8,642,362.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	11,300,000.00	10,950,406.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	9,010,000.00	9,091,653.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-25/03/06	2,400,000.00	2,148,750.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	16,300,000.00	14,501,906.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	3,500,000.00	3,000,156.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	12,130,000.00	11,311,225.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	10,260,000.00	9,926,550.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	12,450,000.00	11,426,765.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	3,000,000.00	2,687,812.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	2,530,000.00	2,687,334.37	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	8,190,000.00	7,593,665.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	8,360,000.00	7,129,512.50	
MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	8,680,000.00	7,554,312.50			
メキシコペソ小計			120,440,000.00	112,092,256.23 (757,485,839)	
ブラジル レアル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL-8.5%-24/01/05	350,000.00	327,862.50	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL-10.25%- 28/01/10	250,000.00	228,015.62	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-23/07/01	5,600,000.00	4,956,086.08	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-24/01/01	9,950,000.00	8,230,028.23	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-24/07/01	3,400,000.00	2,648,678.21	

		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-25/07/01	3,900,000.00	2,695,802.86	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-25/01/01	3,490,000.00	3,252,663.07	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-27/01/01	3,700,000.00	3,302,736.62	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-29/01/01	2,640,000.00	2,266,153.89	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-31/01/01	1,200,000.00	998,987.53	
ブラジルリアル小計			34,480,000.00	28,907,014.61	(734,865,453)
チリペソ	国債証券	BONOS TESORERIA PESOS-4.0%-23/03/01	80,000,000.00	77,147,108.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-2.5%-25/03/01	215,000,000.00	193,666,528.25	
		BONOS TESORERIA PESOS-4.5%-26/03/01	185,000,000.00	172,302,173.50	
		BONOS TESORERIA PESOS-5.0%-28/10/01	150,000,000.00	137,248,695.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-2.3%-28/10/01	100,000,000.00	77,564,335.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-4.7%-30/09/01	95,000,000.00	84,325,325.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-5.0%-35/03/01	210,000,000.00	184,429,066.50	
		BONOS TESORERIA PESOS-6.0%-43/01/01	145,000,000.00	136,093,469.25	
チリペソ小計			1,180,000,000.00	1,062,776,700.50	(155,180,277)
コロンビアペソ	国債証券	TITULOS DE TESORERIA-5.75%-27/11/03	810,000,000.00	604,219,500.00	
		TITULOS DE TESORERIA-7.0%-31/03/26	900,000,000.00	633,870,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA-6.25%-36/07/09	450,000,000.00	258,862,500.00	
		TITULOS DE TESORERIA-9.25%-42/05/28	400,000,000.00	292,804,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA-7.25%-50/10/26	850,000,000.00	485,146,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-10.0%-24/07/24	1,085,000,000.00	1,063,300,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-6.25%-25/11/26	900,000,000.00	760,608,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.5%-26/08/26	1,720,000,000.00	1,468,450,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-6.0%-28/04/28	1,580,000,000.00	1,166,261,121.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.75%-30/09/18	905,000,000.00	682,270,404.75	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-32/06/30	1,320,000,000.00	900,081,600.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.25%-34/10/18	1,340,000,000.00	884,694,800.00	
コロンビアペソ小計			12,260,000,000.00	9,200,567,925.75	(294,997,809)
ペルーヌエボソル	国債証券	BONOS DE TESORERIA-5.7%-24/08/12	310,000.00	305,875.14	
		BONOS DE TESORERIA-6.35%-28/08/12	810,000.00	739,879.92	

		BONOS DE TESORERIA-5.94%-29/02/12	450,000.00	397,568.25	
		BONOS DE TESORERIA-6.15%-32/08/12	700,000.00	591,583.30	
		BONOS DE TESORERIA-5.4%-34/08/12	350,000.00	268,144.80	
		BONOS DE TESORERIA-5.35%-40/08/12	450,000.00	316,065.37	
		PERU BONO SOBERANO-8.2%-26/08/12	640,000.00	660,821.76	
		PERU BONO SOBERANO-6.95%-31/08/12	840,000.00	763,877.09	
		PERU BONO SOBERANO-6.9%-37/08/12	770,000.00	659,839.18	
ペルーヌエボソル小計			5,320,000.00	4,703,654.81	(167,088,870)
ウルグアイペソ	国債証券	REPUBLICA ORIENT URUGUAY-8.5%-28/03/15	1,300,000.00	1,145,280.76	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY-8.25%-31/05/21	4,500,000.00	3,712,738.05	
ウルグアイペソ小計			5,800,000.00	4,858,018.81	(15,922,642)
ドミニカペソ	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC-8.9%-23/02/15	8,000,000.00	7,966,500.00	
ドミニカペソ小計			8,000,000.00	7,966,500.00	(20,222,163)
セルビアディナール	国債証券	SERBIA TREASURY BONDS-4.5%-26/01/11	5,600,000.00	5,341,364.00	
		SERBIA TREASURY BONDS-5.875%-28/02/08	4,300,000.00	4,137,864.20	
		SERBIA TREASURY BONDS-4.5%-32/08/20	5,500,000.00	4,493,285.50	
セルビアディナール小計			15,400,000.00	13,972,513.70	(16,677,033)
トルコリラ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND-7.1%-23/03/08	860,000.00	787,760.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-16.2%-23/06/14	1,200,000.00	1,140,000.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.4%-24/03/20	350,000.00	295,575.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.0%-24/07/24	760,000.00	613,700.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.0%-25/03/12	820,000.00	612,950.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-12.6%-25/10/01	1,500,000.00	1,242,000.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.6%-26/02/11	1,160,000.00	907,700.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-11.0%-27/02/24	810,000.00	614,385.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.5%-27/08/11	840,000.00	636,300.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-12.4%-28/03/08	450,000.00	363,150.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-11.7%-30/11/13	1,950,000.00	1,435,200.00	
トルコリラ小計			10,700,000.00	8,648,720.00	(68,497,862)

チェココ ルナ	国債証券	CZECH REPUBLIC-0.45%-23/10/25	4,600,000.00	4,232,000.00	
		CZECH REPUBLIC-5.7%-24/05/25	3,520,000.00	3,462,008.00	
		CZECH REPUBLIC-0.0%-24/12/12	1,500,000.00	1,293,727.50	
		CZECH REPUBLIC-1.25%-25/02/14	5,000,000.00	4,406,700.00	
		CZECH REPUBLIC-2.4%-25/09/17	5,500,000.00	4,949,945.00	
		CZECH REPUBLIC-6.0%-26/02/26	3,000,000.00	3,031,950.00	
		CZECH REPUBLIC-1.0%-26/06/26	5,900,000.00	4,955,233.00	
		CZECH REPUBLIC-0.25%-27/02/10	5,600,000.00	4,487,644.00	
		CZECH REPUBLIC-2.5%-28/08/25	5,570,000.00	4,841,471.85	
		CZECH REPUBLIC-2.75%-29/07/23	5,900,000.00	5,222,975.00	
		CZECH REPUBLIC-0.05%-29/11/29	3,100,000.00	2,205,727.50	
		CZECH REPUBLIC-0.95%-30/05/15	5,450,000.00	4,125,895.25	
		CZECH REPUBLIC-1.2%-31/03/13	4,900,000.00	3,700,921.00	
		CZECH REPUBLIC-1.75%-32/06/23	4,600,000.00	3,596,510.00	
		CZECH REPUBLIC-2.0%-33/10/13	6,100,000.00	4,775,202.00	
		CZECH REPUBLIC-3.5%-35/05/30	1,500,000.00	1,355,482.50	
		CZECH REPUBLIC-4.2%-36/12/04	2,900,000.00	2,792,555.00	
		CZECH REPUBLIC-1.5%-40/04/24	2,000,000.00	1,250,560.00	
チェココルナ小計			76,640,000.00	64,686,507.60	(369,359,958)
ハンガ リーフォ リント	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.0%-23/11/24	50,000,000.00	47,310,500.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-24/06/26	44,000,000.00	38,503,080.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.5%-24/10/24	58,000,000.00	49,078,324.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-25/06/24	59,800,000.00	52,635,063.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-1.0%-25/11/26	62,000,000.00	46,197,750.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-1.5%-26/04/22	49,000,000.00	36,025,535.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-1.5%-26/08/26	24,000,000.00	17,184,840.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.75%- 26/12/22	51,000,000.00	37,805,025.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-27/10/27	67,000,000.00	48,137,155.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.75%- 28/10/22	33,300,000.00	28,330,141.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.0%-29/05/23	37,000,000.00	23,261,715.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-30/08/21	45,000,000.00	29,361,150.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.25%- 31/10/22	60,000,000.00	38,857,200.00	

		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.25%-33/04/20	60,000,000.00	33,408,300.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.25%-34/06/22	30,000,000.00	15,858,750.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-38/10/27	37,500,000.00	19,409,437.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-41/04/25	28,000,000.00	13,916,280.00	
ハンガリーフォリント小計			795,600,000.00	575,280,246.00	(200,677,309)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	1,210,000.00	1,164,867.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	1,520,000.00	1,398,932.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	1,630,000.00	1,456,290.90	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	1,300,000.00	1,095,744.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	1,900,000.00	1,702,438.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,110,000.00	1,781,051.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,470,000.00	1,111,481.70	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	1,000,000.00	867,940.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	1,570,000.00	1,279,393.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	1,740,000.00	1,414,254.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	2,190,000.00	1,707,718.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	1,560,000.00	1,044,420.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-32/04/25	990,000.00	649,034.10	
ポーランドズロチ小計			20,190,000.00	16,673,564.50	(488,056,908)
ロシアルーブル	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-0.0%-22/12/07	14,700,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-0.0%-23/01/25	7,400,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-0.0%-23/08/16	12,400,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-0.0%-24/02/28	14,900,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-0.0%-24/07/17	19,800,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-0.0%-24/10/16	16,900,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-0.0%-25/07/16	5,000,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-0.0%-25/11/12	21,800,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-0.0%-26/09/16	16,700,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-0.0%-26/10/07	15,000,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-0.0%-27/02/03	15,400,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-0.0%-27/10/06	21,000,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - 0FZ-0.0%-28/01/19	15,900,000.00		

		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-28/05/17	17,300,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-29/03/14	13,000,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-29/05/23	15,300,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-30/04/10	20,400,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-31/07/23	14,600,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-31/09/17	11,650,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-33/03/23	16,000,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-34/05/10	15,000,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-35/07/18	18,000,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-39/03/16	14,500,000.00		
ロシアルーブル小計			352,650,000.00		()
ルーマニア アレイ	国債証券	ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.85%- 23/04/26	480,000.00	468,933.60	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.25%- 23/06/28	480,000.00	460,308.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.4%-23/09/25	500,000.00	474,922.50	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	560,000.00	527,478.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%- 24/04/29	630,000.00	572,377.05	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.5%-24/06/17	450,000.00	415,503.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.7%-24/11/25	500,000.00	445,450.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%- 25/02/24	550,000.00	497,024.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.65%- 25/07/28	610,000.00	526,143.30	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.85%- 26/04/22	450,000.00	391,817.25	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%- 26/06/24	500,000.00	407,507.50	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.8%-27/07/26	520,000.00	454,157.60	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-2.5%-27/10/25	300,000.00	220,500.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.15%- 28/01/26	550,000.00	436,749.50	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.0%-29/02/12	560,000.00	450,738.40	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.85%- 29/07/25	270,000.00	212,700.60	
ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.15%- 30/10/24	440,000.00	316,844.00			

		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.65%- 31/09/24	620,000.00	419,253.30	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%- 34/10/11	420,000.00	288,294.30	
ルーマニアレイ小計			9,390,000.00	7,986,701.90 (226,589,122)	
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-23/04/20	470,000.00	473,055.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.8%-23/08/17	400,000.00	403,240.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.478%-24/06/14	900,000.00	903,600.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	1,050,000.00	1,065,960.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,570,000.00	1,587,741.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	480,000.00	483,600.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	1,220,000.00	1,229,150.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	690,000.00	694,140.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.504%-29/04/30	250,000.00	258,000.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	940,000.00	932,950.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	1,070,000.00	956,847.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.582%-32/07/15	370,000.00	357,050.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	820,000.00	781,870.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	850,000.00	835,125.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	935,000.00	971,465.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	1,870,000.00	1,674,585.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.696%-42/10/15	200,000.00	203,200.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	890,000.00	793,435.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.151%- 23/05/15	300,000.00	300,480.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.094%- 23/11/30	500,000.00	505,900.00	
MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.655%- 24/10/15	340,000.00	341,632.00			
MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.128%- 25/08/15	700,000.00	711,550.00			
MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.726%- 26/03/31	850,000.00	850,425.00			
MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.258%- 27/07/26	430,000.00	438,901.00			
MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.422%- 27/09/30	570,000.00	559,597.50			

		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.369%- 28/10/31	730,000.00	744,782.50	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.13%- 29/07/09	570,000.00	573,420.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.465%- 30/10/15	950,000.00	907,250.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.447%- 36/07/15	480,000.00	432,000.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.48%-23/03/15	980,000.00	984,116.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	730,000.00	741,899.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	700,000.00	691,600.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,350,000.00	1,337,850.00	
		マレーシアリングット小計	25,155,000.00	24,726,416.50 (767,213,723)	
タイバー ツ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND-3.625%- 23/06/16	7,100,000.00	7,264,423.57	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.4%- 23/12/17	9,700,000.00	9,838,770.14	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-0.75%- 24/06/17	10,900,000.00	10,704,966.30	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-0.75%- 24/09/17	8,600,000.00	8,405,919.50	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.45%- 24/12/17	10,700,000.00	10,593,027.82	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-0.95%- 25/06/17	10,800,000.00	10,486,678.50	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.85%- 25/12/12	9,170,000.00	9,706,840.68	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.125%- 26/12/17	11,300,000.00	11,247,643.71	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.0%- 27/06/17	13,600,000.00	12,764,987.20	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.875%- 28/12/17	8,700,000.00	8,922,904.44	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.875%- 29/06/22	10,680,000.00	12,282,794.05	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.6%- 29/12/17	8,700,000.00	8,173,055.35	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.65%- 31/06/20	9,300,000.00	10,107,072.60	

		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.0%- 31/12/17	12,200,000.00	11,661,100.38	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.775%- 32/06/25	11,500,000.00	12,664,923.55	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.6%- 35/06/17	5,500,000.00	4,619,646.62	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.585%- 35/12/17	9,400,000.00	7,856,067.86	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.4%- 36/06/17	8,250,000.00	8,438,239.42	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.3%- 38/06/17	11,100,000.00	11,113,197.90	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.0%- 42/06/17	6,900,000.00	5,510,669.13	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.875%- 46/06/17	8,300,000.00	7,042,408.07	
		タイパーツ小計	202,400,000.00	199,405,336.79 (751,758,119)	
インドネ シアルビ ア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT-5.625%-23/05/15	3,250,000,000.00	3,279,250,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-24/03/15	4,400,000,000.00	4,602,400,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.125%-24/05/15	3,200,000,000.00	3,345,600,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.5%-25/06/15	4,900,000,000.00	4,956,350,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-25/09/15	1,060,000,000.00	1,203,100,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.5%-26/04/15	2,500,000,000.00	2,422,500,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-26/09/15	3,890,000,000.00	4,152,575,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.125%-27/04/15	2,200,000,000.00	2,079,000,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-27/05/15	2,900,000,000.00	2,940,600,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.125%-28/05/15	3,600,000,000.00	3,488,400,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.0%-29/03/15	2,350,000,000.00	2,583,825,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-29/05/15	3,300,000,000.00	3,499,650,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.5%-30/08/15	810,000,000.00	961,875,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-30/09/15	4,300,000,000.00	4,224,750,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.5%-31/02/15	3,800,000,000.00	3,587,200,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.75%-31/05/15	2,300,000,000.00	2,484,000,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.5%-31/07/15	1,120,000,000.00	1,265,600,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.375%-32/04/15	2,100,000,000.00	1,955,100,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-32/06/15	1,400,000,000.00	1,473,500,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-32/08/15	1,600,000,000.00	1,600,000,000.00	

		INDONESIA GOVERNMENT-6.625%-33/05/15	3,330,000,000.00	3,121,875,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-34/03/15	4,300,000,000.00	4,536,500,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-35/06/15	3,150,000,000.00	3,123,225,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-36/05/15	2,160,000,000.00	2,259,360,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.25%-36/06/15	800,000,000.00	720,400,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-38/05/15	2,100,000,000.00	2,063,250,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-39/04/15	1,950,000,000.00	2,059,200,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-40/04/15	3,500,000,000.00	3,442,250,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.125%-42/06/15	2,000,000,000.00	1,917,000,000.00	
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.75%-23/08/15	500,000,000.00	522,152,350.00	
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.875%-31/11/15	1,090,000,000.00	1,229,614,830.00	
インドネシアルピア小計			79,860,000,000.00	81,100,102,180.00 (754,230,950)	
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-23/10/18	2,100,000.00	2,134,275.15	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-24/04/11	1,300,000.00	1,323,042.89	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.94%-24/10/17	2,400,000.00	2,434,926.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.99%-25/04/09	2,300,000.00	2,276,526.89	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	2,000,000.00	2,037,751.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.22%-25/12/06	2,000,000.00	2,050,794.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-26/06/06	2,100,000.00	2,159,811.04	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-26/12/05	2,300,000.00	2,356,431.65	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	3,000,000.00	3,036,630.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.28%-27/12/03	2,000,000.00	2,068,291.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-28/11/22	2,200,000.00	2,269,425.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-29/05/23	3,100,000.00	3,208,873.55	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.13%-29/11/21	2,100,000.00	2,144,066.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	3,000,000.00	2,967,109.05	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	2,000,000.00	2,067,286.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	1,000,000.00	993,626.75	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	2,000,000.00	2,173,085.00	
中国元小計			36,900,000.00	37,701,954.87 (772,810,900)	
エジプト ポンド	国債証券	EGYPT GOVERNMENT BOND-14.531%-24/09/14	3,100,000.00	3,030,865.35	

		EGYPT GOVERNMENT BOND-14.369%- 25/10/20	3,600,000.00	3,453,275.34	
		EGYPT GOVERNMENT BOND-14.483%- 26/04/06	2,500,000.00	2,428,484.50	
		EGYPT GOVERNMENT BOND-14.563%- 26/07/06	2,000,000.00	1,917,849.40	
		EGYPT GOVERNMENT BOND-14.4%-29/09/10	4,400,000.00	4,062,440.58	
エジプトボンド小計			15,600,000.00	14,892,915.17	(108,800,191)
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.75%- 23/02/28	2,750,000.00	2,764,743.71	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	15,300,000.00	15,827,778.09	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	13,430,000.00	11,367,264.81	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	5,940,000.00	4,532,877.85	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	10,650,000.00	8,654,654.34	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	8,600,000.00	6,980,378.34	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	4,190,000.00	2,640,322.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	10,010,000.00	7,683,916.24	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	7,270,000.00	5,719,146.51	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	4,090,000.00	2,460,692.66	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	8,830,000.00	6,676,426.57	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	14,850,000.00	11,133,708.04	
		南アフリカランド小計			105,910,000.00
合計				7,367,156,915	(7,367,156,915)

(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
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	10.3%
ブラジルリアル	国債証券 10銘柄	100.0%	10.0%
チリペソ	国債証券 8銘柄	100.0%	2.1%
コロンビアペソ	国債証券 12銘柄	100.0%	4.0%
ペルーヌエボソル	国債証券 9銘柄	100.0%	2.3%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.3%
セルビアディナール	国債証券 3銘柄	100.0%	0.2%
トルコリラ	国債証券 11銘柄	100.0%	0.9%
チェココルナ	国債証券 18銘柄	100.0%	5.0%
ハンガリーフォリント	国債証券 17銘柄	100.0%	2.7%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	6.6%
ロシアルーブル	国債証券 23銘柄		
ルーマニアレイ	国債証券 19銘柄	100.0%	3.1%
マレーシアリングット	国債証券 33銘柄	100.0%	10.4%
タイバーツ	国債証券 21銘柄	100.0%	10.2%
インドネシアルピア	国債証券 31銘柄	100.0%	10.2%
中国元	国債証券 17銘柄	100.0%	10.5%
エジプトポンド	国債証券 5銘柄	100.0%	1.5%
南アフリカランド	国債証券 12銘柄	100.0%	9.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

貸借対照表

	2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	15,254,191	18,150,505
親投資信託受益証券	2,976,684,746	3,405,566,070
派生商品評価勘定	9,706,572	-
流動資産合計	3,001,645,509	3,423,716,575
資産合計	3,001,645,509	3,423,716,575
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	52,292,208
未払解約金	-	769,999
未払受託者報酬	29,854	33,270
未払委託者報酬	99,522	110,914
未払利息	11	8
その他未払費用	24,432	22,429
流動負債合計	153,819	53,228,828
負債合計	153,819	53,228,828
純資産の部		
元本等		
元本	2,350,360,311	2,829,323,570
剰余金		
剰余金又は欠損金()	651,131,379	541,164,177
(分配準備積立金)	541,094,924	446,582,905
元本等合計	3,001,491,690	3,370,487,747
純資産合計	3,001,491,690	3,370,487,747
負債純資産合計	3,001,645,509	3,423,716,575

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. 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。

(貸借対照表に関する注記)

		2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
1.	期首	2020年 7月18日	2021年 7月20日
	期首元本額	3,066,638,104円	2,350,360,311円
	期首からの追加設定元本額	381,138,153円	936,853,244円
	期首からの一部解約元本額	1,097,415,946円	457,889,985円
2.	受益権の総数	2,350,360,311口	2,829,323,570口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19日	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19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 7月19日現在	2022年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

(2021年 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	6,674,415
合計	6,674,415

(2022年 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	13,591,009
合計	13,591,009

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当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 7月19日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	3,007,215,377	-	2,997,508,805	9,706,572
	米ドル	3,007,215,377	-	2,997,508,805	9,706,572
	合計	3,007,215,377	-	2,997,508,805	9,706,572

(2022年 7月19日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益

市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	3,416,686,650	-	3,468,978,858	52,292,208
	米ドル	3,416,686,650	-	3,468,978,858	52,292,208
合計		3,416,686,650	-	3,468,978,858	52,292,208

(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 7月19日現在		2022年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.2770円	1口当たり純資産額	1.1913円
(1万口当たり純資産額)	(12,770円)	(1万口当たり純資産額)	(11,913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
親投資信託受益証券	ゴールド・マザーファンド	2,284,388,295	3,405,566,070	
合計		2,284,388,295	3,405,566,070	

(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

「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。

「FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」は、「ゴールド・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。

ゴールド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
預金	82,869,173	72,263,654
コール・ローン	48,649,116	57,198,209
投資信託受益証券	149,260,981,781	157,876,937,197
派生商品評価勘定	2,624	231,990
流動資産合計	149,392,502,694	158,006,631,050
資産合計	149,392,502,694	158,006,631,050
負債の部		
流動負債		
未払金	112,446,797	8,423,828,263
未払解約金	-	6,874,000
未払利息	37	26
流動負債合計	112,446,834	8,430,702,289
負債合計	112,446,834	8,430,702,289
純資産の部		
元本等		
元本	118,451,694,130	100,331,684,717
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	30,828,361,730	49,244,244,044
元本等合計	149,280,055,860	149,575,928,761

純資産合計	149,280,055,860	149,575,928,761
負債純資産合計	149,392,502,694	158,006,631,050

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

(貸借対照表に関する注記)

		2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
1.	期首	2020年 7月18日	2021年 7月20日
	期首元本額	112,869,912,034円	118,451,694,130円
	期首からの追加設定元本額	47,596,834,553円	19,150,081,540円
	期首からの一部解約元本額	42,015,052,457円	37,270,090,953円
	元本の内訳		
	ファイン・ブレンド(毎月分配型)	5,897,221,753円	5,089,606,024円
	ファイン・ブレンド(資産成長型)	3,231,580,941円	2,968,074,339円
	スマート・ファイブ(毎月決算型)	46,309,781,339円	36,352,749,914円
	スマート・ファイブ(1年決算型)	7,561,340,256円	6,254,836,456円
	ゴールド・ファンド(適格機関投資家向け)	5,578,559,355円	5,091,607,989円
	ゴールド・ファンド(為替ヘッジあり)	7,627,138,530円	5,970,680,050円
	ゴールド・ファンド(為替ヘッジなし)	6,272,265,786円	6,861,086,778円
	ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり(SMA専用)	33,556,626,167円	29,413,617,201円

	FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	2,361,885,858円	2,284,388,295円
	ファイン・ブレンド（適格機関投資家向け）	55,294,145円	45,037,671円
	計	118,451,694,130円	100,331,684,717円
2.	受益権の総数	118,451,694,130口	100,331,684,717口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19日	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19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 7月19日現在	2022年 7月19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	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品

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

（有価証券に関する注記）

（2021年 7月19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
投資信託受益証券	8,928,539,158
合計	8,928,539,158

（2022年 7月19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
投資信託受益証券	24,270,743,084
合計	24,270,743,084

(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 7月19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	35,158,656	-	35,161,280	2,624

	米ドル	35,158,656	-	35,161,280	2,624
	合計	35,158,656	-	35,161,280	2,624

(2022年 7月19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	8,667,453,630	-	8,667,685,620	231,990
	米ドル	8,667,453,630	-	8,667,685,620	231,990
	合計	8,667,453,630	-	8,667,685,620	231,990

(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 7月19日現在		2022年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.2603円	1口当たり純資産額	1.4908円
(1万口当たり純資産額)	(12,603円)	(1万口当たり純資産額)	(14,908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	投資信託受益証券	i シェアーズ ゴールド・トラスト	20,825,000	675,146,500.00	
		SPDR GOLD MINISHARES TRUST-ETF	12,000,000	407,040,000.00	
		SPDR GOLD TRUST-ETF	375,600	59,780,496.00	
米ドル小計		33,200,600	1,141,966,996.00 (157,876,937,197)		
	合計			157,876,937,197 (157,876,937,197)	

(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	組入投資信託 受益証券時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資信託受益証券 3銘柄	100.0%	100.0%

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。

インデックス マザーファンド TOPIX

貸借対照表

（単位：円）

	2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	104,999,800	89,098,872
株式	42,776,833,300	43,119,927,780
派生商品評価勘定	-	727,250
未収配当金	54,012,320	64,595,588
前払金	1,500,000	-
流動資産合計	42,937,345,420	43,274,349,490
資産合計	42,937,345,420	43,274,349,490
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,552,750	-
前受金	-	230,000
未払解約金	66,041,722	62,774,305
未払利息	80	42
流動負債合計	68,594,552	63,004,347
負債合計	68,594,552	63,004,347
純資産の部		
元本等		
元本	17,201,994,044	16,971,923,640
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	25,666,756,824	26,239,421,503
元本等合計	42,868,750,868	43,211,345,143
純資産合計	42,868,750,868	43,211,345,143
負債純資産合計	42,937,345,420	43,274,349,490

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
1.	期首	2020年 7月18日	2021年 7月20日
	期首元本額	18,584,035,558円	17,201,994,044円
	期首からの追加設定元本額	1,719,098,543円	1,853,900,967円
	期首からの一部解約元本額	3,101,140,057円	2,083,971,371円
	元本の内訳		
	インデックスファンドTSP	8,811,054,909円	8,583,887,839円
	財形株投（一般財形30）	13,582,616円	12,546,911円
	財形株投（一般財形50）	39,976,109円	36,637,425円
	財形株投（年金・住宅財形30）	27,012,260円	28,249,327円
	インデックスファンドTOPIX（日本株式）	7,780,221,313円	7,776,331,356円
	TOPIXインデックスファンド（個人型年金向け）	475,727,825円	500,971,632円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08	24,324,040円	20,407,318円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11	8,465,321円	6,620,538円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2017-02	8,412,946円	6,271,294円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2017-02	13,216,705円	- 円
	計	17,201,994,044円	16,971,923,640円
2.	受益権の総数	17,201,994,044口	16,971,923,640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	330,266,000円	468,551,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19日	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19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 7月19日現在	2022年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

(2021年 7月19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	601,423,933
合計	601,423,933

(2022年 7月19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	569,927,264
合計	569,927,264

(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 7月19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	97,825,000	-	95,275,000	2,550,000
合計		97,825,000	-	95,275,000	2,550,000

(2022年 7月19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	94,270,000	-	95,000,000	730,000
合計		94,270,000	-	95,000,000	730,000

(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 7月19日現在		2022年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	2.4921円	1口当たり純資産額	2.5460円
(1万口当たり純資産額)	(24,921円)	(1万口当たり純資産額)	(25,460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	3,605.00	2,884,000	
日本水産	22,500	584.00	13,140,000	
マルハニチロ	3,300	2,467.00	8,141,100	
雪国まいたけ	1,800	945.00	1,701,000	
カネコ種苗	800	1,620.00	1,296,000	
サカタのタネ	2,600	4,885.00	12,701,000	
ホクト	1,800	1,933.00	3,479,400	
ホクリヨウ	200	611.00	122,200	
住石ホールディングス	4,900	201.00	984,900	
日鉄鉱業	400	5,230.00	2,092,000	
三井松島ホールディングス	1,000	3,090.00	3,090,000	
I N P E X	83,700	1,409.00	117,933,300	
石油資源開発	2,900	3,285.00	9,526,500	
K & O エナジーグループ	900	1,526.00	1,373,400	

ショーボンドホールディングス	2,800	5,680.00	15,904,000	
ミライト・ワン	7,700	1,625.00	12,512,500	
タマホーム	1,500	2,421.00	3,631,500	
サンヨーホームズ	300	709.00	212,700	
日本アクア	1,200	582.00	698,400	
ファーストコーポレーション	800	717.00	573,600	
ベステラ	500	1,106.00	553,000	
キャンディル	500	542.00	271,000	
ダイセキ環境ソリューション	500	811.00	405,500	
第一カッター興業	500	1,290.00	645,000	
安藤・間	11,000	852.00	9,372,000	
東急建設	6,800	633.00	4,304,400	
コムシスホールディングス	7,700	2,549.00	19,627,300	
ピーアールホールディングス	2,900	342.00	991,800	
高松コンストラクショングループ	1,500	2,048.00	3,072,000	
東建コーポレーション	700	8,450.00	5,915,000	
ソネック	400	982.00	392,800	
ヤマウラ	1,100	953.00	1,048,300	
大成建設	15,400	4,125.00	63,525,000	
大林組	51,400	965.00	49,601,000	
清水建設	47,500	741.00	35,197,500	
飛鳥建設	1,400	1,046.00	1,464,400	
長谷工コーポレーション	14,800	1,610.00	23,828,000	
松井建設	1,900	632.00	1,200,800	
銭高組	200	3,165.00	633,000	
鹿島建設	37,600	1,468.00	55,196,800	
不動テトラ	1,100	1,621.00	1,783,100	
大末建設	700	1,533.00	1,073,100	
鉄建建設	1,100	1,796.00	1,975,600	
西松建設	3,400	3,970.00	13,498,000	
三井住友建設	13,000	453.00	5,889,000	
大豊建設	800	4,155.00	3,324,000	
ナカノフドー建設	1,200	316.00	379,200	
奥村組	2,800	2,941.00	8,234,800	
東鉄工業	2,200	2,289.00	5,035,800	
イチケン	400	1,804.00	721,600	

富士ピー・エス	1,000	453.00	453,000	
浅沼組	600	5,360.00	3,216,000	
戸田建設	21,100	694.00	14,643,400	
熊谷組	2,700	2,723.00	7,352,100	
北野建設	300	2,119.00	635,700	
植木組	400	1,285.00	514,000	
矢作建設工業	2,100	797.00	1,673,700	
ピーエス三菱	1,800	613.00	1,103,400	
日本ハウスホールディングス	4,000	401.00	1,604,000	
大東建託	5,700	12,140.00	69,198,000	
新日本建設	2,200	728.00	1,601,600	
東亜道路工業	300	5,680.00	1,704,000	
日本道路	500	7,000.00	3,500,000	
東亜建設工業	1,300	2,456.00	3,192,800	
日本国土開発	4,200	579.00	2,431,800	
若築建設	900	2,391.00	2,151,900	
東洋建設	6,400	858.00	5,491,200	
五洋建設	20,400	686.00	13,994,400	
世紀東急工業	2,600	809.00	2,103,400	
福田組	600	4,640.00	2,784,000	
住友林業	12,100	2,040.00	24,684,000	
日本基礎技術	1,400	581.00	813,400	
巴コーポレーション	2,100	443.00	930,300	
大和ハウス工業	43,700	3,216.00	140,539,200	
ライト工業	3,100	1,875.00	5,812,500	
積水ハウス	52,400	2,355.50	123,428,200	
日特建設	1,200	847.00	1,016,400	
北陸電気工事	1,000	772.00	772,000	
ユアテック	3,000	723.00	2,169,000	
日本リーテック	1,000	954.00	954,000	
四電工	500	1,765.00	882,500	
中電工	2,000	2,133.00	4,266,000	
関電工	8,700	839.00	7,299,300	
きんでん	11,100	1,573.00	17,460,300	
東京エネシス	1,600	1,091.00	1,745,600	
トーエネック	600	3,725.00	2,235,000	

住友電設	1,300	2,632.00	3,421,600
日本電設工業	2,400	1,786.00	4,286,400
エクシオグループ	7,500	2,103.00	15,772,500
新日本空調	1,100	1,895.00	2,084,500
九電工	3,500	2,661.00	9,313,500
三機工業	3,600	1,582.00	5,695,200
日揮ホールディングス	15,700	1,637.00	25,700,900
中外炉工業	500	1,637.00	818,500
ヤマト	1,400	757.00	1,059,800
太平電業	1,000	3,005.00	3,005,000
高砂熱学工業	4,200	1,649.00	6,925,800
三晃金属工業	200	2,600.00	520,000
朝日工業社	700	1,930.00	1,351,000
明星工業	2,700	702.00	1,895,400
大気社	2,300	3,070.00	7,061,000
ダイダン	1,000	2,157.00	2,157,000
日比谷総合設備	1,500	1,916.00	2,874,000
フィル・カンパニー	300	1,186.00	355,800
テスホールディングス	1,600	1,144.00	1,830,400
インフロニア・ホールディングス	19,400	932.00	18,080,800
東洋エンジニアリング	2,400	636.00	1,526,400
レイズネクスト	2,100	1,195.00	2,509,500
ニッポン	4,300	1,624.00	6,983,200
日清製粉グループ本社	16,700	1,622.00	27,087,400
日東富士製粉	300	4,535.00	1,360,500
昭和産業	1,400	2,558.00	3,581,200
鳥越製粉	1,000	651.00	651,000
中部飼料	1,700	1,079.00	1,834,300
フィード・ワン	2,000	678.00	1,356,000
東洋精糖	200	916.00	183,200
日本甜菜製糖	800	1,686.00	1,348,800
D M三井製糖ホールディングス	1,400	1,905.00	2,667,000
塩水港精糖	2,000	206.00	412,000
日新製糖	700	1,774.00	1,241,800
森永製菓	3,600	4,270.00	15,372,000
中村屋	400	3,145.00	1,258,000

江崎グリコ	4,100	3,950.00	16,195,000
名糖産業	600	1,662.00	997,200
井村屋グループ	900	2,270.00	2,043,000
不二家	1,000	2,395.00	2,395,000
山崎製パン	10,900	1,600.00	17,440,000
第一屋製パン	200	491.00	98,200
モロゾフ	600	3,565.00	2,139,000
亀田製菓	1,000	4,655.00	4,655,000
寿スピリッツ	1,500	6,080.00	9,120,000
カルビー	8,100	2,830.00	22,923,000
森永乳業	3,000	4,970.00	14,910,000
六甲バター	1,200	1,391.00	1,669,200
ヤクルト本社	11,200	7,990.00	89,488,000
明治ホールディングス	9,700	6,730.00	65,281,000
雪印メグミルク	3,800	1,835.00	6,973,000
プリマハム	2,100	2,251.00	4,727,100
日本ハム	6,200	4,095.00	25,389,000
林兼産業	200	475.00	95,000
丸大食品	1,500	1,576.00	2,364,000
S Foods	1,600	3,025.00	4,840,000
柿安本店	600	2,367.00	1,420,200
伊藤ハム米久ホールディングス	11,100	676.00	7,503,600
サッポロホールディングス	5,300	2,890.00	15,317,000
アサヒグループホールディングス	36,100	4,529.00	163,496,900
キリンホールディングス	65,000	2,197.00	142,805,000
宝ホールディングス	9,800	1,028.00	10,074,400
オエノンホールディングス	4,600	302.00	1,389,200
養命酒製造	300	1,786.00	535,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,300	1,474.00	16,656,200
サントリー食品インターナショナル	11,800	5,110.00	60,298,000
ダイドーグループホールディングス	900	5,110.00	4,599,000
伊藤園	5,400	6,110.00	32,994,000
キーコーヒー	1,600	2,111.00	3,377,600
ユニカフェ	600	913.00	547,800
ジャパンフーズ	300	1,121.00	336,300

日清オイリオグループ	2,000	3,155.00	6,310,000
不二製油グループ本社	3,900	2,203.00	8,591,700
かどや製油	200	3,555.00	711,000
J - オイルミルズ	1,500	1,613.00	2,419,500
キッコーマン	10,600	7,910.00	83,846,000
味の素	35,200	3,407.00	119,926,400
ブルドックソース	600	1,876.00	1,125,600
キューピー	7,700	2,241.00	17,255,700
ハウス食品グループ本社	5,500	2,917.00	16,043,500
カゴメ	6,700	3,355.00	22,478,500
焼津水産化学工業	700	923.00	646,100
アリアケジャパン	1,600	5,060.00	8,096,000
ピエトロ	200	1,800.00	360,000
エバラ食品工業	400	3,030.00	1,212,000
やまみ	200	1,642.00	328,400
ニチレイ	6,600	2,309.00	15,239,400
東洋水産	7,900	5,360.00	42,344,000
イトアンドホールディングス	800	2,482.00	1,985,600
大冷	100	1,906.00	190,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,000	450.00	450,000
日清食品ホールディングス	5,700	9,530.00	54,321,000
永谷園ホールディングス	800	1,981.00	1,584,800
一正蒲鉾	600	769.00	461,400
フジッコ	1,600	1,987.00	3,179,200
ロック・フィールド	1,800	1,487.00	2,676,600
日本たばこ産業	94,800	2,356.50	223,396,200
ケンコーマヨネーズ	900	1,472.00	1,324,800
わらべや日洋ホールディングス	1,100	2,255.00	2,480,500
なとり	900	2,042.00	1,837,800
イフジ産業	200	936.00	187,200
ピクルスコーポレーション	900	1,116.00	1,004,400
ファーマフーズ	2,200	1,420.00	3,124,000
ユーグレナ	9,200	904.00	8,316,800
紀文食品	1,400	985.00	1,379,000
ミヨシ油脂	600	1,017.00	610,200
理研ビタミン	1,300	1,725.00	2,242,500

片倉工業	1,600	2,053.00	3,284,800
ゲンゼ	1,000	3,785.00	3,785,000
東洋紡	6,700	1,005.00	6,733,500
ユニチカ	5,200	232.00	1,206,400
富士紡ホールディングス	700	3,330.00	2,331,000
倉敷紡績	1,100	2,056.00	2,261,600
シキボウ	700	892.00	624,400
日本毛織	4,200	1,009.00	4,237,800
ダイトウボウ	4,200	89.00	373,800
トーア紡コーポレーション	400	367.00	146,800
ダイドーリミテッド	3,100	157.00	486,700
帝国繊維	1,800	1,682.00	3,027,600
帝人	15,200	1,406.00	21,371,200
東レ	107,200	733.00	78,577,600
住江織物	400	1,656.00	662,400
日本フェルト	1,100	415.00	456,500
日東製網	200	1,304.00	260,800
アツギ	1,300	487.00	633,100
ダイニック	400	624.00	249,600
セーレン	3,200	2,050.00	6,560,000
ソトー	700	840.00	588,000
東海染工	200	1,130.00	226,000
小松マテーレ	2,700	1,056.00	2,851,200
ワコールホールディングス	3,500	2,108.00	7,378,000
ホギメディカル	2,100	3,395.00	7,129,500
クラウディアホールディングス	500	244.00	122,000
T S Iホールディングス	5,400	318.00	1,717,200
マツオカコーポレーション	500	916.00	458,000
ワールド	2,300	1,288.00	2,962,400
三陽商会	800	850.00	680,000
ナイガイ	800	272.00	217,600
オンワードホールディングス	9,600	249.00	2,390,400
ルックホールディングス	500	1,645.00	822,500
ゴールドウイン	2,900	8,010.00	23,229,000
デサント	3,000	2,987.00	8,961,000
キング	800	501.00	400,800

ヤマトインターナショナル	1,000	276.00	276,000	
特種東海製紙	900	3,105.00	2,794,500	
王子ホールディングス	66,500	556.00	36,974,000	
日本製紙	7,100	979.00	6,950,900	
三菱製紙	2,500	296.00	740,000	
北越コーポレーション	10,400	708.00	7,363,200	
中越パルプ工業	500	911.00	455,500	
巴川製紙所	600	611.00	366,600	
大王製紙	7,300	1,439.00	10,504,700	
阿波製紙	400	298.00	119,200	
レンゴー	13,400	746.00	9,996,400	
トモク	800	1,528.00	1,222,400	
ザ・バック	1,100	2,416.00	2,657,600	
北の達人コーポレーション	6,500	230.00	1,495,000	
クラレ	23,400	1,089.00	25,482,600	
旭化成	106,600	1,052.50	112,196,500	
共和レザー	900	570.00	513,000	
昭和電工	15,200	2,139.00	32,512,800	
住友化学	117,900	514.00	60,600,600	
住友精化	700	2,929.00	2,050,300	
日産化学	7,700	6,560.00	50,512,000	
ラサ工業	600	1,837.00	1,102,200	
クレハ	1,300	10,120.00	13,156,000	
多木化学	600	4,680.00	2,808,000	
テイカ	1,000	1,197.00	1,197,000	
石原産業	3,100	1,039.00	3,220,900	
片倉コープアグリ	500	1,260.00	630,000	
日本曹達	1,900	4,205.00	7,989,500	
東ソー	21,300	1,726.00	36,763,800	
トクヤマ	5,100	1,762.00	8,986,200	
セントラル硝子	2,600	3,160.00	8,216,000	
東亜合成	8,000	1,034.00	8,272,000	
大阪ソーダ	1,400	3,300.00	4,620,000	
関東電化工業	3,200	884.00	2,828,800	
デンカ	5,800	3,355.00	19,459,000	
信越化学工業	27,400	16,260.00	445,524,000	

日本カーバイド工業	700	1,343.00	940,100
堺化学工業	1,100	1,875.00	2,062,500
第一稀元素化学工業	1,500	1,187.00	1,780,500
エア・ウォーター	13,800	1,727.00	23,832,600
日本酸素ホールディングス	14,200	2,129.00	30,231,800
日本化学工業	500	1,940.00	970,000
東邦アセチレン	400	1,095.00	438,000
日本パーカラライジング	7,100	944.00	6,702,400
高圧ガス工業	2,400	665.00	1,596,000
四国化成工業	2,000	1,279.00	2,558,000
戸田工業	400	2,279.00	911,600
ステラ ケミファ	900	2,425.00	2,182,500
保土谷化学工業	500	3,305.00	1,652,500
日本触媒	2,400	5,240.00	12,576,000
大日精化工業	1,200	1,785.00	2,142,000
カネカ	3,700	3,470.00	12,839,000
三菱瓦斯化学	13,500	1,888.00	25,488,000
三井化学	13,400	2,753.00	36,890,200
J S R	16,100	3,450.00	55,545,000
東京応化工業	2,600	6,730.00	17,498,000
大阪有機化学工業	1,200	2,368.00	2,841,600
三菱ケミカルグループ	107,100	725.60	77,711,760
K Hネオケム	2,600	2,449.00	6,367,400
ダイセル	23,300	827.00	19,269,100
住友ベークライト	2,400	4,185.00	10,044,000
積水化学工業	32,900	1,861.00	61,226,900
日本ゼオン	12,900	1,365.00	17,608,500
アイカ工業	4,000	2,940.00	11,760,000
U B E	8,000	2,036.00	16,288,000
積水樹脂	2,300	1,746.00	4,015,800
タキロンシーアイ	3,600	553.00	1,990,800
旭有機材	1,000	2,016.00	2,016,000
ニチバン	900	1,662.00	1,495,800
リケンテクノス	3,200	434.00	1,388,800
大倉工業	700	1,721.00	1,204,700
積水化成成品工業	1,900	413.00	784,700

群栄化学工業	300	2,542.00	762,600	
タイガースポリマー	700	426.00	298,200	
ミライアル	600	1,801.00	1,080,600	
ダイキアクシス	800	691.00	552,800	
ダイキョーニシカワ	3,600	553.00	1,990,800	
竹本容器	800	758.00	606,400	
森六ホールディングス	800	1,848.00	1,478,400	
恵和	500	3,295.00	1,647,500	
日本化薬	12,000	1,115.00	13,380,000	
カーリットホールディングス	1,600	659.00	1,054,400	
日本精化	1,100	1,942.00	2,136,200	
扶桑化学工業	1,300	3,370.00	4,381,000	
トリケミカル研究所	1,800	2,084.00	3,751,200	
A D E K A	6,800	2,331.00	15,850,800	
日油	5,000	5,150.00	25,750,000	
新日本理化	2,800	280.00	784,000	
ハリマ化成グループ	1,100	758.00	833,800	
花王	36,400	5,704.00	207,625,600	
第一工業製薬	600	2,401.00	1,440,600	
石原ケミカル	800	1,275.00	1,020,000	
日華化学	600	794.00	476,400	
ニイタカ	300	2,286.00	685,800	
三洋化成工業	1,000	4,655.00	4,655,000	
有機合成薬品工業	1,200	270.00	324,000	
大日本塗料	1,800	720.00	1,296,000	
日本ペイントホールディングス	64,900	1,012.00	65,678,800	
関西ペイント	15,000	1,900.00	28,500,000	
神東塗料	1,600	148.00	236,800	
中国塗料	3,700	867.00	3,207,900	
日本特殊塗料	1,100	977.00	1,074,700	
藤倉化成	2,200	484.00	1,064,800	
太陽ホールディングス	2,500	2,764.00	6,910,000	
D I C	6,300	2,389.00	15,050,700	
サカタインクス	2,900	975.00	2,827,500	
東洋インキ S C ホールディングス	3,100	1,922.00	5,958,200	
T & K T O K A	1,300	859.00	1,116,700	

富士フイルムホールディングス	30,900	7,426.00	229,463,400	
資生堂	32,800	5,421.00	177,808,800	
ライオン	17,700	1,533.00	27,134,100	
高砂香料工業	1,000	2,601.00	2,601,000	
マンダム	3,500	1,648.00	5,768,000	
ミルボン	2,200	5,060.00	11,132,000	
ファンケル	7,100	2,509.00	17,813,900	
コーセー	3,300	12,090.00	39,897,000	
コタ	1,200	1,589.00	1,906,800	
シーボン	200	1,688.00	337,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	7,500	1,603.00	12,022,500	
ノエビアホールディングス	1,300	5,900.00	7,670,000	
アジュバンホールディングス	400	975.00	390,000	
新日本製薬	900	1,537.00	1,383,300	
エステー	1,100	1,556.00	1,711,600	
アグロ カネショウ	700	1,291.00	903,700	
コニシ	2,600	1,581.00	4,110,600	
長谷川香料	3,000	2,902.00	8,706,000	
星光P M C	900	523.00	470,700	
小林製薬	4,900	8,730.00	42,777,000	
荒川化学工業	1,200	1,014.00	1,216,800	
メック	1,200	2,247.00	2,696,400	
日本高純度化学	400	2,292.00	916,800	
タカラバイオ	4,600	2,054.00	9,448,400	
J C U	1,800	3,515.00	6,327,000	
新田ゼラチン	1,000	610.00	610,000	
O A T アグリオ	800	1,507.00	1,205,600	
デクセリアルズ	4,600	3,625.00	16,675,000	
アース製薬	1,400	5,480.00	7,672,000	
北興化学工業	1,500	937.00	1,405,500	
大成ラミック	500	2,697.00	1,348,500	
クミアイ化学工業	6,700	1,055.00	7,068,500	
日本農薬	3,200	666.00	2,131,200	
アキレス	1,100	1,368.00	1,504,800	
有沢製作所	2,600	1,008.00	2,620,800	
日東電工	10,700	8,630.00	92,341,000	

レック	2,100	698.00	1,465,800
三光合成	2,100	374.00	785,400
きもと	3,200	221.00	707,200
藤森工業	1,400	3,510.00	4,914,000
前澤化成工業	1,100	1,329.00	1,461,900
未来工業	600	1,522.00	913,200
ウェーブロックホールディングス	700	623.00	436,100
J S P	1,100	1,445.00	1,589,500
エフピコ	3,200	2,993.00	9,577,600
天馬	1,400	2,310.00	3,234,000
信越ポリマー	3,400	1,216.00	4,134,400
東リ	3,700	205.00	758,500
ニフコ	5,900	3,255.00	19,204,500
バルカー	1,500	2,604.00	3,906,000
ユニ・チャーム	34,000	4,844.00	164,696,000
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	3,150.00	55,755,000
武田薬品工業	138,500	3,961.00	548,598,500
アステラス製薬	150,700	2,122.00	319,785,400
住友ファーマ	10,900	1,059.00	11,543,100
塩野義製薬	20,500	7,373.00	151,146,500
わかもと製薬	1,800	258.00	464,400
日本新薬	3,800	8,230.00	31,274,000
中外製薬	55,100	3,643.00	200,729,300
科研製薬	2,500	3,930.00	9,825,000
エーザイ	19,500	6,194.00	120,783,000
ロート製薬	8,400	4,090.00	34,356,000
小野薬品工業	34,000	3,892.00	132,328,000
久光製薬	3,700	3,425.00	12,672,500
持田製薬	2,000	3,270.00	6,540,000
参天製薬	30,700	1,077.00	33,063,900
扶桑薬品工業	600	2,202.00	1,321,200
日本ケミファ	200	1,868.00	373,600
ツムラ	5,000	3,145.00	15,725,000
キッセイ薬品工業	2,600	2,858.00	7,430,800
生化学工業	3,100	872.00	2,703,200

栄研化学	2,600	1,869.00	4,859,400
日水製薬	800	1,713.00	1,370,400
鳥居薬品	1,000	3,300.00	3,300,000
JCRファーマ	5,000	2,615.00	13,075,000
東和薬品	2,600	2,547.00	6,622,200
富士製薬工業	900	989.00	890,100
ゼリア新薬工業	2,700	2,215.00	5,980,500
第一三共	127,800	3,508.00	448,322,400
キョーリン製薬ホールディングス	3,200	1,848.00	5,913,600
大幸薬品	2,800	619.00	1,733,200
ダイト	1,100	2,660.00	2,926,000
大塚ホールディングス	33,600	4,863.00	163,396,800
大正製薬ホールディングス	3,300	5,420.00	17,886,000
ペプチドリーム	9,300	1,526.00	14,191,800
あすか製薬ホールディングス	1,700	1,053.00	1,790,100
サワイグループホールディングス	3,400	4,305.00	14,637,000
日本コークス工業	15,400	118.00	1,817,200
ニチレキ	1,900	1,352.00	2,568,800
ユシロ化学工業	700	899.00	629,300
ピーピー・カストロール	500	1,117.00	558,500
富士石油	4,300	317.00	1,363,100
MORESCO	700	1,156.00	809,200
出光興産	17,900	3,210.00	57,459,000
ENEOSホールディングス	264,800	501.40	132,770,720
コスモエネルギーホールディングス	7,000	3,440.00	24,080,000
横浜ゴム	8,300	1,951.00	16,193,300
TOYO TIRE	8,400	1,808.00	15,187,200
ブリヂストン	46,800	5,127.00	239,943,600
住友ゴム工業	14,400	1,248.00	17,971,200
藤倉コンポジット	1,500	845.00	1,267,500
オカモト	800	3,870.00	3,096,000
フコク	900	985.00	886,500
ニッタ	1,600	2,828.00	4,524,800
住友理工	3,500	607.00	2,124,500
三ツ星ベルト	2,200	2,919.00	6,421,800
バンドー化学	2,900	955.00	2,769,500

日東紡績	2,200	2,236.00	4,919,200
A G C	14,900	4,695.00	69,955,500
日本板硝子	8,100	393.00	3,183,300
石塚硝子	200	1,614.00	322,800
日本山村硝子	600	662.00	397,200
日本電気硝子	6,500	2,619.00	17,023,500
オハラ	700	1,204.00	842,800
住友大阪セメント	2,700	3,450.00	9,315,000
太平洋セメント	10,100	1,993.00	20,129,300
日本ヒューム	1,500	648.00	972,000
日本コンクリート工業	3,100	270.00	837,000
三谷セキサン	700	4,045.00	2,831,500
アジアパイルホールディングス	2,600	482.00	1,253,200
東海カーボン	13,500	1,024.00	13,824,000
日本カーボン	900	4,005.00	3,604,500
東洋炭素	1,100	2,914.00	3,205,400
ノリタケカンパニーリミテド	900	4,210.00	3,789,000
T O T O	10,600	4,330.00	45,898,000
日本碍子	17,300	1,905.00	32,956,500
日本特殊陶業	12,400	2,557.00	31,706,800
ダントーホールディングス	1,300	285.00	370,500
M A R U W A	600	15,320.00	9,192,000
品川リフラクトリーズ	400	3,575.00	1,430,000
黒崎播磨	300	4,490.00	1,347,000
ヨータイ	1,100	1,477.00	1,624,700
東京窯業	1,700	274.00	465,800
ニッカトー	800	441.00	352,800
フジインコーポレーテッド	1,400	5,480.00	7,672,000
クニミネ工業	500	933.00	466,500
エーアンドエーマテリアル	200	852.00	170,400
ニチアス	3,700	2,337.00	8,646,900
ニチハ	2,200	2,628.00	5,781,600
日本製鉄	72,700	2,011.50	146,236,050
神戸製鋼所	30,500	630.00	19,215,000
合同製鐵	800	1,392.00	1,113,600
J F E ホールディングス	40,300	1,503.00	60,570,900

東京製鐵	5,100	1,479.00	7,542,900
共英製鋼	1,700	1,359.00	2,310,300
大和工業	2,800	4,395.00	12,306,000
東京鐵鋼	600	1,265.00	759,000
大阪製鐵	1,000	1,459.00	1,459,000
淀川製鋼所	1,800	2,350.00	4,230,000
丸一鋼管	5,000	2,878.00	14,390,000
モリ工業	400	2,508.00	1,003,200
大同特殊鋼	2,400	3,650.00	8,760,000
日本高周波鋼業	800	319.00	255,200
日本冶金工業	1,200	2,179.00	2,614,800
山陽特殊製鋼	1,500	1,876.00	2,814,000
愛知製鋼	1,000	2,113.00	2,113,000
日立金属	18,800	2,055.00	38,634,000
日本金属	500	1,128.00	564,000
大平洋金属	1,100	2,365.00	2,601,500
新日本電工	9,800	357.00	3,498,600
栗本鐵工所	600	1,642.00	985,200
虹技	300	972.00	291,600
日本鑄鉄管	200	993.00	198,600
三菱製鋼	1,200	941.00	1,129,200
日亜鋼業	1,800	257.00	462,600
日本精線	300	4,455.00	1,336,500
エンビプロ・ホールディングス	1,200	743.00	891,600
シンニッタン	1,800	220.00	396,000
新家工業	400	1,426.00	570,400
大紀アルミニウム工業所	2,200	1,194.00	2,626,800
日本軽金属ホールディングス	4,300	1,551.00	6,669,300
三井金属鉱業	4,700	3,075.00	14,452,500
東邦亜鉛	900	2,126.00	1,913,400
三菱マテリアル	10,000	1,952.00	19,520,000
住友金属鉱山	19,100	4,009.00	76,571,900
DOWAホールディングス	4,100	4,610.00	18,901,000
古河機械金属	2,600	1,208.00	3,140,800
エス・サイエンス	11,600	26.00	301,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,100	2,880.00	6,048,000

東邦チタニウム	3,200	2,307.00	7,382,400	
U A C J	2,400	2,141.00	5,138,400	
C Kサンエツ	300	4,145.00	1,243,500	
古河電気工業	5,000	2,273.00	11,365,000	
住友電気工業	60,600	1,491.00	90,354,600	
フジクラ	19,600	786.00	15,405,600	
昭和電線ホールディングス	1,600	1,546.00	2,473,600	
タツタ電線	3,100	459.00	1,422,900	
カナレ電気	400	1,519.00	607,600	
平河ヒューテック	1,100	1,071.00	1,178,100	
リョービ	1,800	1,056.00	1,900,800	
アーレスティ	2,000	366.00	732,000	
アサヒホールディングス	7,000	2,034.00	14,238,000	
稲葉製作所	900	1,373.00	1,235,700	
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	4,400	1,236.00	5,438,400	
アルファC o	600	998.00	598,800	
S U M C O	28,700	1,769.00	50,770,300	
川田テクノロジーズ	300	3,640.00	1,092,000	
R S Technologies	600	5,810.00	3,486,000	
ジェイテックコーポレーション	300	2,042.00	612,600	
信和	1,200	779.00	934,800	
東洋製罐グループホールディングス	8,900	1,464.00	13,029,600	
ホッカンホールディングス	800	1,265.00	1,012,000	
コロナ	700	842.00	589,400	
横河ブリッジホールディングス	2,500	1,963.00	4,907,500	
駒井ハルテック	300	1,666.00	499,800	
高田機工	100	2,402.00	240,200	
三和ホールディングス	16,500	1,310.00	21,615,000	
文化シャッター	5,100	1,006.00	5,130,600	
三協立山	2,100	634.00	1,331,400	
アルインコ	1,200	877.00	1,052,400	
東洋シャッター	600	553.00	331,800	
L I X I L	27,400	2,654.00	72,719,600	
日本ファイルコン	1,100	490.00	539,000	
ノーリツ	2,800	1,465.00	4,102,000	

長府製作所	1,800	1,789.00	3,220,200
リンナイ	3,000	9,760.00	29,280,000
ダイニチ工業	800	644.00	515,200
日東精工	2,000	497.00	994,000
三洋工業	200	1,651.00	330,200
岡部	2,700	616.00	1,663,200
ジーテクト	1,800	1,336.00	2,404,800
東プレ	2,600	1,068.00	2,776,800
高周波熱錬	2,700	671.00	1,811,700
東京製綱	1,100	944.00	1,038,400
サンコール	1,700	616.00	1,047,200
モリテック スチール	1,400	271.00	379,400
パイオラックス	2,400	1,986.00	4,766,400
エイチワン	1,500	612.00	918,000
日本発條	14,800	907.00	13,423,600
中央発條	700	703.00	492,100
アドバネクス	300	1,072.00	321,600
立川ブラインド工業	700	1,058.00	740,600
三益半導体工業	1,300	1,955.00	2,541,500
日本ドライケミカル	400	1,635.00	654,000
日本製鋼所	4,500	3,065.00	13,792,500
三浦工業	6,800	3,140.00	21,352,000
タクマ	4,900	1,350.00	6,615,000
ツガミ	3,500	1,104.00	3,864,000
オークマ	1,700	5,080.00	8,636,000
芝浦機械	2,000	2,721.00	5,442,000
アマダ	27,300	1,037.00	28,310,100
アイダエンジニアリング	3,800	911.00	3,461,800
滝澤鉄工所	600	1,158.00	694,800
F U J I	6,900	1,975.00	13,627,500
牧野フライス製作所	1,800	4,500.00	8,100,000
オーエスジー	7,600	1,638.00	12,448,800
ダイジェット工業	300	924.00	277,200
旭ダイヤモンド工業	4,400	619.00	2,723,600
D M G 森精機	9,700	1,644.00	15,946,800
ソディック	3,800	805.00	3,059,000

ディスコ	2,600	30,700.00	79,820,000
日東工器	800	1,534.00	1,227,200
日進工具	1,400	1,265.00	1,771,000
パンチ工業	1,400	446.00	624,400
富士ダイス	900	662.00	595,800
豊和工業	1,100	865.00	951,500
ニデックオーケーケー	700	1,212.00	848,400
東洋機械金属	1,200	557.00	668,400
島精機製作所	2,600	2,121.00	5,514,600
オプトラン	2,200	1,883.00	4,142,600
NCホールディングス	500	2,089.00	1,044,500
イワキポンプ	1,200	970.00	1,164,000
フリー	1,600	1,087.00	1,739,200
ヤマシンフィルタ	2,800	333.00	932,400
日阪製作所	1,700	825.00	1,402,500
やまびこ	3,000	1,175.00	3,525,000
野村マイクロ・サイエンス	600	3,345.00	2,007,000
平田機工	800	4,440.00	3,552,000
ペガサスマシン製造	1,900	602.00	1,143,800
マルマエ	700	1,913.00	1,339,100
タツモ	900	1,147.00	1,032,300
ナブテスコ	9,300	3,180.00	29,574,000
三井海洋開発	2,000	1,178.00	2,356,000
レオン自動機	1,900	1,308.00	2,485,200
S M C	5,200	61,630.00	320,476,000
ホソカワミクロン	1,100	2,708.00	2,978,800
ユニオンツール	600	3,230.00	1,938,000
オイレス工業	2,200	1,601.00	3,522,200
日精エー・エス・ビー機械	700	3,460.00	2,422,000
サトーホールディングス	2,400	1,903.00	4,567,200
技研製作所	1,500	3,020.00	4,530,000
日本エアージェット	800	1,016.00	812,800
カワタ	600	976.00	585,600
日精樹脂工業	1,100	908.00	998,800
オカダアイヨン	600	1,467.00	880,200
ワイエイシイホールディングス	700	1,498.00	1,048,600

小松製作所	79,800	2,900.00	231,420,000
住友重機械工業	9,400	3,000.00	28,200,000
日立建機	7,100	2,859.00	20,298,900
日工	2,000	634.00	1,268,000
巴工業	600	2,435.00	1,461,000
井関農機	1,300	1,181.00	1,535,300
T O W A	1,500	1,719.00	2,578,500
丸山製作所	200	1,518.00	303,600
北川鉄工所	600	1,405.00	843,000
ローツェ	900	7,920.00	7,128,000
タカキタ	500	498.00	249,000
クボタ	85,300	2,164.00	184,589,200
荏原実業	800	2,242.00	1,793,600
三菱化工機	400	2,034.00	813,600
月島機械	2,700	867.00	2,340,900
帝国電機製作所	1,200	1,758.00	2,109,600
新東工業	3,100	705.00	2,185,500
澁谷工業	1,300	2,418.00	3,143,400
アイチ コーポレーション	2,300	860.00	1,978,000
小森コーポレーション	4,000	819.00	3,276,000
鶴見製作所	1,300	2,017.00	2,622,100
住友精密工業	300	2,669.00	800,700
日本ギア工業	900	299.00	269,100
酒井重工業	300	2,906.00	871,800
荏原製作所	7,000	5,000.00	35,000,000
石井鐵工所	200	2,935.00	587,000
西島製作所	1,600	1,338.00	2,140,800
北越工業	1,400	891.00	1,247,400
ダイキン工業	19,200	22,355.00	429,216,000
オルガノ	500	8,660.00	4,330,000
トーヨーカネツ	600	2,677.00	1,606,200
栗田工業	8,900	4,940.00	43,966,000
椿本チエイン	2,300	3,065.00	7,049,500
大同工業	700	789.00	552,300
木村化工機	1,400	752.00	1,052,800
アネスト岩田	2,800	948.00	2,654,400

ダイフク	8,300	8,430.00	69,969,000
サムコ	500	2,739.00	1,369,500
加藤製作所	1,000	788.00	788,000
油研工業	200	1,776.00	355,200
タダノ	8,500	940.00	7,990,000
フジテック	5,400	3,030.00	16,362,000
C K D	4,400	1,762.00	7,752,800
キトー	1,400	2,625.00	3,675,000
平和	4,900	2,051.00	10,049,900
理想科学工業	1,600	2,383.00	3,812,800
S A N K Y O	3,600	4,145.00	14,922,000
日本金銭機械	2,100	676.00	1,419,600
マースグループホールディングス	1,100	1,620.00	1,782,000
フクシマガリレイ	1,100	3,505.00	3,855,500
オーイズミ	900	396.00	356,400
ダイコク電機	800	1,254.00	1,003,200
竹内製作所	2,700	2,438.00	6,582,600
アマノ	4,700	2,433.00	11,435,100
J U K I	2,600	723.00	1,879,800
サンデン	2,900	259.00	751,100
ジャノメ	1,500	722.00	1,083,000
マックス	2,100	1,645.00	3,454,500
グローリー	4,300	2,136.00	9,184,800
新晃工業	1,600	1,655.00	2,648,000
大和冷機工業	2,500	1,105.00	2,762,500
セガサミーホールディングス	15,800	2,161.00	34,143,800
日本ピストンリング	700	1,269.00	888,300
リケン	700	2,418.00	1,692,600
T P R	1,800	1,255.00	2,259,000
ツバキ・ナカシマ	3,900	931.00	3,630,900
ホシザキ	10,300	3,915.00	40,324,500
大豊工業	1,400	676.00	946,400
日本精工	30,100	735.00	22,123,500
N T N	32,700	253.00	8,273,100
ジェイテクト	15,000	1,024.00	15,360,000
不二越	1,200	3,575.00	4,290,000

日本トムソン	4,000	509.00	2,036,000	
T H K	9,900	2,661.00	26,343,900	
ユーシン精機	1,300	706.00	917,800	
前澤給装工業	1,200	904.00	1,084,800	
イーグル工業	1,900	1,013.00	1,924,700	
前澤工業	1,000	620.00	620,000	
日本ピラー工業	1,500	2,561.00	3,841,500	
キット	4,900	677.00	3,317,300	
マキタ	19,900	3,457.00	68,794,300	
三井E & Sホールディングス	6,900	336.00	2,318,400	
日立造船	14,100	829.00	11,688,900	
三菱重工業	25,900	5,003.00	129,577,700	
I H I	11,000	3,670.00	40,370,000	
スター精密	2,400	1,655.00	3,972,000	
日清紡ホールディングス	10,200	1,048.00	10,689,600	
イビデン	8,500	3,920.00	33,320,000	
コニカミノルタ	36,300	457.00	16,589,100	
ブラザー工業	20,200	2,399.00	48,459,800	
ミネベアミツミ	28,100	2,322.00	65,248,200	
日立製作所	84,800	6,570.00	557,136,000	
東芝	30,800	5,301.00	163,270,800	
三菱電機	164,300	1,444.00	237,249,200	
富士電機	9,800	5,460.00	53,508,000	
東洋電機製造	600	906.00	543,600	
安川電機	17,500	4,315.00	75,512,500	
シンフォニアテクノロジー	1,800	1,416.00	2,548,800	
明電舎	2,500	2,124.00	5,310,000	
オリジン	500	1,169.00	584,500	
山洋電気	700	5,180.00	3,626,000	
デンヨー	1,200	1,582.00	1,898,400	
P H Cホールディングス	2,700	1,465.00	3,955,500	
東芝テック	1,900	4,240.00	8,056,000	
芝浦メカトロニクス	300	9,600.00	2,880,000	
マブチモーター	4,100	3,750.00	15,375,000	
日本電産	39,100	9,312.00	364,099,200	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	800	451.00	360,800	

トレックス・セミコンダクター	800	2,515.00	2,012,000	
東光高岳	1,000	1,771.00	1,771,000	
ダブル・スコープ	4,900	1,687.00	8,266,300	
ダイヘン	1,600	4,015.00	6,424,000	
ヤーマン	2,900	1,674.00	4,854,600	
JVCケンウッド	15,700	173.00	2,716,100	
ミマキエンジニアリング	1,700	553.00	940,100	
I - P E X	900	1,319.00	1,187,100	
日新電機	4,100	1,487.00	6,096,700	
大崎電気工業	2,800	512.00	1,433,600	
オムロン	14,700	7,009.00	103,032,300	
日東工業	2,300	2,394.00	5,506,200	
I D E C	2,200	2,748.00	6,045,600	
正興電機製作所	500	1,173.00	586,500	
不二電機工業	500	1,146.00	573,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,300	2,245.00	11,898,500	
サクサホールディングス	400	1,252.00	500,800	
メルコホールディングス	500	3,685.00	1,842,500	
テクノメディカ	400	1,564.00	625,600	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	500	1,910.00	955,000	
日本電気	20,900	5,280.00	110,352,000	
富士通	15,800	17,705.00	279,739,000	
沖電気工業	6,700	747.00	5,004,900	
岩崎通信機	700	796.00	557,200	
電気興業	900	2,466.00	2,219,400	
サンケン電気	1,500	4,815.00	7,222,500	
ナカヨ	200	1,100.00	220,000	
アイホン	800	1,815.00	1,452,000	
ルネサスエレクトロニクス	95,900	1,244.00	119,299,600	
セイコーエプソン	19,800	1,974.00	39,085,200	
ワコム	13,600	847.00	11,519,200	
アルバック	3,500	4,730.00	16,555,000	
アクセル	700	868.00	607,600	
E I Z O	1,200	3,805.00	4,566,000	
ジャパンディスプレイ	59,600	66.00	3,933,600	

日本信号	3,600	970.00	3,492,000	
京三製作所	3,500	437.00	1,529,500	
能美防災	1,900	1,835.00	3,486,500	
ホーチキ	1,100	1,295.00	1,424,500	
星和電機	900	458.00	412,200	
エレコム	4,000	1,646.00	6,584,000	
パナソニック ホールディングス	188,000	1,124.00	211,312,000	
シャープ	16,900	1,065.00	17,998,500	
アンリツ	11,400	1,500.00	17,100,000	
富士通ゼネラル	4,900	2,768.00	13,563,200	
ソニーグループ	110,400	11,465.00	1,265,736,000	代用有価証券 30,000株
T D K	25,500	3,990.00	101,745,000	
帝国通信工業	800	1,413.00	1,130,400	
タムラ製作所	6,700	587.00	3,932,900	
アルプスアルパイン	14,600	1,296.00	18,921,600	
池上通信機	600	602.00	361,200	
鈴木	900	782.00	703,800	
メイコー	1,900	3,140.00	5,966,000	
日本トリム	400	2,419.00	967,600	
ローランド ディー . ジー .	1,100	3,055.00	3,360,500	
フォスター電機	1,900	747.00	1,419,300	
S M K	500	2,140.00	1,070,000	
ヨコオ	1,200	1,934.00	2,320,800	
ホシデン	4,000	1,283.00	5,132,000	
ヒロセ電機	2,400	18,120.00	43,488,000	
日本航空電子工業	3,600	2,150.00	7,740,000	
T O A	2,100	792.00	1,663,200	
マクセル	3,400	1,402.00	4,766,800	
古野電気	2,200	1,094.00	2,406,800	
ユニデンホールディングス	400	4,110.00	1,644,000	
スミダコーポレーション	1,800	797.00	1,434,600	
アイコム	600	2,489.00	1,493,400	
リオン	700	2,337.00	1,635,900	
本多通信工業	2,000	516.00	1,032,000	
横河電機	16,200	2,249.00	36,433,800	

新電元工業	700	3,470.00	2,429,000
アズビル	10,200	3,815.00	38,913,000
東亜ディーケーケー	900	899.00	809,100
日本光電工業	6,800	2,952.00	20,073,600
チノー	600	1,662.00	997,200
共和電業	1,400	328.00	459,200
日本電子材料	900	1,633.00	1,469,700
堀場製作所	3,000	6,140.00	18,420,000
アドバンテスト	13,100	7,220.00	94,582,000
小野測器	800	435.00	348,000
エスベック	1,300	1,785.00	2,320,500
キーエンス	16,000	52,170.00	834,720,000
日置電機	900	5,960.00	5,364,000
シスメックス	12,600	8,980.00	113,148,000
日本マイクロニクス	2,600	1,215.00	3,159,000
メガチップス	1,500	3,075.00	4,612,500
O B A R A G R O U P	700	3,050.00	2,135,000
澤藤電機	200	1,395.00	279,000
原田工業	1,000	888.00	888,000
コーセル	2,200	849.00	1,867,800
イリソ電子工業	1,500	3,040.00	4,560,000
オブテックスグループ	2,900	2,049.00	5,942,100
千代田インテグレ	800	1,996.00	1,596,800
レーザーテック	7,200	17,420.00	125,424,000
スタンレー電気	11,400	2,360.00	26,904,000
岩崎電気	600	2,591.00	1,554,600
ウシオ電機	8,400	1,735.00	14,574,000
岡谷電機産業	1,900	241.00	457,900
ヘリオス テクノ ホールディング	1,900	329.00	625,100
エノモト	600	1,502.00	901,200
日本セラミック	1,800	2,022.00	3,639,600
遠藤照明	900	767.00	690,300
古河電池	1,300	1,225.00	1,592,500
双信電機	1,100	493.00	542,300
山一電機	1,300	1,630.00	2,119,000
図研	1,100	3,305.00	3,635,500

日本電子	3,400	5,420.00	18,428,000
カシオ計算機	11,100	1,249.00	13,863,900
ファナック	15,500	21,465.00	332,707,500
日本シイエムケイ	3,500	434.00	1,519,000
エンプラス	500	2,926.00	1,463,000
大真空	2,300	871.00	2,003,300
ローム	7,300	9,510.00	69,423,000
浜松ホトニクス	11,800	5,820.00	68,676,000
三井ハイテック	1,500	8,270.00	12,405,000
新光電気工業	5,200	3,420.00	17,784,000
京セラ	24,800	7,122.00	176,625,600
太陽誘電	7,900	4,585.00	36,221,500
村田製作所	48,100	7,512.00	361,327,200
双葉電子工業	3,200	690.00	2,208,000
北陸電気工業	800	1,075.00	860,000
ニチコン	4,800	1,208.00	5,798,400
日本ケミコン	1,700	1,713.00	2,912,100
K O A	2,600	1,668.00	4,336,800
市光工業	2,000	378.00	756,000
小糸製作所	8,800	4,570.00	40,216,000
ミツバ	2,800	426.00	1,192,800
S C R E E Nホールディングス	2,800	9,060.00	25,368,000
キヤノン電子	1,800	1,539.00	2,770,200
キヤノン	87,600	3,143.00	275,326,800
リコー	42,100	1,056.00	44,457,600
象印マホービン	4,500	1,487.00	6,691,500
M U T O Hホールディングス	300	2,048.00	614,400
東京エレクトロン	11,200	43,000.00	481,600,000
トヨタ紡織	6,200	2,065.00	12,803,000
芦森工業	400	1,005.00	402,000
ユニプレス	3,000	875.00	2,625,000
豊田自動織機	12,400	8,100.00	100,440,000
モリタホールディングス	2,800	1,352.00	3,785,600
三櫻工業	2,500	720.00	1,800,000
デンソー	34,500	7,574.00	261,303,000
東海理化電機製作所	4,600	1,518.00	6,982,800

川崎重工業	12,000	2,579.00	30,948,000
名村造船所	4,800	428.00	2,054,400
日本車輛製造	600	2,084.00	1,250,400
三菱ロジスネクスト	2,400	906.00	2,174,400
近畿車輛	300	1,061.00	318,300
日産自動車	208,000	515.90	107,307,200
いすゞ自動車	51,100	1,483.00	75,781,300
トヨタ自動車	803,300	2,177.00	1,748,784,100
日野自動車	22,000	731.00	16,082,000
三菱自動車工業	65,600	447.00	29,323,200
エフテック	1,200	516.00	619,200
レシップホールディングス	900	525.00	472,500
G M B	300	681.00	204,300
ファルテック	300	598.00	179,400
武蔵精密工業	3,900	1,459.00	5,690,100
日産車体	2,500	610.00	1,525,000
新明和工業	4,700	1,059.00	4,977,300
極東開発工業	2,800	1,450.00	4,060,000
トピー工業	1,400	1,308.00	1,831,200
ティラド	500	2,549.00	1,274,500
タチエス	2,900	1,140.00	3,306,000
N O K	6,600	1,215.00	8,019,000
フタバ産業	4,200	396.00	1,663,200
K Y B	1,500	3,135.00	4,702,500
大同メタル工業	3,400	541.00	1,839,400
プレス工業	8,100	407.00	3,296,700
ミクニ	2,500	354.00	885,000
太平洋工業	3,400	1,103.00	3,750,200
河西工業	2,600	263.00	683,800
アイシン	12,900	4,205.00	54,244,500
マツダ	52,000	1,095.00	56,940,000
今仙電機製作所	1,200	609.00	730,800
本田技研工業	128,800	3,433.00	442,170,400
スズキ	34,900	4,389.00	153,176,100
S U B A R U	46,400	2,376.50	110,269,600
安永	800	687.00	549,600

ヤマハ発動機	23,000	2,506.00	57,638,000
T B K	1,600	336.00	537,600
エクセディ	2,700	1,789.00	4,830,300
豊田合成	5,000	2,206.00	11,030,000
愛三工業	2,700	711.00	1,919,700
盟和産業	300	999.00	299,700
日本プラスト	1,400	460.00	644,000
ヨロズ	1,400	886.00	1,240,400
エフ・シー・シー	2,900	1,418.00	4,112,200
シマノ	6,500	22,060.00	143,390,000
テイ・エス テック	7,500	1,503.00	11,272,500
ジャムコ	1,200	1,233.00	1,479,600
テルモ	49,800	4,320.00	215,136,000
クリエートメディック	400	971.00	388,400
日機装	4,600	806.00	3,707,600
日本エム・ディ・エム	1,000	1,630.00	1,630,000
島津製作所	21,100	4,505.00	95,055,500
J M S	1,200	551.00	661,200
長野計器	1,200	1,133.00	1,359,600
ブイ・テクノロジー	800	2,928.00	2,342,400
東京計器	1,200	1,277.00	1,532,400
愛知時計電機	700	1,445.00	1,011,500
インターアクション	900	1,856.00	1,670,400
オーバル	1,800	388.00	698,400
東京精密	2,700	4,490.00	12,123,000
マニー	6,400	1,562.00	9,996,800
ニコン	24,900	1,469.00	36,578,100
トプコン	8,300	1,864.00	15,471,200
オリンパス	85,300	2,744.50	234,105,850
理研計器	1,200	3,925.00	4,710,000
タムロン	1,300	2,703.00	3,513,900
H O Y A	34,000	12,550.00	426,700,000
シード	900	508.00	457,200
ノーリツ鋼機	1,600	2,352.00	3,763,200
A & D ホロンホールディングス	2,100	913.00	1,917,300
朝日インテック	19,400	2,394.00	46,443,600

シチズン時計	17,800	551.00	9,807,800
リズム	600	1,669.00	1,001,400
大研医器	1,400	480.00	672,000
メニコン	5,500	3,215.00	17,682,500
シンシア	200	416.00	83,200
松風	600	1,718.00	1,030,800
セイコーホールディングス	2,600	2,821.00	7,334,600
ニプロ	12,200	1,131.00	13,798,200
中本パックス	500	1,600.00	800,000
スノーピーク	2,300	2,507.00	5,766,100
パラマウントベッドホールディングス	3,300	2,355.00	7,771,500
トランザクション	1,100	1,032.00	1,135,200
粧美堂	700	393.00	275,100
ニホンフラッシュ	1,500	939.00	1,408,500
前田工織	1,600	3,020.00	4,832,000
永大産業	2,000	263.00	526,000
アートネイチャー	1,400	752.00	1,052,800
バンダイナムコホールディングス	14,600	9,789.00	142,919,400
アイフィスジャパン	500	615.00	307,500
共立印刷	2,800	146.00	408,800
S H O E I	1,600	5,550.00	8,880,000
フランスベッドホールディングス	2,300	917.00	2,109,100
パイロットコーポレーション	2,500	4,930.00	12,325,000
萩原工業	1,000	1,103.00	1,103,000
フジシールインターナショナル	3,600	1,473.00	5,302,800
タカラトミー	7,500	1,419.00	10,642,500
広済堂ホールディングス	1,200	1,028.00	1,233,600
エステールホールディングス	500	623.00	311,500
タカノ	800	822.00	657,600
プロネクサス	1,300	1,094.00	1,422,200
ホクシン	1,700	147.00	249,900
ウッドワン	600	1,172.00	703,200
大建工業	900	1,920.00	1,728,000
凸版印刷	23,000	2,210.00	50,830,000
大日本印刷	19,100	2,818.00	53,823,800
共同印刷	400	2,533.00	1,013,200

N I S S H A	3,100	1,510.00	4,681,000	
光村印刷	200	1,226.00	245,200	
T A K A R A & C O M P A N Y	1,000	1,869.00	1,869,000	
アシックス	13,600	2,526.00	34,353,600	
ツツミ	400	2,136.00	854,400	
ローランド	1,200	3,990.00	4,788,000	
小松ウオール工業	500	1,991.00	995,500	
ヤマハ	10,300	5,470.00	56,341,000	
河合楽器製作所	500	2,696.00	1,348,000	
クリナップ	1,500	579.00	868,500	
ピジョン	10,700	1,917.00	20,511,900	
兼松サステック	200	1,608.00	321,600	
キングジム	1,600	900.00	1,440,000	
リンテック	3,300	2,293.00	7,566,900	
イトーキ	3,600	384.00	1,382,400	
任天堂	9,900	60,440.00	598,356,000	
三菱鉛筆	2,400	1,468.00	3,523,200	
タカラスタANDARD	2,800	1,343.00	3,760,400	
コクヨ	7,800	1,766.00	13,774,800	
ナカバヤシ	1,000	504.00	504,000	
オカムラ	5,000	1,274.00	6,370,000	
美津濃	1,500	2,448.00	3,672,000	
東京電力ホールディングス	132,200	575.00	76,015,000	
中部電力	49,700	1,386.00	68,884,200	
関西電力	61,700	1,363.00	84,097,100	
中国電力	25,500	891.00	22,720,500	
北陸電力	14,800	547.00	8,095,600	
東北電力	38,600	736.00	28,409,600	
四国電力	14,800	805.00	11,914,000	
九州電力	33,800	897.00	30,318,600	
北海道電力	15,100	512.00	7,731,200	
沖縄電力	3,700	1,320.00	4,884,000	
電源開発	13,100	2,257.00	29,566,700	
エフオン	1,100	571.00	628,100	
イーレックス	2,300	2,283.00	5,250,900	
レノバ	3,500	2,427.00	8,494,500	

東京瓦斯	31,400	2,544.00	79,881,600
大阪瓦斯	29,600	2,371.00	70,181,600
東邦瓦斯	6,900	2,917.00	20,127,300
北海道瓦斯	800	1,616.00	1,292,800
広島ガス	2,300	322.00	740,600
西部ガスホールディングス	1,700	1,852.00	3,148,400
静岡ガス	4,100	933.00	3,825,300
メタウォーター	1,800	1,993.00	3,587,400
SBSホールディングス	1,300	2,715.00	3,529,500
東武鉄道	16,100	3,045.00	49,024,500
相鉄ホールディングス	5,300	2,277.00	12,068,100
東急	41,000	1,582.00	64,862,000
京浜急行電鉄	19,800	1,416.00	28,036,800
小田急電鉄	22,200	1,789.00	39,715,800
京王電鉄	7,700	4,815.00	37,075,500
京成電鉄	10,400	3,470.00	36,088,000
富士急行	1,800	3,880.00	6,984,000
東日本旅客鉄道	26,900	6,707.00	180,418,300
西日本旅客鉄道	18,700	4,743.00	88,694,100
東海旅客鉄道	12,400	15,095.00	187,178,000
西武ホールディングス	21,400	1,253.00	26,814,200
鴻池運輸	2,500	1,294.00	3,235,000
西日本鉄道	4,300	2,803.00	12,052,900
ハマキョウレックス	1,100	3,065.00	3,371,500
サカイ引越センター	800	4,875.00	3,900,000
近鉄グループホールディングス	15,700	4,155.00	65,233,500
阪急阪神ホールディングス	19,500	3,675.00	71,662,500
南海電気鉄道	7,000	2,511.00	17,577,000
京阪ホールディングス	6,500	3,250.00	21,125,000
神戸電鉄	400	3,290.00	1,316,000
名古屋鉄道	16,200	2,057.00	33,323,400
山陽電気鉄道	1,200	2,196.00	2,635,200
アルプス物流	1,200	1,156.00	1,387,200
ヤマトホールディングス	23,400	2,243.00	52,486,200
山九	4,000	4,015.00	16,060,000
丸運	500	229.00	114,500

丸全昭和運輸	1,100	3,205.00	3,525,500
センコーグループホールディングス	7,800	894.00	6,973,200
トナミホールディングス	300	3,570.00	1,071,000
ニッコンホールディングス	5,000	2,294.00	11,470,000
日本石油輸送	100	2,445.00	244,500
福山通運	2,100	3,115.00	6,541,500
セイノーホールディングス	9,000	1,106.00	9,954,000
エスライン	400	853.00	341,200
神奈川中央交通	400	3,535.00	1,414,000
日立物流	3,200	8,560.00	27,392,000
丸和運輸機関	2,900	1,369.00	3,970,100
C & F ロジホールディングス	1,400	1,111.00	1,555,400
九州旅客鉄道	11,200	2,723.00	30,497,600
S Gホールディングス	28,000	2,486.00	69,608,000
NIPPON EXPRESSホールディングス	4,900	7,560.00	37,044,000
日本郵船	14,000	9,860.00	138,040,000
商船三井	25,800	3,320.00	85,656,000
川崎汽船	5,100	8,620.00	43,962,000
NSユナイテッド海運	800	3,895.00	3,116,000
飯野海運	6,700	692.00	4,636,400
乾汽船	1,100	1,798.00	1,977,800
日本航空	36,000	2,244.00	80,784,000
ANAホールディングス	39,800	2,427.50	96,614,500
パスコ	300	1,334.00	400,200
ランコム	500	7,260.00	3,630,000
日新	1,200	1,616.00	1,939,200
三菱倉庫	4,000	3,320.00	13,280,000
三井倉庫ホールディングス	1,700	3,000.00	5,100,000
住友倉庫	4,900	1,990.00	9,751,000
澁澤倉庫	800	2,120.00	1,696,000
東陽倉庫	2,400	290.00	696,000
日本トランスシティ	2,900	496.00	1,438,400
ケイヒン	300	1,342.00	402,600
中央倉庫	800	971.00	776,800
川西倉庫	400	1,036.00	414,400

安田倉庫	1,100	928.00	1,020,800
ファイブホールディングス	500	700.00	350,000
東洋埠頭	500	1,288.00	644,000
上組	8,000	2,680.00	21,440,000
サンリツ	400	703.00	281,200
キムラユニティ	1,000	772.00	772,000
キューソー流通システム	900	1,225.00	1,102,500
近鉄エクスプレス	3,200	4,165.00	13,328,000
東海運	1,000	278.00	278,000
エーアイティー	1,100	1,854.00	2,039,400
内外トランスライン	700	1,934.00	1,353,800
日本コンセプト	600	1,404.00	842,400
NEC ネットエスアイ	5,600	1,905.00	10,668,000
クロスキャット	1,100	1,008.00	1,108,800
システナ	24,600	441.00	10,848,600
デジタルアーツ	900	5,910.00	5,319,000
日鉄ソリューションズ	3,000	3,690.00	11,070,000
キューブシステム	800	1,019.00	815,200
WOW WORLD	200	1,008.00	201,600
コア	700	1,464.00	1,024,800
手間いらず	300	5,020.00	1,506,000
ラクーンホールディングス	1,500	1,467.00	2,200,500
ソリトンシステムズ	900	1,263.00	1,136,700
ソフトクリエイトホールディングス	800	4,085.00	3,268,000
T I S	15,100	3,575.00	53,982,500
J N Sホールディングス	1,000	395.00	395,000
グリー	8,000	824.00	6,592,000
GMOベパボ	100	1,984.00	198,400
コーエーテクモホールディングス	5,500	4,680.00	25,740,000
三菱総合研究所	700	4,165.00	2,915,500
ボルテージ	600	342.00	205,200
電算	100	2,160.00	216,000
A G S	700	744.00	520,800
ファインデックス	1,500	659.00	988,500
ブレインパッド	1,500	1,150.00	1,725,000
K L a b	3,200	480.00	1,536,000

ポルトウウィンホールディングス	2,500	962.00	2,405,000
ネクソン	39,400	2,833.00	111,620,200
アイスタイル	4,700	259.00	1,217,300
エムアップホールディングス	2,100	1,372.00	2,881,200
エイチーム	1,100	719.00	790,900
エニグモ	1,900	526.00	999,400
テクノスジャパン	1,300	468.00	608,400
コロプラ	5,700	642.00	3,659,400
オルトプラス	1,500	355.00	532,500
ブロードリーフ	8,700	438.00	3,810,600
クロス・マーケティンググループ	800	715.00	572,000
デジタルハーツホールディングス	800	1,839.00	1,471,200
システム情報	1,300	960.00	1,248,000
メディアドゥ	600	2,042.00	1,225,200
じげん	5,100	336.00	1,713,600
ブイキューブ	1,800	1,233.00	2,219,400
エンカレッジ・テクノロジー	400	507.00	202,800
サイバーリンクス	600	1,078.00	646,800
フィックスターズ	1,800	965.00	1,737,000
CARTA HOLDINGS	700	1,912.00	1,338,400
オブティム	1,100	785.00	863,500
セレス	700	1,181.00	826,700
SHIFT	1,100	17,950.00	19,745,000
ティーガイア	1,400	1,652.00	2,312,800
セック	300	2,434.00	730,200
テクマトリックス	2,900	1,762.00	5,109,800
プロシップ	600	1,599.00	959,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,500	2,475.00	11,137,500
GMOペイメントゲートウェイ	3,300	10,370.00	34,221,000
ザッパラス	700	345.00	241,500
システムリサーチ	500	1,987.00	993,500
インターネットイニシアティブ	4,600	4,950.00	22,770,000
さくらインターネット	1,800	551.00	991,800
ヴィンクス	600	1,351.00	810,600
GMOグローバルサイン・ホールディングス	400	5,570.00	2,228,000
SRAホールディングス	800	2,899.00	2,319,200

システムインテグレータ	700	450.00	315,000
朝日ネット	1,400	580.00	812,000
e B A S E	2,000	531.00	1,062,000
アバント	1,900	1,394.00	2,648,600
アドソル日進	600	1,619.00	971,400
ODKソリューションズ	300	583.00	174,900
フリービット	900	840.00	756,000
コムチュア	2,000	2,779.00	5,558,000
サイバーコム	300	1,292.00	387,600
アステリア	1,300	871.00	1,132,300
アイル	800	1,650.00	1,320,000
マークラインズ	900	2,199.00	1,979,100
メディカル・データ・ビジョン	2,200	1,181.00	2,598,200
g u m i	2,500	637.00	1,592,500
ショーケース	500	414.00	207,000
モバイルファクトリー	400	1,046.00	418,400
テラスカイ	600	1,584.00	950,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	700	1,389.00	972,300
P C Iホールディングス	700	911.00	637,700
パイブドHD	300	2,798.00	839,400
アイピーシー	400	426.00	170,400
ネオジャパン	500	1,143.00	571,500
P R T I M E S	400	2,203.00	881,200
ラクス	7,900	1,731.00	13,674,900
ランドコンピュータ	500	862.00	431,000
ダブルスタンダード	500	1,984.00	992,000
オープンドア	1,100	1,594.00	1,753,400
マイネット	800	498.00	398,400
アカツキ	800	2,600.00	2,080,000
ベネフィットジャパン	100	1,974.00	197,400
U b i c o mホールディングス	500	2,694.00	1,347,000
カナミックネットワーク	2,300	588.00	1,352,400
ノムラシステムコーポレーション	2,000	122.00	244,000
チェンジ	3,600	2,011.00	7,239,600
シンクロ・フード	1,200	373.00	447,600

オークネット	1,000	2,142.00	2,142,000	
キャピタル・アセット・プランニング	300	619.00	185,700	
セグエグループ	400	520.00	208,000	
エイトレッド	200	2,007.00	401,400	
マクロミル	3,400	918.00	3,121,200	
ビーグリー	500	1,244.00	622,000	
オロ	500	1,546.00	773,000	
ユーザーローカル	500	1,590.00	795,000	
テモナ	400	323.00	129,200	
ニーズウェル	600	628.00	376,800	
マネーフォワード	3,500	2,790.00	9,765,000	
サインポスト	600	822.00	493,200	
電算システムホールディングス	700	2,389.00	1,672,300	
ソルクシーズ	1,500	366.00	549,000	
フェイス	400	575.00	230,000	
プロトコーポレーション	1,900	1,080.00	2,052,000	
ハイマックス	500	1,464.00	732,000	
野村総合研究所	30,100	3,895.00	117,239,500	
サイバネットシステム	1,200	874.00	1,048,800	
C Eホールディングス	800	443.00	354,400	
日本システム技術	300	2,578.00	773,400	
インテージホールディングス	2,000	1,355.00	2,710,000	
東邦システムサイエンス	400	927.00	370,800	
ソースネクスト	7,900	231.00	1,824,900	
インフォコム	1,900	2,058.00	3,910,200	
シンプレクス・ホールディングス	2,800	1,678.00	4,698,400	
HEROZ	600	882.00	529,200	
ラクスル	2,100	1,804.00	3,788,400	
I P S	500	2,401.00	1,200,500	
F I G	2,300	308.00	708,400	
システムサポート	600	1,324.00	794,400	
イーソル	1,100	630.00	693,000	
アルテリア・ネットワークス	1,600	1,222.00	1,955,200	
東海ソフト	300	921.00	276,300	
ウイングアーク1st	1,300	1,829.00	2,377,700	

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,541.00	616,400
サーバーワークス	300	2,102.00	630,600
東名	200	1,077.00	215,400
ヴィッツ	200	1,035.00	207,000
トピラシステムズ	500	972.00	486,000
Sansan	5,500	1,196.00	6,578,000
Link-U	400	640.00	256,000
ギフトィ	1,400	1,225.00	1,715,000
ベース	300	5,600.00	1,680,000
JMDC	2,200	6,230.00	13,706,000
フォーカスシステムズ	1,100	911.00	1,002,100
クレスコ	1,300	1,983.00	2,577,900
フジ・メディア・ホールディングス	15,100	1,160.00	17,516,000
オービック	5,400	20,270.00	109,458,000
ジャストシステム	2,400	3,875.00	9,300,000
TDCソフト	1,400	1,089.00	1,524,600
Zホールディングス	249,200	434.70	108,327,240
トレンドマイクロ	8,500	7,170.00	60,945,000
IDホールディングス	900	833.00	749,700
日本オラクル	2,800	8,140.00	22,792,000
アルファシステムズ	500	4,445.00	2,222,500
フューチャー	3,700	1,559.00	5,768,300
CAC Holdings	900	1,378.00	1,240,200
SBテクノロジー	700	2,321.00	1,624,700
トーセ	600	750.00	450,000
オービックビジネスコンサルタント	1,600	4,660.00	7,456,000
伊藤忠テクノソリューションズ	7,800	3,515.00	27,417,000
アイティフォー	2,100	798.00	1,675,800
東計電算	200	6,070.00	1,214,000
エクスネット	200	1,000.00	200,000
大塚商会	9,300	3,960.00	36,828,000
サイボウズ	2,300	1,076.00	2,474,800
電通国際情報サービス	2,100	4,190.00	8,799,000
ACCESS	2,000	792.00	1,584,000
デジタルガレージ	2,800	3,805.00	10,654,000

EMシステムズ	2,900	994.00	2,882,600
ウェザーニューズ	500	7,290.00	3,645,000
C I J	1,200	728.00	873,600
ビジネスエンジニアリング	400	2,400.00	960,000
日本エンタープライズ	1,400	154.00	215,600
WOWOW	700	1,475.00	1,032,500
スカラ	1,500	734.00	1,101,000
インテリジェント ウェイブ	1,100	747.00	821,700
I M A G I C A G R O U P	1,300	800.00	1,040,000
ネットワンシステムズ	6,400	3,140.00	20,096,000
システムソフト	5,500	102.00	561,000
アルゴグラフィックス	1,400	3,265.00	4,571,000
マーベラス	2,700	682.00	1,841,400
エイベックス	3,000	1,495.00	4,485,000
B I P R O G Y	5,400	2,739.00	14,790,600
兼松エレクトロニクス	900	4,050.00	3,645,000
都築電気	700	1,323.00	926,100
T B S ホールディングス	8,400	1,708.00	14,347,200
日本テレビホールディングス	14,300	1,257.00	17,975,100
朝日放送グループホールディングス	1,600	657.00	1,051,200
テレビ朝日ホールディングス	4,000	1,509.00	6,036,000
スカパー J S A Tホールディングス	15,000	548.00	8,220,000
テレビ東京ホールディングス	1,000	1,970.00	1,970,000
日本BS放送	700	1,051.00	735,700
ビジョン	2,800	1,088.00	3,046,400
スマートバリュー	500	458.00	229,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	1,400	2,059.00	2,882,600
コネクシオ	1,500	1,339.00	2,008,500
日本通信	14,100	209.00	2,946,900
クロップス	400	888.00	355,200
日本電信電話	193,900	3,874.00	751,168,600
K D D I	126,200	4,384.00	553,260,800
ソフトバンク	262,100	1,539.50	403,502,950
光通信	2,000	14,630.00	29,260,000
エムティーアイ	1,300	525.00	682,500
G M Oインターネット	6,000	2,474.00	14,844,000

ファイバーゲート	1,000	877.00	877,000
アйдママーケティングコミュニケーション	500	291.00	145,500
KADOKAWA	9,300	3,105.00	28,876,500
学研ホールディングス	2,400	926.00	2,222,400
ゼンリン	2,900	938.00	2,720,200
昭文社ホールディングス	1,100	353.00	388,300
インプレスホールディングス	1,600	209.00	334,400
アイネット	700	1,265.00	885,500
松竹	1,000	12,110.00	12,110,000
東宝	10,200	5,130.00	52,326,000
東映	500	18,720.00	9,360,000
エヌ・ティ・ティ・データ	46,000	1,885.00	86,710,000
ピー・シー・エー	1,100	1,224.00	1,346,400
ビジネスブレイン太田昭和	600	1,471.00	882,600
D T S	3,200	3,290.00	10,528,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,000	6,170.00	49,360,000
シーイーシー	1,900	1,208.00	2,295,200
カブコン	16,300	3,590.00	58,517,000
アイ・エス・ビー	800	1,012.00	809,600
ジャステック	900	1,193.00	1,073,700
S C S K	11,900	2,289.00	27,239,100
日本システムウエア	600	2,381.00	1,428,600
アイネス	1,400	1,582.00	2,214,800
T K C	2,600	3,365.00	8,749,000
富士ソフト	1,700	7,990.00	13,583,000
N S D	5,300	2,486.00	13,175,800
コナミグループ	6,300	7,310.00	46,053,000
福井コンピュータホールディングス	800	3,470.00	2,776,000
J B C Cホールディングス	1,200	1,622.00	1,946,400
ミロク情報サービス	1,500	1,325.00	1,987,500
ソフトバンクグループ	103,800	5,371.00	557,509,800
高千穂交易	700	1,938.00	1,356,600
オルバヘルスケアホールディングス	300	1,575.00	472,500
伊藤忠食品	300	4,895.00	1,468,500
エレマテック	1,500	1,252.00	1,878,000
あらた	1,300	4,055.00	5,271,500

トーメンデバイス	300	5,570.00	1,671,000
東京エレクトロン デバイス	500	5,110.00	2,555,000
フィールズ	1,600	856.00	1,369,600
双日	17,900	1,949.00	34,887,100
アルフレッサ ホールディングス	18,000	1,840.00	33,120,000
横浜冷凍	4,400	913.00	4,017,200
神栄	300	834.00	250,200
ラサ商事	700	953.00	667,100
アルコニックス	2,300	1,294.00	2,976,200
神戸物産	12,000	3,440.00	41,280,000
ハイパー	500	442.00	221,000
あい ホールディングス	2,500	1,614.00	4,035,000
ディーブイエックス	600	1,028.00	616,800
ダイワボウホールディングス	7,300	1,836.00	13,402,800
マクニカ・富士エレホールディングス	4,200	2,633.00	11,058,600
ラクト・ジャパン	600	2,450.00	1,470,000
グリムス	800	1,529.00	1,223,200
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,700	687.00	1,854,900
八洲電機	1,300	1,006.00	1,307,800
メディアスホールディングス	1,000	982.00	982,000
レスターホールディングス	1,600	1,916.00	3,065,600
ジューテックホールディングス	400	1,038.00	415,200
大光	900	702.00	631,800
OCHIホールディングス	400	1,218.00	487,200
TOKAIホールディングス	8,200	886.00	7,265,200
黒谷	600	586.00	351,600
Cominix	300	710.00	213,000
三洋貿易	1,600	999.00	1,598,400
ビューティガレージ	300	2,634.00	790,200
ウイン・パートナーズ	1,200	1,039.00	1,246,800
ミタチ産業	500	776.00	388,000
シップヘルスケアホールディングス	5,000	2,517.00	12,585,000
明治電機工業	500	1,100.00	550,000
デリカフーズホールディングス	900	505.00	454,500
スターティアホールディングス	400	843.00	337,200
コメダホールディングス	3,900	2,260.00	8,814,000

ピーバンドットコム	300	506.00	151,800
アセンテック	600	611.00	366,600
富士興産	500	1,090.00	545,000
協栄産業	200	1,342.00	268,400
フルサト・マルカホールディングス	1,600	2,713.00	4,340,800
ヤマエグループホールディングス	1,000	1,389.00	1,389,000
小野建	1,600	1,388.00	2,220,800
南陽	300	1,791.00	537,300
佐鳥電機	1,300	1,016.00	1,320,800
エコートレーディング	200	562.00	112,400
伯東	1,100	2,536.00	2,789,600
コンドーテック	1,300	1,011.00	1,314,300
中山福	700	312.00	218,400
ナガイレーベン	2,000	1,958.00	3,916,000
三菱食品	1,700	3,485.00	5,924,500
松田産業	1,300	2,026.00	2,633,800
第一興商	3,300	3,660.00	12,078,000
メディバルホールディングス	16,200	1,998.00	32,367,600
S P K	700	1,366.00	956,200
萩原電気ホールディングス	600	1,972.00	1,183,200
アズワン	2,500	6,210.00	15,525,000
スズデン	600	1,960.00	1,176,000
シモジマ	900	988.00	889,200
ドウシシャ	1,700	1,559.00	2,650,300
小津産業	400	1,860.00	744,000
高速	900	1,498.00	1,348,200
たけびし	600	1,490.00	894,000
リックス	400	2,059.00	823,600
丸文	1,400	745.00	1,043,000
ハビネット	1,200	1,591.00	1,909,200
橋本総業ホールディングス	300	2,011.00	603,300
日本ライフライン	5,100	941.00	4,799,100
タカショー	1,400	715.00	1,001,000
I D O M	5,400	718.00	3,877,200
進和	1,000	2,324.00	2,324,000
エスケイジャパン	600	463.00	277,800

ダイترون	700	1,812.00	1,268,400
シークス	2,300	937.00	2,155,100
田中商事	500	569.00	284,500
オーハシテクニカ	900	1,369.00	1,232,100
白銅	600	2,404.00	1,442,400
ダイコー通産	200	1,069.00	213,800
伊藤忠商事	104,000	3,836.00	398,944,000
丸紅	150,300	1,212.50	182,238,750
高島	400	2,602.00	1,040,800
長瀬産業	7,900	1,947.00	15,381,300
蝶理	900	1,965.00	1,768,500
豊田通商	15,400	4,430.00	68,222,000
三共生興	2,200	504.00	1,108,800
兼松	6,000	1,369.00	8,214,000
ツカモトコーポレーション	300	1,076.00	322,800
三井物産	125,700	2,894.00	363,775,800
日本紙パルプ商事	800	4,000.00	3,200,000
カメイ	1,600	1,084.00	1,734,400
東都水産	100	4,660.00	466,000
OUGホールディングス	200	2,763.00	552,600
スターゼン	1,100	2,040.00	2,244,000
山善	6,200	994.00	6,162,800
椿本興業	300	3,685.00	1,105,500
住友商事	102,700	1,861.00	191,124,700
内田洋行	700	4,785.00	3,349,500
三菱商事	113,800	3,922.00	446,323,600
第一実業	700	3,290.00	2,303,000
キヤノンマーケティングジャパン	4,300	2,804.00	12,057,200
西華産業	700	1,660.00	1,162,000
佐藤商事	1,200	1,109.00	1,330,800
菱洋エレクトロ	1,000	2,272.00	2,272,000
東京産業	1,400	717.00	1,003,800
ユアサ商事	1,400	3,565.00	4,991,000
神鋼商事	400	3,820.00	1,528,000
トルク	1,200	194.00	232,800
阪和興業	3,000	2,821.00	8,463,000

正栄食品工業	1,100	3,865.00	4,251,500
カナデン	1,400	1,070.00	1,498,000
菱電商事	1,300	1,625.00	2,112,500
岩谷産業	3,800	5,380.00	20,444,000
ナイス	500	1,658.00	829,000
ニチモウ	300	2,389.00	716,700
極東貿易	600	2,658.00	1,594,800
アステナホールディングス	2,200	432.00	950,400
三愛オブリ	3,800	1,031.00	3,917,800
稲畑産業	3,500	2,305.00	8,067,500
G S Iクレオス	900	1,455.00	1,309,500
明和産業	1,700	751.00	1,276,700
クワザワホールディングス	700	443.00	310,100
ワキタ	3,100	1,099.00	3,406,900
東邦ホールディングス	4,700	2,107.00	9,902,900
サンゲツ	4,200	1,607.00	6,749,400
ミツウロコグループホールディングス	1,800	923.00	1,661,400
シナネンホールディングス	600	3,475.00	2,085,000
伊藤忠エネクス	3,500	1,076.00	3,766,000
サンリオ	4,900	2,955.00	14,479,500
サンワテクノス	1,000	1,312.00	1,312,000
リョーサン	1,800	2,171.00	3,907,800
新光商事	2,500	891.00	2,227,500
トーヨー	800	1,234.00	987,200
三信電気	700	1,529.00	1,070,300
東陽テクニカ	1,600	1,150.00	1,840,000
モスフードサービス	2,300	3,340.00	7,682,000
加賀電子	1,400	3,085.00	4,319,000
ソーダニッカ	1,400	570.00	798,000
立花エレテック	1,100	1,532.00	1,685,200
フォーバル	700	845.00	591,500
P A L T A C	2,400	4,345.00	10,428,000
三谷産業	2,700	312.00	842,400
太平洋興発	600	613.00	367,800
西本W i s m e t t a cホールディングス	400	3,975.00	1,590,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,637.00	163,700

コア商事ホールディングス	1,100	713.00	784,300
国際紙パルプ商事	3,500	505.00	1,767,500
ヤマタネ	800	1,586.00	1,268,800
丸紅建材リース	100	1,918.00	191,800
日鉄物産	1,000	5,060.00	5,060,000
泉州電業	500	5,010.00	2,505,000
トラスコ中山	3,500	1,879.00	6,576,500
オートバックスセブン	5,200	1,414.00	7,352,800
モリト	1,300	744.00	967,200
加藤産業	1,800	3,320.00	5,976,000
北恵	500	785.00	392,500
イノテック	1,000	1,319.00	1,319,000
イエローハット	2,600	1,755.00	4,563,000
J Kホールディングス	1,300	970.00	1,261,000
日伝	1,200	1,946.00	2,335,200
北沢産業	1,300	198.00	257,400
杉本商事	800	2,048.00	1,638,400
因幡電機産業	4,200	2,721.00	11,428,200
東テク	500	3,325.00	1,662,500
ミスミグループ本社	21,800	3,105.00	67,689,000
アルテック	1,100	276.00	303,600
タキヒヨー	400	820.00	328,000
蔵王産業	300	1,868.00	560,400
スズケン	6,200	3,785.00	23,467,000
ジェコス	1,000	833.00	833,000
グローセル	1,800	403.00	725,400
ローソン	3,900	4,690.00	18,291,000
サンエー	1,200	4,220.00	5,064,000
カワチ薬品	1,300	2,135.00	2,775,500
エービーシー・マート	2,700	5,750.00	15,525,000
ハードオフコーポレーション	800	983.00	786,400
アスクル	3,700	1,653.00	6,116,100
ゲオホールディングス	2,100	1,339.00	2,811,900
アダストリア	1,900	2,024.00	3,845,600
ジーフット	1,500	321.00	481,500
シー・ヴィ・エス・バイエリア	400	394.00	157,600

くら寿司	1,800	3,185.00	5,733,000	
キャンドウ	700	2,217.00	1,551,900	
アイケイ	600	410.00	246,000	
パルグループホールディングス	1,600	2,143.00	3,428,800	
エディオン	7,900	1,301.00	10,277,900	
サーラコーポレーション	3,400	722.00	2,454,800	
ワッツ	800	732.00	585,600	
ハローズ	800	3,065.00	2,452,000	
フジオフードグループ本社	1,500	1,364.00	2,046,000	
あみやき亭	400	2,961.00	1,184,400	
大黒天物産	500	5,180.00	2,590,000	
ハニーズホールディングス	1,400	1,251.00	1,751,400	
ファーマライズホールディングス	400	689.00	275,600	
アルペン	1,300	2,075.00	2,697,500	
ハブ	800	528.00	422,400	
クオールホールディングス	2,200	1,401.00	3,082,200	
ジinzホールディングス	900	3,575.00	3,217,500	
ビックカメラ	10,300	1,171.00	12,061,300	
D C Mホールディングス	10,300	1,033.00	10,639,900	
Monotaro	21,900	2,147.00	47,019,300	
東京一番フーズ	600	587.00	352,200	
アークランドサービスホールディングス	1,300	2,145.00	2,788,500	
J.フロント リテイリング	19,400	1,054.00	20,447,600	
ドトール・日レスホールディングス	2,700	1,614.00	4,357,800	
マツキヨココカラ&カンパニー	10,200	4,910.00	50,082,000	
ブロンコピリー	1,000	2,373.00	2,373,000	
Z O Z O	11,900	2,879.00	34,260,100	
トレジャー・ファクトリー	600	1,360.00	816,000	
物語コーポレーション	900	5,440.00	4,896,000	
三越伊勢丹ホールディングス	26,200	1,032.00	27,038,400	
H a m e e	700	987.00	690,900	
マーケットエンタープライズ	200	1,007.00	201,400	
ウエルシアホールディングス	9,200	2,919.00	26,854,800	
クリエイイトSDホールディングス	2,500	3,015.00	7,537,500	
丸善C H Iホールディングス	1,600	373.00	596,800	
ミサワ	400	604.00	241,600	

ティーライフ	300	1,388.00	416,400
シュッピン	1,500	1,277.00	1,915,500
オイシックス・ラ・大地	2,500	1,788.00	4,470,000
ネクステージ	3,600	2,583.00	9,298,800
ジョイフル本田	5,000	1,630.00	8,150,000
鳥貴族ホールディングス	700	2,187.00	1,530,900
ホットランド	1,400	1,338.00	1,873,200
すかいらーくホールディングス	21,300	1,642.00	34,974,600
SFPホールディングス	1,000	1,725.00	1,725,000
綿半ホールディングス	1,200	1,380.00	1,656,000
ヨシックスホールディングス	400	2,281.00	912,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,000	1,120.00	5,600,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	900	1,537.00	1,383,300
B E E N O S	900	2,387.00	2,148,300
あさひ	1,400	1,296.00	1,814,400
日本調剤	1,100	1,343.00	1,477,300
コスモス薬品	1,700	13,740.00	23,358,000
トーエル	800	912.00	729,600
セブン&アイ・ホールディングス	58,200	5,361.00	312,010,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	11,800	1,006.00	11,870,800
ツルハホールディングス	3,800	7,570.00	28,766,000
サンマルクホールディングス	1,400	1,596.00	2,234,400
フェリシモ	400	1,060.00	424,000
トリドールホールディングス	4,400	2,533.00	11,145,200
T O K Y O B A S E	1,800	318.00	572,400
ウイルプラスホールディングス	400	892.00	356,800
J Mホールディングス	1,300	1,628.00	2,116,400
サツドラホールディングス	900	656.00	590,400
アレンザホールディングス	1,100	1,038.00	1,141,800
串カツ田中ホールディングス	600	1,820.00	1,092,000
パロックジャパンリミテッド	1,200	810.00	972,000
クスリのアオキホールディングス	1,500	5,390.00	8,085,000
F O O D & L I F E C O M P A N I E	8,900	2,595.00	23,095,500
メディカルシステムネットワーク	1,500	441.00	661,500
藤久ホールディングス	600	679.00	407,400

はるやまホールディングス	900	437.00	393,300	
ノジマ	2,800	2,970.00	8,316,000	
カップ・クリエイト	2,600	1,469.00	3,819,400	
ライトオン	1,500	744.00	1,116,000	
良品計画	20,000	1,289.00	25,780,000	
パリミキホールディングス	2,100	267.00	560,700	
アドヴァングループ	1,400	797.00	1,115,800	
アルビス	400	2,253.00	901,200	
コナカ	1,900	340.00	646,000	
ハウス オブ ローゼ	200	1,650.00	330,000	
G - 7ホールディングス	1,900	1,435.00	2,726,500	
イオン北海道	2,300	1,058.00	2,433,400	
コジマ	2,900	658.00	1,908,200	
ヒマラヤ	600	983.00	589,800	
コーナン商事	2,500	3,835.00	9,587,500	
エコス	600	1,977.00	1,186,200	
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	34,700	2,038.00	70,718,600	
西松屋チェーン	3,400	1,592.00	5,412,800	
ゼンショーホールディングス	8,500	3,440.00	29,240,000	
幸楽苑ホールディングス	1,200	1,291.00	1,549,200	
ハークスレイ	900	548.00	493,200	
サイゼリヤ	2,600	2,725.00	7,085,000	
V Tホールディングス	6,600	491.00	3,240,600	
魚力	400	2,465.00	986,000	
フジ・コーポレーション	900	1,243.00	1,118,700	
ユナイテッドアローズ	1,900	1,787.00	3,395,300	
ハイデイ日高	2,500	2,135.00	5,337,500	
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	1,400	204.00	285,600	
コロワイド	7,200	1,889.00	13,600,800	
ピーシーデポコーポレーション	2,100	305.00	640,500	
壱番屋	1,200	4,760.00	5,712,000	
P L A N T	400	645.00	258,000	
スギホールディングス	3,400	5,950.00	20,230,000	
薬王堂ホールディングス	900	2,046.00	1,841,400	
スクロール	2,600	928.00	2,412,800	

ヨンドシーホールディングス	1,400	1,775.00	2,485,000
木曽路	2,400	2,219.00	5,325,600
S R S ホールディングス	2,700	872.00	2,354,400
千趣会	3,100	379.00	1,174,900
リテールパートナーズ	2,300	1,200.00	2,760,000
ケーヨー	3,200	945.00	3,024,000
上新電機	1,600	2,020.00	3,232,000
日本瓦斯	8,300	1,955.00	16,226,500
ロイヤルホールディングス	2,800	2,070.00	5,796,000
東天紅	200	901.00	180,200
いなげや	1,600	1,280.00	2,048,000
チヨダ	1,600	832.00	1,331,200
ライフコーポレーション	1,300	2,659.00	3,456,700
リンガーハット	2,100	2,354.00	4,943,400
MrMaxHD	2,100	619.00	1,299,900
AOKIホールディングス	3,400	673.00	2,288,200
オークワ	2,300	859.00	1,975,700
コメリ	2,600	2,665.00	6,929,000
青山商事	3,400	862.00	2,930,800
しまむら	2,000	12,680.00	25,360,000
はせがわ	800	252.00	201,600
高島屋	11,700	1,391.00	16,274,700
松屋	3,000	815.00	2,445,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,600	993.00	7,546,800
近鉄百貨店	500	2,326.00	1,163,000
丸井グループ	12,600	2,317.00	29,194,200
アクシアル リテイリング	1,100	3,420.00	3,762,000
イオン	57,200	2,611.00	149,349,200
イズミ	2,700	3,250.00	8,775,000
平和堂	2,500	1,999.00	4,997,500
フジ	3,800	2,180.00	8,284,000
ヤオコー	2,000	6,410.00	12,820,000
ゼビオホールディングス	2,300	926.00	2,129,800
ケーズホールディングス	14,700	1,402.00	20,609,400
Olympicグループ	800	600.00	480,000
日産東京販売ホールディングス	2,700	276.00	745,200

シルバーライフ	400	1,291.00	516,400
Genky DrugStores	800	3,455.00	2,764,000
ナルミヤ・インターナショナル	500	852.00	426,000
ブックオフグループホールディングス	1,200	997.00	1,196,400
ギフトホールディングス	300	2,405.00	721,500
アインホールディングス	2,100	7,320.00	15,372,000
元気寿司	600	2,532.00	1,519,200
ヤマダホールディングス	61,900	493.00	30,516,700
アークランドサカモト	2,700	1,559.00	4,209,300
ニトリホールディングス	6,900	13,795.00	95,185,500
愛眼	1,000	177.00	177,000
ケーユーホールディングス	900	1,105.00	994,500
吉野家ホールディングス	6,100	2,582.00	15,750,200
松屋フーズホールディングス	900	4,090.00	3,681,000
サガミホールディングス	2,600	1,148.00	2,984,800
関西フードマーケット	1,500	1,238.00	1,857,000
王将フードサービス	1,100	6,910.00	7,601,000
プレナス	1,900	1,985.00	3,771,500
ミニストップ	1,400	1,459.00	2,042,600
アークス	3,000	2,091.00	6,273,000
バローホールディングス	3,500	1,881.00	6,583,500
ベルク	700	5,220.00	3,654,000
大庄	1,200	1,140.00	1,368,000
ファーストリテイリング	2,300	77,540.00	178,342,000
サンドラッグ	6,500	3,005.00	19,532,500
サクスパー ホールディングス	1,800	605.00	1,089,000
ヤマザワ	200	1,426.00	285,200
やまや	300	2,602.00	780,600
ベルーナ	3,700	804.00	2,974,800
島根銀行	600	486.00	291,600
じもとホールディングス	1,300	574.00	746,200
めぶきフィナンシャルグループ	71,300	266.00	18,965,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,100	2,200.00	4,620,000
九州フィナンシャルグループ	30,100	379.00	11,407,900
ゆうちょ銀行	40,800	1,067.00	43,533,600
富山第一銀行	4,300	432.00	1,857,600

コンコルディア・フィナンシャルグループ	86,100	435.00	37,453,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,000	732.00	6,588,000	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,412.00	1,976,800	
第四北越フィナンシャルグループ	2,400	2,495.00	5,988,000	
ひろぎんホールディングス	21,900	609.00	13,337,100	
おきなわフィナンシャルグループ	1,500	2,154.00	3,231,000	
十六フィナンシャルグループ	2,000	2,426.00	4,852,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,500	4,435.00	6,652,500	
プロクレアホールディングス	1,800	2,079.00	3,742,200	
新生銀行	11,400	1,970.00	22,458,000	
あおぞら銀行	9,700	2,690.00	26,093,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,017,100	717.30	729,565,830	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	184,200	502.50	92,560,500	
三井住友トラスト・ホールディングス	28,800	4,197.00	120,873,600	
三井住友フィナンシャルグループ	112,700	4,067.00	458,350,900	代用有価証券 13,000株
千葉銀行	49,100	712.00	34,959,200	
群馬銀行	28,000	372.00	10,416,000	
武蔵野銀行	2,100	1,752.00	3,679,200	
千葉興業銀行	3,800	252.00	957,600	
筑波銀行	7,400	193.00	1,428,200	
七十七銀行	4,700	1,722.00	8,093,400	
秋田銀行	1,100	1,689.00	1,857,900	
山形銀行	1,600	906.00	1,449,600	
岩手銀行	1,100	1,950.00	2,145,000	
東邦銀行	12,800	208.00	2,662,400	
東北銀行	700	963.00	674,100	
ふくおかフィナンシャルグループ	12,600	2,277.00	28,690,200	
静岡銀行	35,800	793.00	28,389,400	
スルガ銀行	15,500	371.00	5,750,500	
八十二銀行	32,200	487.00	15,681,400	
山梨中央銀行	1,800	1,114.00	2,005,200	
大垣共立銀行	2,900	1,718.00	4,982,200	
福井銀行	1,300	1,358.00	1,765,400	
清水銀行	600	1,459.00	875,400	
富山銀行	300	1,759.00	527,700	

滋賀銀行	2,900	2,626.00	7,615,400
南都銀行	2,300	1,999.00	4,597,700
百五銀行	14,100	323.00	4,554,300
京都銀行	5,400	5,450.00	29,430,000
紀陽銀行	4,900	1,385.00	6,786,500
ほくほくフィナンシャルグループ	9,800	822.00	8,055,600
山陰合同銀行	9,700	655.00	6,353,500
中国銀行	12,400	954.00	11,829,600
鳥取銀行	600	1,141.00	684,600
伊予銀行	19,300	619.00	11,946,700
百十四銀行	1,600	1,668.00	2,668,800
四国銀行	2,200	843.00	1,854,600
阿波銀行	2,200	1,997.00	4,393,400
大分銀行	1,000	1,906.00	1,906,000
宮崎銀行	900	2,072.00	1,864,800
佐賀銀行	900	1,471.00	1,323,900
琉球銀行	3,800	801.00	3,043,800
セブン銀行	51,900	259.00	13,442,100
みずほフィナンシャルグループ	208,200	1,561.50	325,104,300
高知銀行	600	678.00	406,800
山口フィナンシャルグループ	17,400	732.00	12,736,800
長野銀行	600	1,253.00	751,800
名古屋銀行	1,100	2,965.00	3,261,500
北洋銀行	21,900	225.00	4,927,500
愛知銀行	600	5,140.00	3,084,000
中京銀行	600	1,669.00	1,001,400
大光銀行	600	1,322.00	793,200
愛媛銀行	2,300	881.00	2,026,300
トマト銀行	400	1,004.00	401,600
京葉銀行	7,400	464.00	3,433,600
栃木銀行	8,200	267.00	2,189,400
北日本銀行	400	1,636.00	654,400
東和銀行	2,800	517.00	1,447,600
福島銀行	2,100	211.00	443,100
大東銀行	700	633.00	443,100
トモニホールディングス	12,500	311.00	3,887,500

フィデアホールディングス	1,600	1,279.00	2,046,400
池田泉州ホールディングス	19,200	201.00	3,859,200
F P G	6,000	943.00	5,658,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,400	1,255.00	1,757,000
マーキュリアホールディングス	1,100	593.00	652,300
S B Iホールディングス	21,500	2,650.00	56,975,000
ジャフコ グループ	6,000	1,767.00	10,602,000
大和証券グループ本社	111,700	615.70	68,773,690
野村ホールディングス	265,200	510.30	135,331,560
岡三証券グループ	12,100	344.00	4,162,400
丸三証券	5,200	480.00	2,496,000
東洋証券	5,700	224.00	1,276,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	17,300	377.00	6,522,100
光世証券	300	450.00	135,000
水戸証券	3,700	267.00	987,900
いちよし証券	3,000	633.00	1,899,000
松井証券	8,600	796.00	6,845,600
マネックスグループ	14,700	433.00	6,365,100
極東証券	2,000	688.00	1,376,000
岩井コスモホールディングス	1,500	1,255.00	1,882,500
アイザワ証券グループ	2,200	702.00	1,544,400
マネーパートナーズグループ	2,200	244.00	536,800
スパークス・グループ	8,000	283.00	2,264,000
かんぽ生命保険	17,500	2,143.00	37,502,500
S O M P Oホールディングス	24,700	5,861.00	144,766,700
アニコム ホールディングス	5,400	661.00	3,569,400
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	35,700	4,286.00	153,010,200
第一生命ホールディングス	84,700	2,307.00	195,402,900
東京海上ホールディングス	48,400	7,783.00	376,697,200
T & Dホールディングス	38,700	1,506.00	58,282,200
アドバンスクリエイト	900	982.00	883,800
全国保証	4,100	4,345.00	17,814,500
あんしん保証	900	257.00	231,300
ジェイリース	600	1,905.00	1,143,000
イントラスト	800	562.00	449,600

日本モーゲージサービス	1,000	983.00	983,000	
C a s a	700	888.00	621,600	
アルヒ	2,600	1,025.00	2,665,000	
プレミアグループ	900	4,390.00	3,951,000	
ネットプロテクションズホールディングス	5,300	589.00	3,121,700	
クレディセゾン	10,300	1,590.00	16,377,000	
芙蓉総合リース	1,500	7,950.00	11,925,000	
みずほリース	2,100	3,215.00	6,751,500	
東京センチュリー	2,700	4,510.00	12,177,000	
日本証券金融	6,800	832.00	5,657,600	
アイフル	29,500	371.00	10,944,500	
リコーリース	1,500	3,580.00	5,370,000	
イオンフィナンシャルサービス	9,500	1,350.00	12,825,000	
アコム	34,200	323.00	11,046,600	
ジャックス	1,800	3,435.00	6,183,000	
オリエントコーポレーション	47,800	129.00	6,166,200	
オリックス	103,200	2,272.00	234,470,400	
三菱H C キャピタル	55,900	621.00	34,713,900	
九州リースサービス	700	571.00	399,700	
日本取引所グループ	40,400	2,087.50	84,335,000	
イー・ギャランティ	2,600	2,198.00	5,714,800	
アサックス	700	608.00	425,600	
N E C キャピタルソリューション	700	2,070.00	1,449,000	
いちご	19,700	292.00	5,752,400	
日本駐車場開発	18,400	167.00	3,072,800	
スター・マイカ・ホールディングス	1,100	1,464.00	1,610,400	
S R E ホールディングス	500	2,532.00	1,266,000	
A D ワークスグループ	4,700	152.00	714,400	
ヒューリック	37,900	1,033.00	39,150,700	
三栄建築設計	700	1,611.00	1,127,700	
野村不動産ホールディングス	9,000	3,160.00	28,440,000	
三重交通グループホールディングス	3,600	479.00	1,724,400	
サムティ	2,600	2,004.00	5,210,400	
ディア・ライフ	2,400	598.00	1,435,200	
コーセーアールイー	700	625.00	437,500	
地主	1,200	2,023.00	2,427,600	

プレサンスコーポレーション	1,900	1,547.00	2,939,300
THEグローバル社	1,400	144.00	201,600
ハウスコム	300	892.00	267,600
JPMC	800	1,001.00	800,800
サンセイランディック	800	820.00	656,000
エストラスト	300	528.00	158,400
フージャースホールディングス	2,300	801.00	1,842,300
オープンハウスグループ	5,500	5,460.00	30,030,000
東急不動産ホールディングス	47,400	696.00	32,990,400
飯田グループホールディングス	14,500	2,128.00	30,856,000
イーランド	400	1,406.00	562,400
ムゲンエステート	1,400	472.00	660,800
ビーロッド	1,500	511.00	766,500
ファーストブラザーズ	500	818.00	409,000
And Doホールディングス	1,000	826.00	826,000
シーアールイー	700	1,669.00	1,168,300
プロパティエージェント	200	1,448.00	289,600
ケイアイスター不動産	800	4,685.00	3,748,000
アグレ都市デザイン	400	1,500.00	600,000
グッドコムアセット	800	1,242.00	993,600
ジェイ・エス・ビー	400	3,195.00	1,278,000
ロードスターキャピタル	500	2,021.00	1,010,500
テンポイノベーション	600	879.00	527,400
グローバル・リンク・マネジメント	400	894.00	357,600
フェイスネットワーク	300	1,353.00	405,900
パーク24	10,300	1,829.00	18,838,700
パラカ	500	1,836.00	918,000
三井不動産	67,800	2,834.50	192,179,100
三菱地所	99,000	1,903.00	188,397,000
平和不動産	2,800	3,940.00	11,032,000
東京建物	14,900	1,882.00	28,041,800
京阪神ビルディング	2,300	1,265.00	2,909,500
住友不動産	31,300	3,489.00	109,205,700
テオーシー	2,600	761.00	1,978,600
東京楽天地	300	3,995.00	1,198,500
スターツコーポレーション	2,300	2,754.00	6,334,200

フジ住宅	2,100	664.00	1,394,400
空港施設	1,600	542.00	867,200
明和地所	800	619.00	495,200
ゴールドクレスト	1,400	1,714.00	2,399,600
エスリード	700	1,698.00	1,188,600
日神グループホールディングス	2,500	433.00	1,082,500
日本エスコン	3,400	764.00	2,597,600
タカラレーベン	7,200	354.00	2,548,800
A V A N T I A	800	813.00	650,400
イオンモール	8,800	1,649.00	14,511,200
毎日コムネット	700	615.00	430,500
ファースト住建	600	1,117.00	670,200
カチタス	4,300	3,090.00	13,287,000
トーセイ	2,500	1,245.00	3,112,500
穴吹興産	400	2,043.00	817,200
サンフロンティア不動産	2,500	1,089.00	2,722,500
F Jネクストホールディングス	1,600	1,077.00	1,723,200
インテリックス	400	538.00	215,200
ランドビジネス	900	230.00	207,000
サンネクスタグループ	700	995.00	696,500
グランディハウス	1,300	536.00	696,800
日本空港ビルデング	5,600	5,050.00	28,280,000
明豊ファシリティワークス	800	626.00	500,800
日本工営	1,100	3,380.00	3,718,000
L I F U L L	5,300	169.00	895,700
ミクシィ	3,800	2,266.00	8,610,800
ジェイエイシーリクルートメント	1,400	1,862.00	2,606,800
日本M & Aセンターホールディングス	27,600	1,628.00	44,932,800
メンバーズ	400	2,717.00	1,086,800
中広	400	385.00	154,000
UTグループ	2,400	2,435.00	5,844,000
アイティメディア	800	1,568.00	1,254,400
E・Jホールディングス	900	1,267.00	1,140,300
夢真ビーネックスグループ	5,500	1,555.00	8,552,500
コシダカホールディングス	4,700	648.00	3,045,600
アルトナー	500	910.00	455,000

パソナグループ	1,800	1,917.00	3,450,600
C D S	400	1,896.00	758,400
リンクアンドモチベーション	3,900	512.00	1,996,800
エス・エム・エス	5,700	2,874.00	16,381,800
サニーサイドアップグループ	800	678.00	542,400
パーソルホールディングス	16,800	2,670.00	44,856,000
リニカル	1,100	794.00	873,400
クックパッド	5,600	207.00	1,159,200
エスクリ	1,100	354.00	389,400
アイ・ケイ・ケイホールディングス	1,000	578.00	578,000
学情	600	981.00	588,600
スタジオアリス	700	2,247.00	1,572,900
シミックホールディングス	800	1,496.00	1,196,800
エプコ	300	696.00	208,800
N J S	300	1,955.00	586,500
総合警備保障	6,100	3,905.00	23,820,500
カカクコム	12,300	2,378.00	29,249,400
アイロムグループ	600	1,927.00	1,156,200
セントケア・ホールディング	1,000	905.00	905,000
サイネックス	200	588.00	117,600
ルネサンス	1,300	930.00	1,209,000
ディップ	3,000	3,515.00	10,545,000
デジタルホールディングス	1,200	1,263.00	1,515,600
新日本科学	2,100	2,087.00	4,382,700
キャリアデザインセンター	400	1,154.00	461,600
ベネフィット・ワン	6,100	1,895.00	11,559,500
エムスリー	29,700	3,850.00	114,345,000
ツカダ・グローバルホールディング	1,300	311.00	404,300
プラス	300	870.00	261,000
アウトソーシング	9,700	1,101.00	10,679,700
ウェルネット	1,700	444.00	754,800
ワールドホールディングス	700	2,269.00	1,588,300
ディー・エヌ・エー	6,400	1,870.00	11,968,000
博報堂D Yホールディングス	21,300	1,296.00	27,604,800
ぐるなび	2,700	359.00	969,300
タカミヤ	2,100	368.00	772,800

ジャパンベストレスキューシステム	1,100	750.00	825,000
ファンコミュニケーションズ	4,000	386.00	1,544,000
ライク	600	1,976.00	1,185,600
ビジネス・ブレークスルー	600	411.00	246,600
エスプール	4,800	1,007.00	4,833,600
WDBホールディングス	800	2,506.00	2,004,800
ティア	900	436.00	392,400
CDG	100	1,279.00	127,900
アドウェイズ	2,600	680.00	1,768,000
バリューコマース	1,300	3,030.00	3,939,000
インフォマート	18,500	364.00	6,734,000
J Pホールディングス	4,300	256.00	1,100,800
エコナックホールディングス	4,300	90.00	387,000
CLホールディングス	400	905.00	362,000
プレステージ・インターナショナル	6,300	645.00	4,063,500
アミューズ	900	2,002.00	1,801,800
ドリームインキュベータ	500	1,971.00	985,500
クイック	1,100	1,439.00	1,582,900
TAC	1,100	211.00	232,100
電通グループ	15,800	4,230.00	66,834,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	800	1,254.00	1,003,200
ぴあ	500	3,120.00	1,560,000
イオンファンタジー	700	3,035.00	2,124,500
シーティーエス	1,800	812.00	1,461,600
ネクシィーズグループ	700	559.00	391,300
H.U.グループホールディングス	4,400	3,170.00	13,948,000
アルプス技研	1,400	1,810.00	2,534,000
日本空調サービス	1,700	790.00	1,343,000
オリエンタルランド	17,900	18,190.00	325,601,000
ダスキン	3,500	2,966.00	10,381,000
明光ネットワークジャパン	2,000	603.00	1,206,000
ファルコホールディングス	700	1,892.00	1,324,400
秀英予備校	200	423.00	84,600
ラウンドワン	4,800	1,365.00	6,552,000
リゾートトラスト	7,200	2,032.00	14,630,400
ビー・エム・エル	2,100	3,775.00	7,927,500

りらいあコミュニケーションズ	2,300	1,079.00	2,481,700
リソー教育	8,000	303.00	2,424,000
早稲田アカデミー	900	1,160.00	1,044,000
ユー・エス・エス	18,900	2,545.00	48,100,500
東京個別指導学院	1,600	590.00	944,000
サイバーエージェント	35,900	1,338.00	48,034,200
楽天グループ	78,100	625.00	48,812,500
クリーク・アンド・リバー社	900	2,054.00	1,848,600
モーニングスター	2,900	524.00	1,519,600
テー・オー・ダブリュー	3,200	313.00	1,001,600
山田コンサルティンググループ	900	1,164.00	1,047,600
セントラルスポーツ	600	2,519.00	1,511,400
フルキャストホールディングス	1,500	2,230.00	3,345,000
エン・ジャパン	3,000	1,894.00	5,682,000
リソルホールディングス	200	4,765.00	953,000
テクノプロ・ホールディングス	10,100	2,944.00	29,734,400
アトラグループ	500	192.00	96,000
インターワークス	700	362.00	253,400
アイ・アールジャパンホールディングス	800	2,082.00	1,665,600
K e e P e r 技研	1,100	3,340.00	3,674,000
ファーストロジック	300	758.00	227,400
三機サービス	400	968.00	387,200
G u n o s y	1,000	700.00	700,000
デザインワン・ジャパン	700	178.00	124,600
イー・ガーディアン	600	2,923.00	1,753,800
リブセンス	1,200	174.00	208,800
ジャパンマテリアル	5,200	1,753.00	9,115,600
ベクトル	2,400	1,149.00	2,757,600
ウチヤマホールディングス	800	289.00	231,200
チャーム・ケア・コーポレーション	1,300	1,075.00	1,397,500
キャリアリンク	600	2,039.00	1,223,400
I B J	1,400	699.00	978,600
アサンテ	700	1,534.00	1,073,800
バリューHR	1,600	1,358.00	2,172,800
M & A キャピタルパートナーズ	1,400	3,380.00	4,732,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,269.00	888,300

ERIホールディングス	600	1,025.00	615,000
アピスト	200	2,927.00	585,400
シグマクス・ホールディングス	2,000	1,106.00	2,212,000
ウィルグループ	1,300	1,201.00	1,561,300
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,000	156.00	312,000
メドピア	1,200	1,989.00	2,386,800
レアジョブ	400	531.00	212,400
リクルートホールディングス	120,600	4,408.00	531,604,800
エラン	2,300	1,031.00	2,371,300
土木管理総合試験所	600	326.00	195,600
ネットマーケティング	900	573.00	515,700
日本郵政	183,800	966.60	177,661,080
ベルシステム24ホールディングス	2,400	1,461.00	3,506,400
鎌倉新書	2,000	593.00	1,186,000
S MN	400	578.00	231,200
一蔵	300	447.00	134,100
グローバルキッズCOMPANY	300	672.00	201,600
エアトリ	1,000	2,276.00	2,276,000
アトラエ	1,200	1,586.00	1,903,200
ストライク	700	3,615.00	2,530,500
ソラスト	4,100	762.00	3,124,200
セラク	500	1,160.00	580,000
インソース	1,900	2,172.00	4,126,800
ベिकाレント・コンサルティング	1,200	36,600.00	43,920,000
Orchestra Holdings	300	2,567.00	770,100
アイモバイル	800	1,313.00	1,050,400
キャリアインデックス	600	507.00	304,200
MS - Japan	700	854.00	597,800
船場	300	680.00	204,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,300	1,508.00	7,992,400
フルテック	300	1,308.00	392,400
ツナググループ・ホールディングス	700	311.00	217,700
GameWith	700	461.00	322,700
MS&Consulting	300	634.00	190,200
ウェルビー	1,100	708.00	778,800

エル・ティー・エス	200	3,480.00	696,000
ミダックホールディングス	800	2,865.00	2,292,000
日総工産	1,300	567.00	737,100
キュービーネットホールディングス	800	1,301.00	1,040,800
R P Aホールディングス	2,600	305.00	793,000
スプリックス	600	970.00	582,000
マネジメントソリューションズ	900	2,676.00	2,408,400
プロレド・パートナーズ	400	466.00	186,400
and factory	700	387.00	270,900
テノ・ホールディングス	200	634.00	126,800
フロンティア・マネジメント	500	1,341.00	670,500
ピアラ	300	681.00	204,300
コプロ・ホールディングス	300	837.00	251,100
ギークス	300	1,013.00	303,900
カーブスホールディングス	4,700	688.00	3,233,600
フォーラムエンジニアリング	1,000	937.00	937,000
Fast Fitness Japan	300	1,275.00	382,500
ダイレクトマーケティングミックス	1,700	1,901.00	3,231,700
ポピンズ	400	1,817.00	726,800
L I T A L I C O	1,400	2,327.00	3,257,800
アドバンテッジリスクマネジメント	900	499.00	449,100
リログループ	9,300	2,035.00	18,925,500
東祥	1,300	1,286.00	1,671,800
ビーウィズ	500	1,408.00	704,000
T R Eホールディングス	3,200	1,602.00	5,126,400
人・夢・技術グループ	700	2,495.00	1,746,500
エイチ・アイ・エス	3,600	1,950.00	7,020,000
ラックランド	600	2,948.00	1,768,800
共立メンテナンス	3,000	4,840.00	14,520,000
イチネンホールディングス	1,700	1,253.00	2,130,100
建設技術研究所	800	2,605.00	2,084,000
スペース	1,100	888.00	976,800
燦ホールディングス	800	1,829.00	1,463,200
スバル興業	100	8,740.00	874,000
東京テアトル	600	1,219.00	731,400
タナベ経営	400	676.00	270,400

ナガワ	500	8,190.00	4,095,000	
東京都競馬	1,200	4,010.00	4,812,000	
常磐興産	700	1,277.00	893,900	
カナモト	2,700	1,995.00	5,386,500	
西尾レントオール	1,400	2,767.00	3,873,800	
アゴーラ ホスピタリティグループ	13,900	22.00	305,800	
トランス・コスモス	2,100	3,620.00	7,602,000	
乃村工藝社	7,200	876.00	6,307,200	
藤田観光	800	2,561.00	2,048,800	
KNT-CTホールディングス	1,100	1,449.00	1,593,900	
日本管財	1,800	2,576.00	4,636,800	
トーカイ	1,200	1,697.00	2,036,400	
セコム	16,600	8,818.00	146,378,800	
セントラル警備保障	800	2,614.00	2,091,200	
丹青社	3,300	807.00	2,663,100	
メイテック	6,000	2,297.00	13,782,000	
応用地質	1,600	1,672.00	2,675,200	
船井総研ホールディングス	3,100	2,268.00	7,030,800	
進学会ホールディングス	700	316.00	221,200	
オオバ	900	699.00	629,100	
いであ	300	1,694.00	508,200	
学究社	500	1,569.00	784,500	
ベネッセホールディングス	5,600	2,258.00	12,644,800	
イオンディライト	1,900	2,816.00	5,350,400	
ナック	600	974.00	584,400	
ダイセキ	3,100	3,740.00	11,594,000	
ステップ	600	1,690.00	1,014,000	
合計	18,043,600		43,119,927,780	

(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。

ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
預金	2,562,900	1,533,700
コール・ローン	1,200,045,994	1,666,890,876
国債証券	29,893,169,504	24,334,558,216
地方債証券	8,278,828,896	3,680,879,448
特殊債券	32,116,828,429	21,358,782,673
派生商品評価勘定	1,705,824,840	354,504,643
未収利息	228,669,563	183,248,516
前払費用	8,612,020	12,923,498
差入委託証拠金	27,326	34,381
流動資産合計	73,434,569,472	51,593,355,951
資産合計	73,434,569,472	51,593,355,951
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	491,627,487
未払金	-	1,390,200
未払解約金	203,203,310	-
未払利息	914	786
流動負債合計	203,204,224	493,018,473
負債合計	203,204,224	493,018,473
純資産の部		
元本等		
元本	53,203,722,162	43,247,405,559
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	20,027,643,086	7,852,931,919
元本等合計	73,231,365,248	51,100,337,478
純資産合計	73,231,365,248	51,100,337,478
負債純資産合計	73,434,569,472	51,593,355,951

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、地方債証券及び特殊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>
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 7月19日現在	2022年 7月19日現在
1.	期首	2020年 7月18日	2021年 7月20日
	期首元本額	85,327,381,496円	53,203,722,162円
	期首からの追加設定元本額	3,384,048,241円	1,984,006,182円
	期首からの一部解約元本額	35,507,707,575円	11,940,322,785円
	元本の内訳		
	円サポート	996,103,939円	840,477,734円
	高格付債券ファンド（為替ヘッジ70）毎月分配型	1,426,724,931円	1,381,781,891円
	高格付債券ファンド（為替ヘッジ70）資産成長型	84,177,587円	72,369,252円
	スマート・ラップ・ジャパン（毎月分配型）	34,061,417円	156,117,790円
	スマート・ラップ・ジャパン（1年決算型）	38,643,024円	168,813,385円
	スマート・ラップ・グローバル・インカム（毎月分配型）	9,233,698円	16,447,986円
	スマート・ラップ・グローバル・インカム（1年決算型）	14,424,644円	28,394,334円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08	76,702,036円	93,673,331円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11	26,223,375円	30,571,588円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2017-02	26,026,264円	28,958,347円
	時間分散型バランスファンド（成長指向）2017-02	15,713,078円	- 円
	高格付先進国ソブリン債券（円ヘッジ）ファンド（適格機関投資家向け）	21,884,209,956円	17,316,332,604円
	高格付先進国ソブリン債券（円ヘッジ）ファンド（年2回決算型・適格機関投資家向け）	1,145,306,112円	1,141,836,244円

高格付先進国ソブリンオープン・為替ヘッジあり(適格機関投資家向け)	8,669,673,403円	7,603,672,037円
P F 先進国ソブリンオープン・為替ヘッジ70(適格機関投資家向け)	1,559,919,406円	56,924,084円
高格付先進国ソブリンファンド 2013-05M(適格機関投資家向け)	2,218,823,560円	2,180,586,405円
高格付先進国ソブリンファンド・為替ヘッジあり 2013-07Q(適格機関投資家転売制限付)	75,532,014円	74,299,083円
高格付先進国ソブリンファンド・為替ヘッジあり 2016-09Q(適格機関投資家転売制限付)	779,036,621円	698,258,030円
高格付先進国ソブリンファンド・為替ヘッジあり 2016-10Q(適格機関投資家転売制限付)	426,721,101円	350,398,940円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2013-11M(適格機関投資家転売制限付)	1,929,533,941円	1,978,419,823円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2014-05M(適格機関投資家転売制限付)	1,268,197,807円	1,240,817,502円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2014-07(適格機関投資家転売制限付)	1,234,101,442円	1,270,352,025円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2014-09Q(適格機関投資家転売制限付)	735,170,594円	552,558,818円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2014-10(適格機関投資家転売制限付)	550,631,827円	561,337,757円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2014-11Q(適格機関投資家転売制限付)	484,541,228円	497,241,907円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2015-02Q(適格機関投資家転売制限付)	1,643,645,693円	628,905,977円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2015-03Q(適格機関投資家転売制限付)	620,938,268円	631,421,883円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2015-04Q(適格機関投資家転売制限付)	1,513,531,273円	686,679,003円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2015-09Q(適格機関投資家転売制限付)	1,227,337,378円	1,007,351,736円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2016-04Q(適格機関投資家転売制限付)	2,488,836,545円	1,952,406,063円
計	53,203,722,162円	43,247,405,559円
2. 受益権の総数	53,203,722,162口	43,247,405,559口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19日	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19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 7月19日現在	2022年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

(2021年 7月19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	141,951,796
地方債証券	91,711,377
特殊債券	668,656,007
合計	902,319,180

(2022年 7月19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	2,485,444,635
地方債証券	365,513,118
特殊債券	2,376,272,177
合計	5,227,229,930

(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 7月19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	71,585,615,386	-	69,879,790,546	1,705,824,840
	米ドル	9,891,376,863	-	9,827,014,715	64,362,148
	加ドル	9,509,442,967	-	9,236,685,231	272,757,736
	ユーロ	29,961,331,946	-	29,397,011,460	564,320,486
	スウェーデンクローナ	8,349,879,467	-	8,120,235,250	229,644,217
	豪ドル	13,873,584,143	-	13,298,843,890	574,740,253
合計		71,585,615,386	-	69,879,790,546	1,705,824,840

(2022年 7月19日現在)

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	49,078,660,181	-	49,215,783,025	137,122,844
	加ドル	7,307,053,940	-	7,353,313,310	46,259,370
	ユーロ	21,705,055,438	-	21,380,977,250	324,078,188
	英ポンド	2,870,742,693	-	2,930,119,827	59,377,134
	スウェーデンクローナ	4,369,227,620	-	4,410,449,364	41,221,744
	豪ドル	12,826,580,490	-	13,140,923,274	314,342,784
	合計	49,078,660,181	-	49,215,783,025	137,122,844

（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 7月19日現在		2022年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.3764円	1口当たり純資産額	1.1816円
(1万口当たり純資産額)	(13,764円)	(1万口当たり純資産額)	(11,816円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
加ドル	特殊債券	CANADA HOUSING TRUST-2.1%-29/09/15	2,500,000.00	2,287,700.00	
		CANADA HOUSING TRUST-1.75%-30/06/15	32,040,000.00	28,242,651.24	
		CANADA HOUSING TRUST-1.1%-31/03/15	38,400,000.00	31,574,246.40	
		CANADA HOUSING TRUST-1.6%-31/12/15	10,000,000.00	8,478,750.00	
加ドル小計			82,940,000.00	70,583,347.64 (7,515,009,023)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	71,500,000.00	67,722,512.00	
		BELGIUM KINGDOM-0.35%-32/06/22	10,400,000.00	9,009,189.90	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	37,200,000.00	35,215,975.20	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	35,700,000.00	39,390,023.40	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	1,480,000.00	1,245,837.36	
ユーロ小計			156,280,000.00	152,583,537.86 (21,376,953,654)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.0%-32/01/31	6,000,000.00	5,376,600.00	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	5,500,000.00	6,525,904.00	
		UK TREASURY-0.875%-33/07/31	7,000,000.00	6,023,458.56	
英ポンド小計			18,500,000.00	17,925,962.56 (2,957,604,562)	
スウェーデン クローナ	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK-3.75%- 32/06/01	162,000,000.00	173,152,744.20	
		NORDIC INVESTMENT BANK-2.94%-31/10/17	102,500,000.00	102,092,092.02	
		OEKB OEST. KONTROLLBANK-1.37%- 28/11/13	60,000,000.00	54,345,235.20	
スウェーデンクローナ小計			324,500,000.00	329,590,071.42 (4,373,660,247)	
豪ドル	地方債証券	NEW S WALES TREASURY CRP-1.5%- 32/02/20	4,600,000.00	3,678,044.17	
		QUEENSLAND TREASURY CORP-2.0%- 33/08/22	7,700,000.00	6,295,127.68	

	QUEENSLAND TREASURY CORP-2.25%-41/11/20	2,000,000.00	1,472,623.68	
	TREASURY CORP VICTORIA-1.5%-30/11/20	3,000,000.00	2,486,014.44	
	TREASURY CORP VICTORIA-1.5%-31/09/10	13,300,000.00	10,751,139.85	
	TREASURY CORP VICTORIA-4.25%-32/12/20	6,000,000.00	6,092,316.60	
	WESTERN AUST TREAS CORP-1.75%-31/10/22	10,000,000.00	8,320,638.50	
	地方債証券小計	46,600,000.00	39,095,904.92 (3,680,879,448)	
特殊債券	BNG BANK NV-3.3%-29/04/26	3,000,000.00	2,817,256.26	
	EUROFIMA-3.35%-29/05/21	58,560,000.00	54,623,528.28	
	KOMMUNALBANKEN AS-2.4%-29/11/21	27,990,000.00	24,626,076.15	
	LANDWIRTSCH. RENTENBANK-1.9%-30/01/30	10,000,000.00	8,431,140.80	
	NEDER WATERSCHAPSBANK-3.3%-29/05/02	10,750,000.00	10,087,377.20	
	特殊債券小計	110,300,000.00	100,585,378.69 (9,470,113,403)	
豪ドル小計		156,900,000.00	139,681,283.61 (13,150,992,851)	
	合計		49,374,220,337 (49,374,220,337)	

(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
加ドル	特殊債券 4銘柄	100.0%	15.2%
ユーロ	国債証券 5銘柄	100.0%	43.2%
英ポンド	国債証券 3銘柄	100.0%	6.0%
スウェーデンクローナ	特殊債券 3銘柄	100.0%	8.9%
豪ドル	地方債証券 7銘柄	28.0%	7.5%
	特殊債券 5銘柄	72.0%	19.2%

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。

インデックス マザーファンド リート

貸借対照表

（単位：円）

	2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	242,953,781	307,258,832
投資証券	26,726,552,060	37,620,202,500
派生商品評価勘定	6,297,810	812,200
未収入金	-	1,063,435,200
未収配当金	170,747,555	255,996,661
前払金	-	12,781,040
差入委託証拠金	22,572,000	35,226,000
流動資産合計	27,169,123,206	39,295,712,433
資産合計	27,169,123,206	39,295,712,433
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	7,017,720
前受金	10,796,370	-
未払解約金	35,920	796,235,130
未払利息	185	144
流動負債合計	10,832,475	803,252,994
負債合計	10,832,475	803,252,994
純資産の部		
元本等		
元本	18,147,264,346	27,045,389,835
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	9,011,026,385	11,447,069,604
元本等合計	27,158,290,731	38,492,459,439
純資産合計	27,158,290,731	38,492,459,439
負債純資産合計	27,169,123,206	39,295,712,433

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	投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券
--------------------	--------------------------------------------------------------------

	<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>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>

(貸借対照表に関する注記)

		2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
1.	期首	2020年 7月18日	2021年 7月20日
	期首元本額	18,331,250,932円	18,147,264,346円
	期首からの追加設定元本額	14,599,590,736円	18,292,718,419円
	期首からの一部解約元本額	14,783,577,322円	9,394,592,930円
	元本の内訳		
	上場インデックスファンドJリート(東証REIT指数)隔月分配型(ミニ)	9,649,955,563円	16,437,771,862円
	時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-08	18,691,609円	18,434,546円
	時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-11	6,649,933円	5,963,890円
	時間分散型バランスファンド(安定指向)2017-02	6,534,241円	5,646,689円
	時間分散型バランスファンド(成長指向)2017-02	8,157,751円	-円
	インデックス・Jリート・オープン(適格機関投資家向け)	1,934,888,989円	4,350,508,487円
	インデックスファンドJリート 2015-03(適格機関投資家向け)	163,249,424円	158,369,490円
	インデックスファンドJリート 2020-01(適格機関投資家向け)	1,412,244,188円	1,392,219,186円
	インデックスファンドJリート・分配抑制コース 2020-02(適格機関投資家向け)	1,456,161,749円	1,435,674,407円
	インデックスファンドJリート・分配抑制コース 2020-03(適格機関投資家向け)	166,543,170円	164,477,034円
	インデックスファンドJリート 2021-05(適格機関投資家向け)	2,290,548,963円	1,475,816,380円
	インデックスファンドJリート 2021-10(適格機関投資家向け)	-円	1,408,532,812円

Nikkoam バランスファンド3 - B私募 2002（適格機関投資家向け）	542,857,703円	- 円
Nikkoam バランス・プラス・米国株式モメンタム戦略ファンド1 - B私募 2103（適格機関投資家向け）	490,781,063円	191,975,052円
計	18,147,264,346円	27,045,389,835円
2. 受益権の総数	18,147,264,346口	27,045,389,835口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19日	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19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 7月19日現在	2022年 7月19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	(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 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

(2021年 7月19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	46,950,272
合計	46,950,272

(2022年 7月19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	1,829,318,045
合計	1,829,318,045

(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 7月19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	416,784,630	-	423,126,000	6,341,370
合計		416,784,630	-	423,126,000	6,341,370

(2022年 7月19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	611,159,540	-	605,022,000	6,137,540
合計		611,159,540	-	605,022,000	6,137,540

(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 7月19日現在		2022年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.4966円	1口当たり純資産額	1.4233円
(1万口当たり純資産額)	(14,966円)	(1万口当たり純資産額)	(14,233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	692	85,046,800	
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,088	106,406,400	
	S O S i L A物流リート投資法人 投資証券	1,598	240,658,800	
	東海道リート投資法人 投資証券	263	32,796,100	
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,186	805,294,000	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,040	621,352,000	
	産業ファンド投資法人 投資証券	4,878	897,064,200	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,436	1,252,422,000	
	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	2,458	548,134,000	
	アクティブピア・プロパティーズ投資法人 投資証券	1,809	738,072,000	
	G L P投資法人 投資証券	11,128	1,868,391,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,598	543,320,000	
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	5,621	1,908,329,500	
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	601	380,433,000	
	O n eリート投資法人 投資証券	596	161,158,400	
	イオンリート投資法人 投資証券	4,041	623,122,200	
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,206	514,883,600	
	日本リート投資法人 投資証券	1,060	383,190,000	
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	10,429	831,191,300	
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	718	97,648,000	
	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,372	384,708,800	
	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	842	144,150,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	778	102,929,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	11,111	1,825,537,300	
	いちごホテルリート投資法人 投資証券	569	51,665,200	
	ラサールロジポート投資法人 投資証券	4,206	727,638,000	
	スターアジア不動産投資法人 投資証券	3,551	211,994,700	
	マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	402	54,109,200	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,353	708,972,000	
	大江戸温泉リート投資法人 投資証券	555	37,795,500	
投資法人みらい 投資証券	4,162	205,810,900		

森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	806	102,603,800	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	998	469,060,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,331	264,203,500	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	555	71,095,500	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	1,355	154,199,000	
アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	1,340	205,958,000	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	4,006	2,756,128,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	3,436	2,164,680,000	
日本都市ファンド投資法人 投資証券	17,336	1,822,013,600	
オリックス不動産投資法人 投資証券	6,846	1,259,664,000	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,348	933,330,000	
N T T 都市開発リート投資法人 投資証券	3,294	472,689,000	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,304	447,897,600	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,354	250,465,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	7,735	1,084,447,000	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,456	355,383,200	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	15,122	564,806,700	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,205	651,905,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	2,342	334,203,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,317	743,757,000	
福岡リート投資法人 投資証券	1,777	297,647,500	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,063	755,793,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	2,816	236,544,000	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	718	509,062,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,552	231,558,400	
スタートプロシード投資法人 投資証券	535	134,392,000	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,159	1,625,085,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	10,526	673,664,000	
大和証券リビング投資法人 投資証券	4,643	571,089,000	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,152	382,652,800	
合計	200,774	37,620,202,500	

(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

「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。

インデックス マザーファンド 海外先進国債券

貸借対照表

（単位：円）

	2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
預金	728,817	359,648
コール・ローン	212,124	159,284
国債証券	102,703,522	82,488,152
未収利息	733,913	668,128
前払費用	51,086	10,819
流動資産合計	104,429,462	83,686,031
資産合計	104,429,462	83,686,031
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	85,918,557	66,466,103
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	18,510,905	17,219,928
元本等合計	104,429,462	83,686,031
純資産合計	104,429,462	83,686,031
負債純資産合計	104,429,462	83,686,031

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</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 7月19日現在	2022年 7月19日現在
1.	期首	2020年 7月18日	2021年 7月20日
	期首元本額	116,602,050円	85,918,557円
	期首からの追加設定元本額	4,693,800円	1,419,932円
	期首からの一部解約元本額	35,377,293円	20,872,386円
	元本の内訳		
	時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-08	41,044,359円	37,764,326円
	インデックスファンド海外先進国債券(適格機関投資家向け)	4,931,469円	4,920,515円
	時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-11	14,105,169円	12,213,540円
	時間分散型バランスファンド(安定指向)2017-02	13,903,120円	11,567,722円
	時間分散型バランスファンド(成長指向)2017-02	11,934,440円	-円
	計	85,918,557円	66,466,103円
2.	受益権の総数	85,918,557口	66,466,103口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19日	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19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 7月19日現在	2022年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

(2021年 7月19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	3,053,401
合計	3,053,401

(2022年 7月19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	12,090,360
合計	12,090,360

(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 7月19日現在		2022年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.2154円	1口当たり純資産額	1.2591円
(1万口当たり純資産額)	(12,154円)	(1万口当たり純資産額)	(12,591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-0.25%-23/09/30	39,000.00	37,663.94	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	83,000.00	81,648.00	

		US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	6,000.00	5,460.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	75,000.00	72,562.50	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	24,000.00	21,628.12	
		US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	8,000.00	6,973.75	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	31,000.00	36,355.97	
		US TREASURY N/B-1.875%-41/02/15	2,000.00	1,577.65	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	5,000.00	4,497.85	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	9,000.00	7,659.49	
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	17,000.00	15,930.19	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	18,000.00	11,927.10	
米ドル小計			317,000.00	303,884.56	(42,012,040)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-24/05/01	2,000.00	1,940.52	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	5,000.00	4,880.14	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	2,000.00	1,900.46	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	3,000.00	3,723.17	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	3,000.00	3,189.92	
加ドル小計			15,000.00	15,634.21	(1,664,574)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	30,000.00	30,271.87	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	50,000.00	48,375.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	20,000.00	18,543.75	
メキシコペソ小計			100,000.00	97,190.62	(656,785)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	5,000.00	6,188.75	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	2,000.00	1,893.33	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	3,000.00	3,688.44	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	9,000.00	9,109.31	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	8,000.00	9,586.91	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 31/10/31	1,000.00	853.19	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	8,000.00	10,507.44	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.0%- 23/08/15	3,000.00	3,055.45
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	6,000.00	5,994.31
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	8,000.00	10,194.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	4,000.00	5,439.08
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 35/05/15	1,000.00	842.95
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	4,000.00	5,364.32
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	3,000.00	4,568.72
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	3,000.00	2,886.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	4,000.00	4,206.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	12,000.00	11,985.22
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	17,000.00	19,743.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	2,000.00	1,994.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	7,000.00	8,369.32
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	1,000.00	1,094.40
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	2,000.00	1,849.70
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	15,000.00	14,864.47
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-27/02/25	1,000.00	948.63
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	10,000.00	12,656.77
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	7,000.00	9,191.04
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	8,000.00	10,705.21
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	2,000.00	2,710.23
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	1,000.00	1,047.42
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	3,000.00	2,861.25
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	5,000.00	4,923.80
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,000.00	1,092.03
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	3,000.00	3,980.04
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-25/04/20	2,000.00	1,960.71

		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	1,000.00	892.83
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	4,000.00	5,057.98
ユーロ小計			176,000.00	202,308.80 (28,343,462)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-4.75%-30/12/07	6,000.00	7,274.23
		UK TREASURY-0.625%-35/07/31	1,000.00	787.49
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	2,000.00	2,451.94
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	2,000.00	2,268.20
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	2,000.00	2,605.12
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	2,000.00	2,719.94
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	5,000.00	5,014.00
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	2,000.00	1,983.00
英ポンド小計			22,000.00	25,103.92 (4,141,895)
スウェーデン デンク ローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	20,000.00	19,378.02
スウェーデンクローナ小計			20,000.00	19,378.02 (257,146)
ノル ウェー ク ロー ネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	4,000.00	3,804.68
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	10,000.00	9,511.60
ノルウェークローネ小計			14,000.00	13,316.28 (182,033)
デンマ ーク ク ロー ネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	5,000.00	5,134.31
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	8,000.00	11,206.05
デンマーククローネ小計			13,000.00	16,340.36 (307,525)
ポー ラン ド ズ ロ チ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	13,000.00	10,973.30
ポーランドズロチ小計			13,000.00	10,973.30 (321,202)
豪 ド ル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	4,000.00	3,906.29
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	9,000.00	9,834.83
豪ドル小計			13,000.00	13,741.12 (1,293,726)
シン ガ ポ ー ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	2,000.00	2,010.39

ポールドル		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	2,000.00	1,936.15	
シンガポールドル小計			4,000.00	3,946.54	(390,194)
マレーシアリングット	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	6,000.00	6,146.84	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	9,000.00	8,732.48	
マレーシアリングット小計			15,000.00	14,879.32	(461,677)
イスラエルシェケル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	10,000.00	9,889.42	
イスラエルシェケル小計			10,000.00	9,889.42	(395,787)
香港・オフショア 人民元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-2.26%-25/02/24	10,000.00	9,984.08	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	60,000.00	61,078.14	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	30,000.00	29,671.08	
香港・オフショア人民元小計			100,000.00	100,733.30	(2,060,106)
合計				82,488,152	(82,488,152)

(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 12銘柄	100.0%	50.8%
加ドル	国債証券 5銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 36銘柄	100.0%	34.4%
英ポンド	国債証券 8銘柄	100.0%	5.0%
スウェーデンクローナ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.4%

豪ドル	国債証券	2銘柄	100.0%	1.6%
シンガポールドル	国債証券	2銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリングット	国債証券	2銘柄	100.0%	0.6%
イスラエルシェケル	国債証券	1銘柄	100.0%	0.5%
香港・オフショア人民元	国債証券	3銘柄	100.0%	2.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

先進国資本エマージング株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
預金	9,320,578	20,730,471
コール・ローン	88,487,353	52,904,810
株式	11,725,891,735	9,848,956,333
未収入金	15,224,117	-
未収配当金	45,330,842	39,875,545
流動資産合計	11,884,254,625	9,962,467,159
資産合計	11,884,254,625	9,962,467,159
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,631	44,654
未払解約金	31,264,071	26,006,577
未払利息	67	24
流動負債合計	31,266,769	26,051,255
負債合計	31,266,769	26,051,255
純資産の部		
元本等		
元本	8,973,539,554	7,152,048,317
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2,879,448,302	2,784,367,587
元本等合計	11,852,987,856	9,936,415,904
純資産合計	11,852,987,856	9,936,415,904
負債純資産合計	11,884,254,625	9,962,467,159

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
1.	期首	2020年 7月18日	2021年 7月20日
	期首元本額	10,799,135,623円	8,973,539,554円
	期首からの追加設定元本額	650,136,539円	272,568,995円
	期首からの一部解約元本額	2,475,732,608円	2,094,060,232円
	元本の内訳		
	スマート・ラップ・グローバル・インカム（毎月分配型）	20,582,861円	6,578,273円
	スマート・ラップ・グローバル・インカム（1年決算型）	32,914,391円	11,899,798円
	先進国資本エマージング株式ファンド（1年決算型）	7,195,916,822円	5,655,574,578円
	先進国資本エマージング株式ファンド（年2回決算型）	17,583,243円	13,220,589円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08	4,009,959円	3,020,215円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11	1,442,372円	979,968円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2017-02	1,386,712円	928,275円

時間分散型バランスファンド（成長指向）2017-02	2,352,845円	-円
グローバル・メガピース	1,697,350,349円	1,459,846,621円
計	8,973,539,554円	7,152,048,317円
2. 受益権の総数	8,973,539,554口	7,152,048,317口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19日	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19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 7月19日現在	2022年 7月19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	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品

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

（有価証券に関する注記）

（2021年 7月19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	89,490,592
合計	89,490,592

（2022年 7月19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	22,670,775
合計	22,670,775

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

（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 7月19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	5,060,061	-	5,062,692	2,631

	ポーランドズロチ	5,060,061	-	5,062,692	2,631
	合計	5,060,061	-	5,062,692	2,631

(2022年 7月19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	3,873,157	-	3,917,811	44,654
	インドネシアルピア	3,873,157	-	3,917,811	44,654
	合計	3,873,157	-	3,917,811	44,654

(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 7月19日現在		2022年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.3209円	1口当たり純資産額	1.3893円
(1万口当たり純資産額)	(13,209円)	(1万口当たり純資産額)	(13,893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	VALE SA-SP ADR	40,315	12.70	512,000.50	
	AMBEV SA-ADR	720,878	2.64	1,903,117.92	
	BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	64,194	15.33	984,094.02	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	197,999	1.71	338,578.29	
	TELEFONICA BRASIL-ADR	160,047	8.73	1,397,210.31	
	TIM SA-ADR	104,940	11.87	1,245,637.80	
	ENEL CHILE SA-ADR	952,047	1.16	1,104,374.52	
米ドル小計		2,240,420		7,485,013.36 (1,034,803,097)	
メキシコペソ	WALMART DE MEXICO -SER V	462,800	71.69	33,178,132.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	727,000	28.51	20,726,770.00	
メキシコペソ小計		1,189,800		53,904,902.00 (364,273,156)	
ブラジルリアル	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	420,000	16.94	7,114,800.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	177,650	41.88	7,439,982.00	
ブラジルリアル小計		597,650		14,554,782.00 (370,007,301)	
チリペソ	ENEL AMERICAS SA	13,892,700	86.24	1,198,106,448.00	
チリペソ小計		13,892,700		1,198,106,448.00 (174,940,314)	
ユーロ	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	584,987	0.76	450,205.99	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	48,068	16.57	796,486.76	
ユーロ小計		633,055		1,246,692.75 (174,661,654)	
トルコリラ	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	41,284	261.30	10,787,509.20	
トルコリラ小計		41,284		10,787,509.20 (85,437,072)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	56,142	642.50	36,071,235.00	
チェココルナ小計		56,142		36,071,235.00 (205,966,751)	
ポーランドズロ	SANTANDER BANK POLSKA SA	16,057	229.60	3,686,687.20	

チ	ORANGE POLSKA SA	495,410	6.19	3,070,551.18	
ポーランドズロチ小計		511,467		6,757,238.38	(197,793,151)
香港ドル	BYD CO LTD-H	41,000	293.80	12,045,800.00	
	TRIP.COM GROUP LTD	39,850	204.00	8,129,400.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	56,800	103.90	5,901,520.00	
	JD.COM INC - CL A	10,500	244.00	2,562,000.00	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	75,000	52.50	3,937,500.00	
	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	592,000	19.92	11,792,640.00	
	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	304,800	20.60	6,278,880.00	
	BEIGENE LTD	83,300	107.00	8,913,100.00	
香港ドル小計		1,203,250		59,560,840.00	(1,048,866,392)
マレーシアリングット	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	26,000	134.00	3,484,000.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	1,000,700	6.42	6,424,494.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	636,900	3.87	2,464,803.00	
マレーシアリングット小計		1,663,600		12,373,297.00	(383,919,896)
タイパーツ	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	200,500	205.00	41,102,500.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	222,000	71.00	15,762,000.00	
タイパーツ小計		422,500		56,864,500.00	(214,379,165)
フィリピンペソ	GLOBE TELECOM INC	31,980	2,252.00	72,018,960.00	
	PLDT INC	26,950	1,686.00	45,437,700.00	
フィリピンペソ小計		58,930		117,456,660.00	(288,062,458)
インドネシアルピア	VALE INDONESIA TBK PT	1,900,000	4,880.00	9,272,000,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,472,400	6,025.00	20,921,210,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	6,268,900	4,980.00	31,219,122,000.00	
インドネシアルピア小計		11,641,300		61,412,332,000.00	(571,134,687)
韓国ウォン	POSCO HOLDINGS INC	2,510	226,500.00	568,515,000.00	
	S1 CORPORATION	8,439	63,000.00	531,657,000.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	16,854	34,650.00	583,991,100.00	
韓国ウォン小計		27,803		1,684,163,100.00	(176,837,125)

台湾ドル	CHAILEASE HOLDING CO LTD	75,082	186.50	14,002,793.00	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD(N)	4,704	186.50	877,296.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	71,000	178.00	12,638,000.00	
台湾ドル小計		150,786		27,518,089.00	(127,172,096)
インドルピー	ACC LTD	27,587	2,174.00	59,974,138.00	
	AMBUJA CEMENTS LIMITED	190,037	370.70	70,446,715.90	
	JSW STEEL LTD	27,736	585.95	16,251,909.20	
	SIEMENS LTD	48,339	2,714.70	131,225,883.30	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	11,757	8,704.80	102,342,333.60	
	SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	150,000	126.10	18,915,000.00	
	ITC LTD	120,888	295.30	35,698,226.40	
	NESTLE INDIA LIMITED	5,877	18,625.40	109,461,475.80	
	COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	34,896	1,552.90	54,189,998.40	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	43,768	2,553.50	111,761,588.00	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	18,471	1,845.65	34,091,001.15	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	56,451	542.75	30,638,780.25	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	112,785	523.05	58,992,194.25	
	MPHASIS LTD	36,857	2,159.00	79,574,263.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	127,895	663.05	84,800,779.75	
INDUS TOWERS LTD	327,906	226.10	74,139,546.60		
ADANI GREEN ENERGY LTD	11,500	2,093.25	24,072,375.00		
インドルピー小計		1,352,750		1,096,576,208.60	(1,908,042,602)
南アフリカランド	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	16,195	1,240.83	20,095,241.85	
	KUMBA IRON ORE LTD	44,052	466.13	20,533,958.76	
	MULTICHOICE GROUP LTD	44,972	119.02	5,352,567.44	
	ABSA GROUP LTD	33,100	160.22	5,303,282.00	
	VODACOM GROUP LTD	151,992	139.07	21,137,527.44	
南アフリカランド小計		290,311		72,422,577.49	(583,725,974)
香港・オフショア人民元	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	314,700	18.57	5,843,979.00	
	GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD-A	133,700	44.55	5,956,335.00	
	ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	276,024	52.68	14,540,944.32	
	CHONGQING BREWERY CO-A	86,900	130.42	11,333,498.00	

	HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	206,631	27.16	5,612,097.96	
	SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	156,090	81.39	12,704,165.10	
	YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	376,334	48.70	18,327,465.80	
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	647,214	4.18	2,705,354.52	
	BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	254,992	14.31	3,648,935.52	
	BANK OF NANJING CO LTD -A	245,221	10.18	2,496,349.78	
	BANK OF NINGBO CO LTD -A	110,199	32.64	3,596,895.36	
香港・オフショア人民元小計		2,808,005		86,766,020.36	(1,774,460,558)
サウジアラビア リアル	SAUDI BRITISH BANK	106,154	42.00	4,458,468.00	
サウジアラビアリアル小計		106,154		4,458,468.00	(164,472,884)
合 計		38,887,907		9,848,956,333	(9,848,956,333)

(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

該当事項はありません。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 7銘柄	100.0%	10.5%
メキシコペソ	株式 2銘柄	100.0%	3.7%
ブラジルリアル	株式 2銘柄	100.0%	3.8%
チリペソ	株式 1銘柄	100.0%	1.8%
ユーロ	株式 2銘柄	100.0%	1.8%
トルコリラ	株式 1銘柄	100.0%	0.9%
チェココルナ	株式 1銘柄	100.0%	2.1%
ポーランドズロチ	株式 2銘柄	100.0%	2.0%
香港ドル	株式 8銘柄	100.0%	10.6%

マレーシアリングット	株式	3銘柄	100.0%	3.9%
タイパーツ	株式	2銘柄	100.0%	2.2%
フィリピンペソ	株式	2銘柄	100.0%	2.9%
インドネシアルピア	株式	3銘柄	100.0%	5.8%
韓国ウォン	株式	3銘柄	100.0%	1.8%
台湾ドル	株式	3銘柄	100.0%	1.3%
インドルピー	株式	17銘柄	100.0%	19.3%
南アフリカランド	株式	5銘柄	100.0%	5.9%
香港・オフショア人民元	株式	11銘柄	100.0%	18.0%
サウジアラビアリアル	株式	1銘柄	100.0%	1.7%

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。

インデックス マザーファンド コモディティ

貸借対照表

（単位：円）

	2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
資産の部		
流動資産		
預金	15,089	243,653
コール・ローン	46,631	84,892
投資信託受益証券	11,046,925	8,181,917
流動資産合計	11,108,645	8,510,462
資産合計	11,108,645	8,510,462
負債の部		
流動負債		
未払金	-	204,958
流動負債合計	-	204,958
負債合計	-	204,958
純資産の部		
元本等		
元本	10,798,976	5,440,444
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	309,669	2,865,060
元本等合計	11,108,645	8,305,504

純資産合計	11,108,645	8,305,504
負債純資産合計	11,108,645	8,510,462

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

(貸借対照表に関する注記)

		2021年 7月19日現在	2022年 7月19日現在
1.	期首	2020年 7月18日	2021年 7月20日
	期首元本額	15,522,060円	10,798,976円
	期首からの追加設定元本額	6,807,885円	6,213,140円
	期首からの一部解約元本額	11,530,969円	11,571,672円
	元本の内訳		
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08	5,055,727円	3,336,116円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11	1,734,822円	1,081,514円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2017-02	1,732,107円	1,022,814円
時間分散型バランスファンド（成長指向）2017-02	2,276,320円	- 円	
計	10,798,976円	5,440,444円	
2.	受益権の総数	10,798,976口	5,440,444口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年 7月18日 至 2021年 7月19日	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19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 7月19日現在	2022年 7月19日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

(有価証券に関する注記)

(2021年 7月19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
投資信託受益証券	2,815,456
合計	2,815,456

(2022年 7月19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
投資信託受益証券	1,978,247
合計	1,978,247

(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 7月19日現在		2022年 7月19日現在	
1口当たり純資産額	1.0287円	1口当たり純資産額	1.5266円
(1万口当たり純資産額)	(10,287円)	(1万口当たり純資産額)	(15,266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
ユーロ	投資信託受益証券	ISH DIV COMDTY SWAP DE-ETF	2,010	58,400.55	
ユーロ小計			2,010	58,400.55 (8,181,917)	
合計				8,181,917 (8,181,917)	

(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	組入投資信託 受益証券時価比率	合計金額に 対する比率
ユーロ	投資信託受益証券 1銘柄	100.0%	100.0%

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。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2022年 7月29日現在です。

【時間分散型バランスファンド(安定指向) 2016 - 11】

【純資産額計算書】

資産総額	112,234,242円
負債総額	84,902円
純資産総額(-)	112,149,340円
発行済口数	91,044,107口
1口当たり純資産額(/)	1.2318円

(参考)

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)

純資産額計算書

資産総額	64,181,852円
負債総額	383,492円
純資産総額(-)	63,798,360円
発行済口数	27,103,556口
1口当たり純資産額(/)	2.3539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	259,755,481,317円
負債総額	2,119,212,612円
純資産総額(-)	257,636,268,705円
発行済口数	60,560,083,515口
1口当たり純資産額(/)	4.2542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)

純資産額計算書

資産総額	33,675,363円
負債総額	404,787円
純資産総額（ - ）	33,270,576円
発行済口数	20,258,344口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6423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	61,765,294,043円
負債総額	942,400,930円
純資産総額（ - ）	60,822,893,113円
発行済口数	20,088,979,402口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0277円

インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）

純資産額計算書

資産総額	8,536,656円
負債総額	6,270円
純資産総額（ - ）	8,530,386円
発行済口数	7,307,768口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1673円

海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	7,617,377,760円
負債総額	25,920,334円
純資産総額（ - ）	7,591,457,426円
発行済口数	5,603,051,911口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3549円

FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

純資産額計算書

資産総額	3,711,944,770円
負債総額	331,073円
純資産総額(-)	3,711,613,697円
発行済口数	3,033,834,396口
1口当たり純資産額(/)	1.2234円

ゴールド・マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	160,679,418,495円
負債総額	240,771,534円
純資産総額(-)	160,438,646,961円
発行済口数	107,476,271,413口
1口当たり純資産額(/)	1.4928円

インデックス マザーファンド TOPIX

純資産額計算書

資産総額	44,091,338,770円
負債総額	222,693,398円
純資産総額(-)	43,868,645,372円
発行済口数	16,895,017,821口
1口当たり純資産額(/)	2.5965円

ソブリン(円ヘッジ)マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	53,128,399,067円
負債総額	395,357,459円
純資産総額(-)	52,733,041,608円
発行済口数	43,237,943,315口
1口当たり純資産額(/)	1.2196円

インデックス マザーファンド Jリート

純資産額計算書

資産総額	38,640,066,615円
負債総額	603,005,760円
純資産総額（ - ）	38,037,060,855円
発行済口数	26,043,572,361口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4605円

インデックス マザーファンド 海外先進国債券

純資産額計算書

資産総額	84,052,341円
負債総額	500,796円
純資産総額（ - ）	83,551,545円
発行済口数	66,627,401口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2540円

先進国資本エマージング株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	9,768,464,134円
負債総額	27,875,068円
純資産総額（ - ）	9,740,589,066円
発行済口数	7,131,740,104口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3658円

インデックス マザーファンド コモディティ

純資産額計算書

資産総額	8,378,727円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	8,378,727円
発行済口数	5,440,444口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5401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ます。
- ・ 前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等(当該他の振替機関等の上位機関を含みます。)に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ・ 前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【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7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7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いません。

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7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7月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	876	240,194
株式投資信託	808	203,909
単位型	313	10,237
追加型	495	193,671
公社債投資信託	68	36,284
単位型	55	1,717
追加型	13	34,567

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)
負債の部			
流動負債			
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	
固定負債			
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	
純資産の部			
株主資本			
資本金		17,363	
資本剰余金			
資本準備金		5,220	
資本剰余金合計		5,220	
利益剰余金			
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金		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	
評価・換算差額等			
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うち 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 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
 当事業年度末における本源的価値の合計額 1,738百万円

- 3 株式公開価格が737円(割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。)を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

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

5【その他】

（1）定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

（2）訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

（1）受託会社

名 称	資本金の額 （2022年3月末現在）	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

<再信託受託会社の概要>

名称：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2022年3月末現在）

事業の内容：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。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託者から再信託受託者（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2022年3月末現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
日興アセットマネジメント株式会社	17,363百万円	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。

(3) 投資顧問会社

名 称	資本金の額 (2022年3月末現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

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) 投資顧問会社

投資対象とする別に定める投資信託証券のうち、各投資信託証券（マザーファンドを含みます。）への投資比率についての投資助言を行ないます。

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。

(3) 投資顧問会社

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10月19日	有価証券報告書
2022年 4月19日	半期報告書

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10月5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」に掲げられている時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11の2021年7月20日から2022年7月19日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11の2022年7月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書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、継続企業的前提下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。