

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年6月21日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 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
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	グローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

グローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）（以下「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

（５）【申込手数料】

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

- ・販売会社における申込手数料率は3.3%（税抜3%）が上限となっております。

（６）【申込単位】

販売会社の照会先にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2023年6月22日から2023年12月21日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(9) 【払込期日】

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

(1 0) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

主として、日本を含む世界各国の株式、不動産投信（REIT）および債券などを実質的な投資対象とする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て運用を行ないます。

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 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (含む日本) 日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリーファンド	あり ()
不動産投信	日々	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) エマージング		
資産複合 (その他資産(投資 信託証券(株式、 不動産投信、その 他資産(株価指数 先物取引、国債先 物取引)))				
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 資産配分固定型(その他資産(投資信託証券(株式、不動産投信、その他資産(株価指数先物取引、国債先物取引))))

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式、不動産投信およびその他資産(株価指数先物取引、国債先物取引)に投資を行いません。

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

年1回

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

グローバル(含む日本)

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

ファンド・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。

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1

実質的に、世界の株式、REITおよび債券などに分散投資を行ない、収益の獲得をめざします。

■主要投資信託証券(グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け))を通じて、主として、世界(日本を含む)の資産(株式、REIT、債券)に投資を行ないます。

2

世界の株式やREITに加えて、株価指数先物取引や国債先物取引などを活用することで、信託財産の純資産総額の3倍相当額の投資を行ないます。

■主要投資信託証券は、各資産に投資を行なうマザーファンドの受益証券のほか、株価指数先物および国債先物の取引に係る権利などに投資を行ないます。

■世界の株式やREITなどの現物の組入総額と株価指数先物取引や国債先物取引の買建総額の組入合計額が、信託財産の純資産総額の3倍相当額となるように投資を行ないます。

3

年1回、決算を行ないます。

■毎年9月21日(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

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

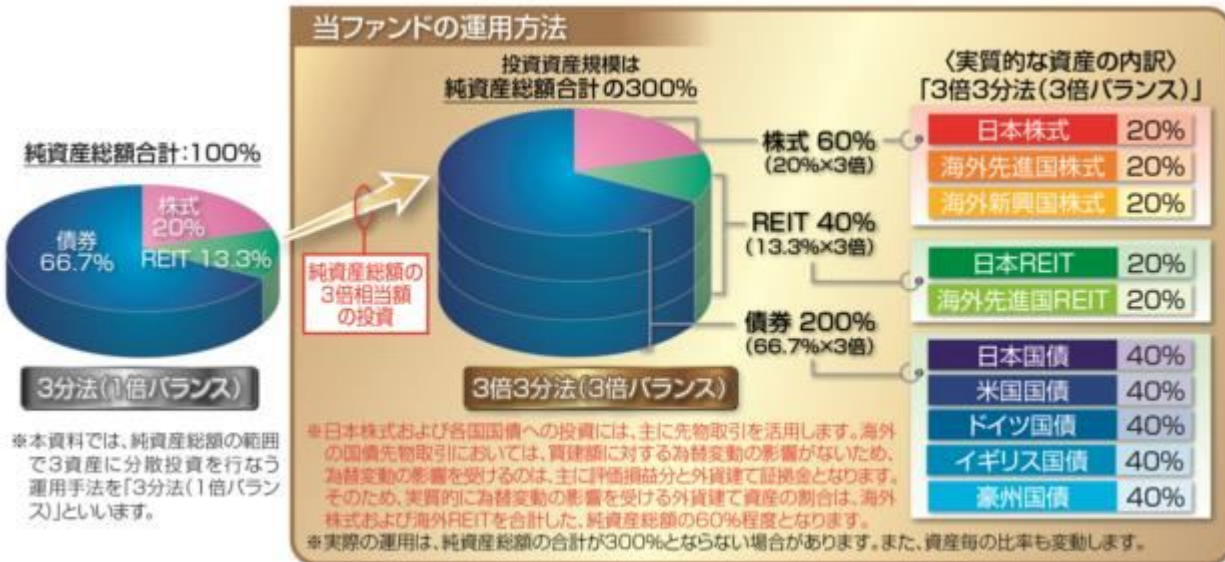
世界の株式、REIT、債券の3つの資産に対し、純資産総額の3倍相当額の投資を行なう運用手法を「3倍3分法」としています。

基準価額変動リスクの大きいファンドですので、ご投資の際には慎重にご判断ください。

※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。

投資対象資産と実質的な資産の内訳について

■当ファンドは、世界の株式やREITに加えて、日本株式および各国国債への投資には先物取引などを活用することで、純資産総額の3倍相当額の投資を行ないます。投資対象資産は世界の株式、REIT、債券の3資産とし、幅広く分散投資を行ないます。



※上記はイメージ図です。

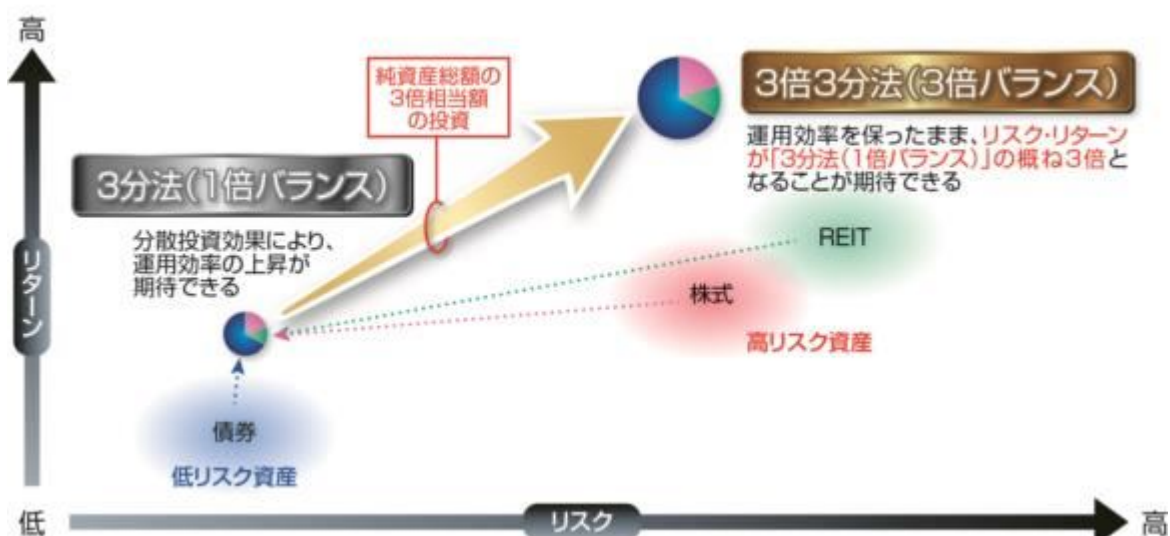
※上記の「3分法(1倍バランス)」の資産配分比率は、「3倍3分法(3倍バランス)」の実質的な資産配分比率の1/3(端数は四捨五入)として計算したものであり、実在するポートフォリオではありません。

※上記は資料作成時現在のものであり、投資対象資産および資産配分比率は、今後変更される可能性があります。

「3倍3分法(3倍バランス)」のリスク・リターンイメージ

- 一般に、値動きの異なる複数の資産に分散投資を行なうことで、運用効率(リスクあたりのリターン)が上昇し、価格変動リスクの低減とリターンの安定化が期待できます。さらに、当ファンドでは、実質的に先物取引などを活用して純資産総額の3倍相当額の投資を行なうことにより、運用効率を保ったまま、より高いリスク・リターンが期待できます。

〈各資産のリスク・リターンのイメージ〉



※上記は「3倍3分法(3倍バランス)」についてのご理解を深めていただくためのイメージであり、実際のリスク・リターンなどの運用成果を保証するものではありません。

※実際の累積のパフォーマンスが3倍になる訳ではありません。

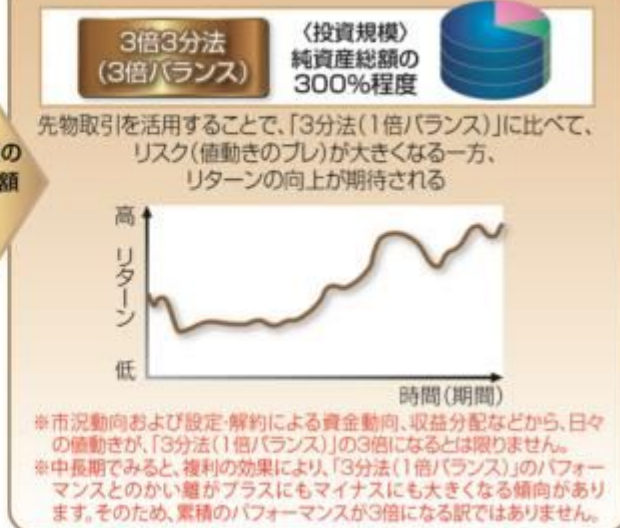
当ファンドの値動きのイメージ

- 当ファンドは、世界の株式やREITに加えて、日本株式および各国国債への投資には先物取引などを活用することで、純資産総額の3倍相当額の投資を行ないます。そのため、「3分法(1倍バランス)」の運用手法に比べて、日々の基準価額の変動が大きくなります。

「3分法(1倍バランス)」の値動きのイメージ



「3倍3分法(3倍バランス)」に期待される運用成果

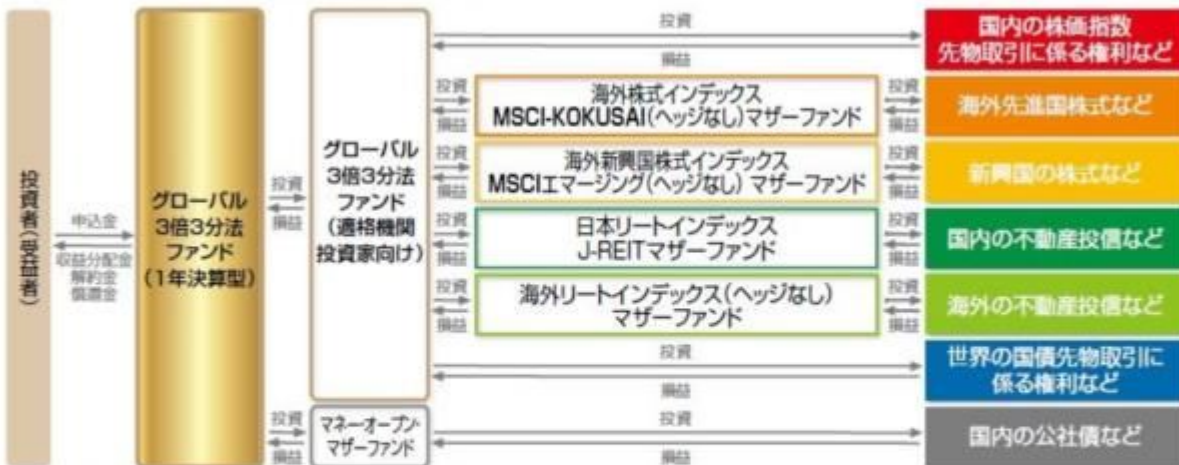


※当ファンドのリスクについては、後述の「投資リスク」をご覧ください。

※上記は当ファンドの値動きについてのご理解を深めていただくためのイメージであり、実際の運用成果などを保証するものではありません。

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。

(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。

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】

2018年10月 4日

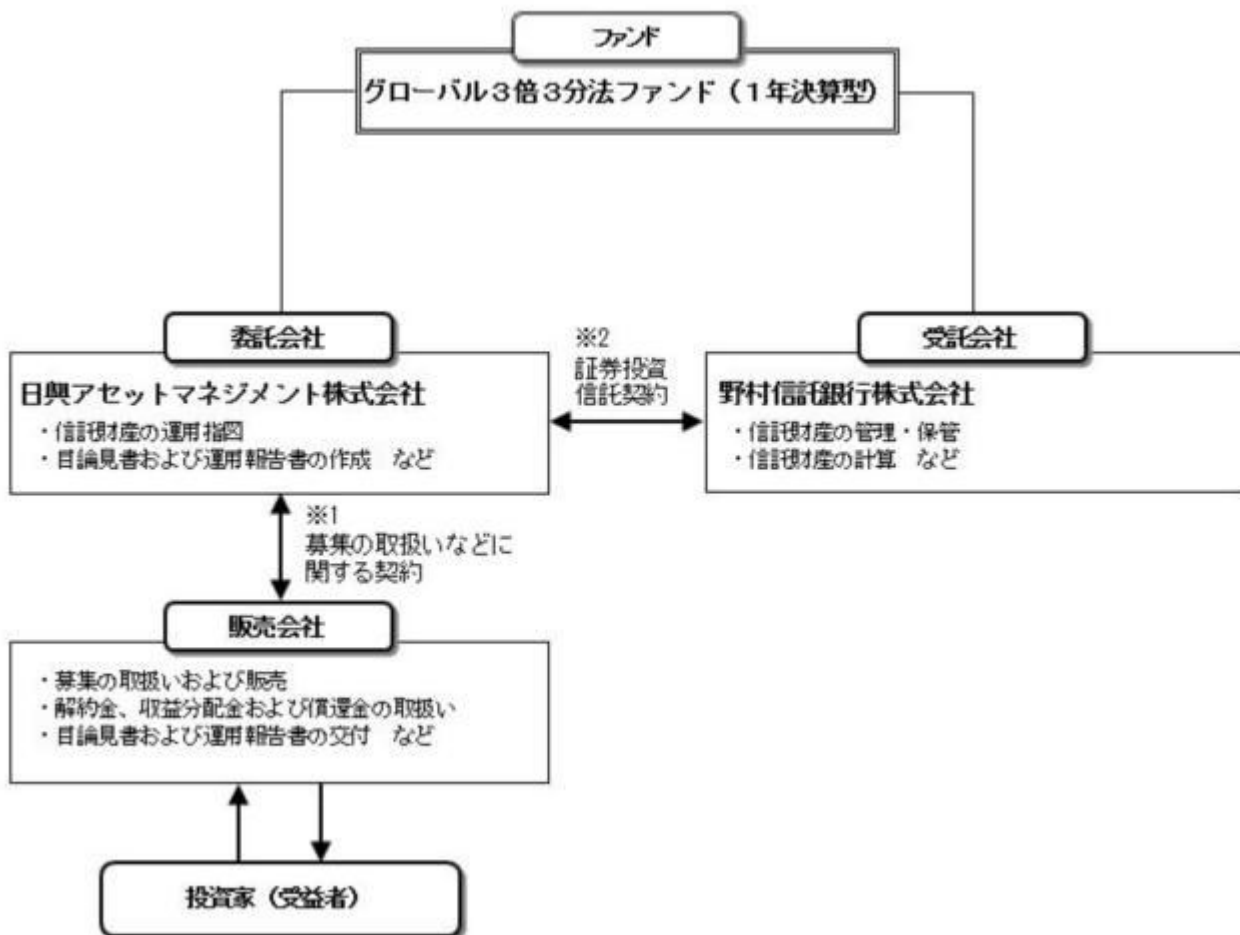
- ・ ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2020年12月24日

- ・ 信託期間を無期限に変更

(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。

<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いません。

委託会社の概況（2023年3月末現在）

- 1) 資本金
17,363百万円
- 2) 沿革
1959年：日興證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株式、不動産投信および債券等を実質的な投資対象とする別に定める投資信託証券の一部、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。
- ・投資信託証券の合計組入率は、高位を保つことを原則とします。各投資信託証券への投資比率は、原則として、市況環境および投資対象ファンドの収益性等を勘案して決定します。なお、資金動向等によっては、各投資信託証券への投資比率を引き下げることがあります。
- ・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。
- ・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) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 2) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)の証券の性質を有するもの
- 3) 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

<グローバル3倍3分法ファンド（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	<p>以下に掲げる各マザーファンドの受益証券のほか、株価指数先物取引に係る権利および国債先物取引に係る権利等を主要投資対象とします。</p> <p>証券投資信託 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド</p> <p>証券投資信託 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド</p> <p>証券投資信託 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド</p> <p>証券投資信託 日本リートインデックスJ-REITマザーファンド</p>
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、上に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行なうとともに、株価指数先物取引に係る権利および国債先物取引に係る権利に投資を行なうことで、実質的に日本を含む世界各国の株式、不動産投信および債券に投資し、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。 ・各投資対象資産の組入比率は、原則として、市況環境および投資対象資産のリスク水準等を勘案して決定します。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき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	純資産総額に対して年率0.088%（税抜0.08%）

その他の報酬	<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、主要投資対象である各マザーファンドの運用において利用する指数の標章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（2018年10月5日設定）
決算日	毎月21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（税引後配当込み、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）およびコ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（税引後配当込み、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等の知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

（ご参考）＜海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	主として金融商品取引所に上場されている新興国の株式に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（税引後配当込み、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。
主な投資対象	新興国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンド等を含みます。）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、新興国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンド等を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（税引後配当込み、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、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0.3%（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（2006年5月17日設定）
決算日	毎年5月16日（休業日の場合は翌営業日）

* MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が発表している、世界の新興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等の知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

（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、税引後配当込み、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、税引後配当込み、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 サービスーズ 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等の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。

（ご参考）＜日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み） [*] の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として、東京証券取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）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。 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は行ないません。 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）

^{*} 東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）は、株式会社東京証券取引所が発表している、東京証券取引所に上場しているＪ－ＲＥＩＴ全銘柄に投資した場合の投資成果（市場における価格の変動と分配金の受取りを合わせた投資成果）を表す指数です。

東証ＲＥＩＴ指数の指数値および東証ＲＥＩＴ指数に係る標章または商標は、株式会社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、利用など東証ＲＥＩＴ指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証ＲＥＩＴ指数に係る標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有します。ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、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

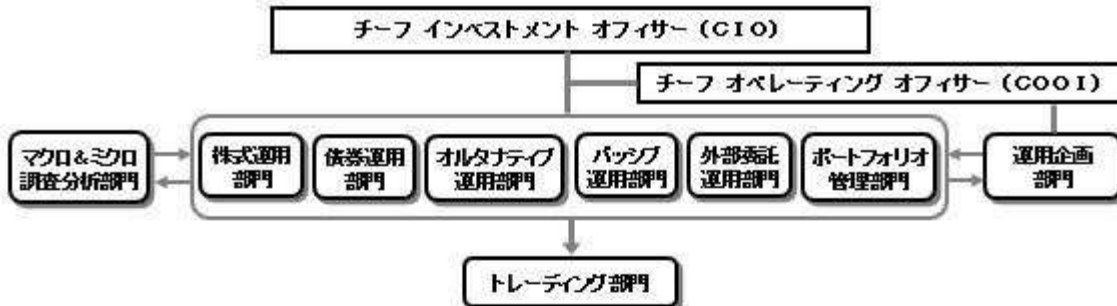
るいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

<マネー・オープン・マザーファンド>

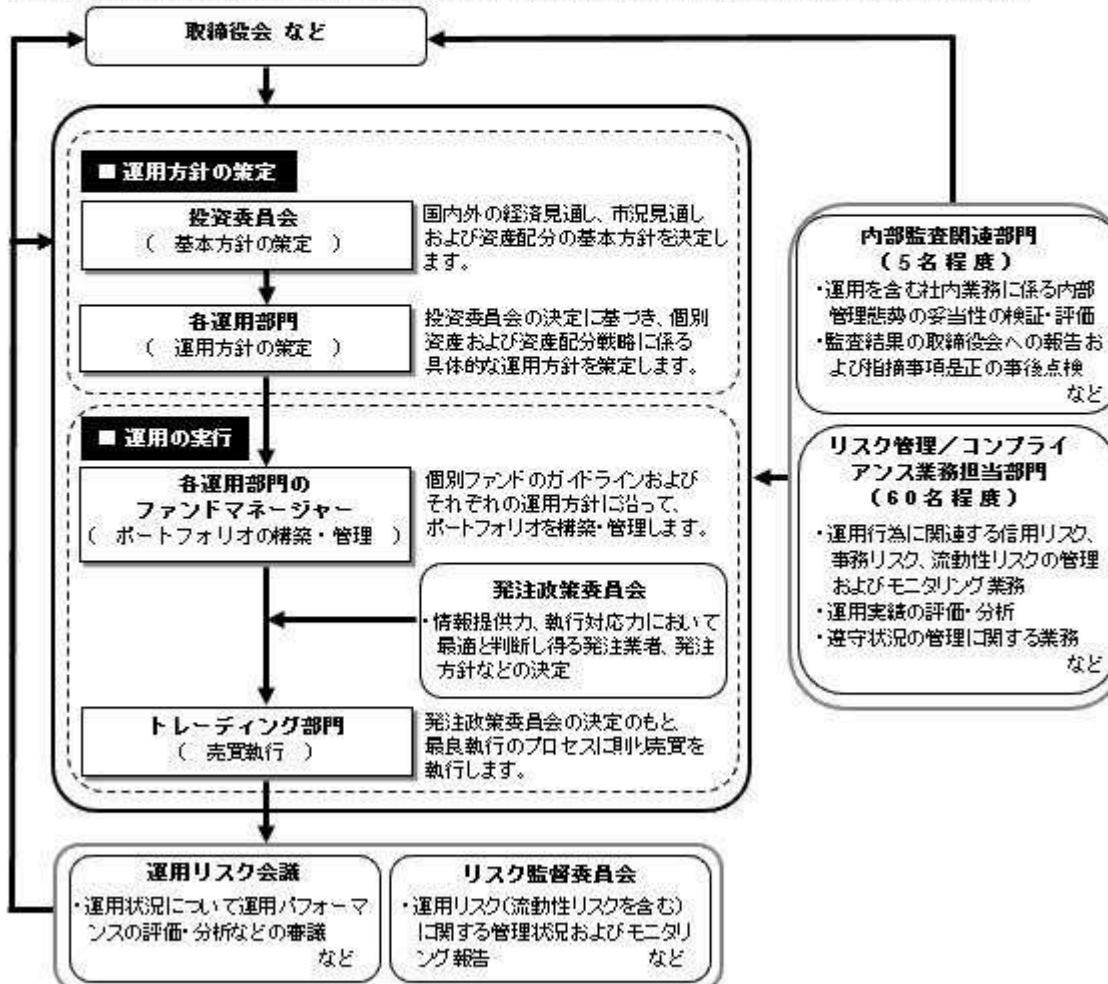
運用の基本方針	
基本方針	公社債への投資により、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の国債および格付の高い公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> わが国の国債および格付の高い公社債に投資を行ない、利息等収益の確保をめざして運用を行ないます。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: 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	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2003年3月28日設定）
決算日	毎年1月15日（休業日の場合は翌営業日）

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

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

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



上記体制は2023年3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) 信託財産に属する外貨建資産の時価総額と投資信託証券またはマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
 - 6) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
 - ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の範囲内
 - 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。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

- ・ 投資者の皆様は投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様へ帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・ 当ファンドは、主に株式、不動産投信、株価指数先物取引および国債先物取引にかかる権利を実質的な投資対象としますので、株式、不動産投信、株価指数先物取引および国債先物取引にかかる権利の価格の下落や、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。
- ・ 一般に新興国の株式は、先進国の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。
- ・ 一般に不動産投信は、不動産や不動産証券化商品に投資して得られる収入や売却益などを収益源と

しており、不動産を取り巻く環境や規制、賃料水準、稼働率、不動産市況や長短の金利動向、マクロ経済の変化など様々な要因により価格が変動します。また、不動産の老朽化や立地条件の変化、火災、自然災害などに伴う不動産の滅失・毀損などにより、その価格が影響を受ける可能性もあります。不動産投信の財務状況、業績や市況環境が悪化する場合、不動産投信の分配金や価格は下がり、ファンドに損失が生じるリスクがあります。

- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。
- ・一般に株価指数先物取引および国債先物取引にかかる権利の価格は、投資対象となる原資産の値動きや先物市場の需給および金利の動きなどの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、当該先物取引にかかる権利の値動きに予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。

流動性リスク

- ・市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。
- ・一般に新興国の株式は、先進国の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。
- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト(債務不履行)が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落(価格がゼロになることもあります。)し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
- ・格付を有する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

- ・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。

デリバティブリスク

金融契約に基づくデリバティブとよばれる金融派生商品を用いることがあり、その価値は基礎となる原資産価値などに依存し、またそれらによって変動します。デリバティブの価値は、種類によっては、基礎となる原資産の価値以上に変動することがあります。

レバレッジリスク

株価指数先物取引および国債先物取引などを積極的に用いてレバレッジ取引を行ないます。したがって、株式や債券の影響を大きく受けます。

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を及ぼす可能性があります。

・ 法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

(2) リスク管理体制



全社リスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別会議においては、法令遵守状況や各種リスク（運用リスク（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2023年3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	5.2%	5.9%	14.3%	5.9%	-0.3%	2.7%	1.7%
最大値	37.6%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	7.9%	15.7%
最小値	-31.8%	-16.0%	-12.4%	-19.4%	-5.5%	-6.1%	-9.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2018年4月から2023年3月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。ただし、当ファンドは直近1年間の騰落率が5年分ないため、設定日以降算出できる値を使用しています。

<各資産クラスの指数>

日本株……TOPIX(東証株価指数)配当込み

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

TOPIX(東証株価指数)配当込み

当指数は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

当指数は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下「NFRC」)が公表している指数で、その知的財産権はNFRCに帰属します。なお、NFRCは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2018年10月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

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

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

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

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

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

（2）【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

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	0.396%（税抜0.36%）
投資対象とする投資信託証券	0.088%（税抜0.08%）程度 [*]
実質的負担	0.484%（税抜0.44%）程度

・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0.396%（税抜0.36%）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）0.088%（税抜0.08%）程度^{*}がかかり、受益者が実質的に負担する信託報酬率（年率）は0.484%（税抜0.44%）程度となります。

^{*}この他に、実質的に不動産投信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。

^{*}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。

受益者が実質的に負担する信託報酬率（年率）は、投資対象とする投資信託証券の組入比率や当該投資信託証券の変更などにより変動します。

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
0.36%	0.14%	0.20%	0.02%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

（４）【その他の手数料等】

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。

ファンドおよび投資対象である「別に定めるマザーファンド」の運用において利用する指数の標章使用料。

ファンドおよび投資対象である「別に定めるマザーファンド」の運用において利用する指数の指数値、構成銘柄、構成比率等の情報および投資対象市場の動向や特性等に関する情報の入手に要する費用。

ファンドおよび投資対象である「別に定めるマザーファンド」の運用において、クリアリング機構を利用した場合に生じる諸費用（当該関連費用を受託会社から請求された場合も含みます。）

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

組入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。

「グローバル3倍3分法ファンド（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、主要投資対象である各マザーファンドの運用において利用する指数の標章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。

「マネー・オープン・マザーファンド」

- ・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

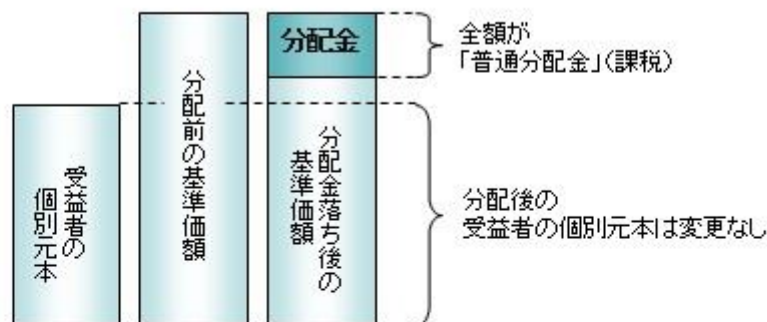
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

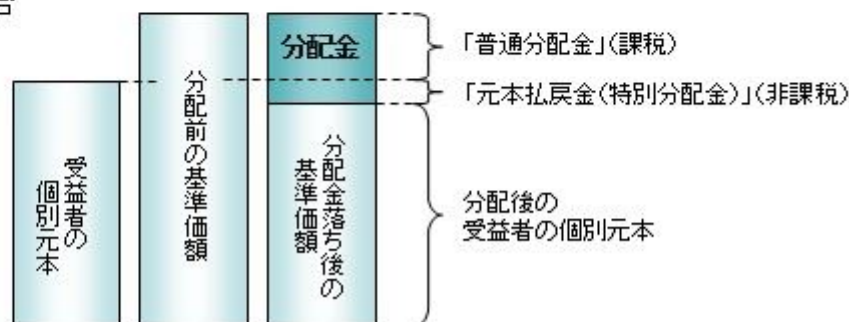
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<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2023年6月21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】

【グローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）】

以下の運用状況は2023年3月31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	155,442,523,172	98.61
親投資信託受益証券	日本	163,552,712	0.10
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		2,030,107,399	1.29
合計（純資産総額）		157,636,183,283	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	投資信託受益証券	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	126,561,246,680	1.2557	158,934,942,200	1.2282	155,442,523,172	98.61
日本	親投資信託受益証券	マネー・オープン・マザーファンド	161,056,339	1.0157	163,584,923	1.0155	163,552,712	0.10

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	98.61
親投資信託受益証券	0.10
合計	98.71

【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 (2019年 9月24日)	181,245	181,245	1.2436	1.2436
第2計算期間末 (2020年 9月23日)	355,637	355,637	1.2205	1.2205
第3計算期間末 (2021年 9月21日)	214,680	214,680	1.5638	1.5638
第4計算期間末 (2022年 9月21日)	153,892	153,892	1.2252	1.2252
2022年 3月末日	189,243		1.4553	
4月末日	178,049		1.3889	
5月末日	172,081		1.3563	
6月末日	160,163		1.2645	
7月末日	177,185		1.4015	
8月末日	163,667		1.2991	
9月末日	137,622		1.0953	
10月末日	150,256		1.1917	
11月末日	157,553		1.2342	
12月末日	142,078		1.0958	
2023年 1月末日	155,737		1.1935	
2月末日	151,420		1.1507	
3月末日	157,636		1.1941	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2018年10月 4日～2019年 9月24日	0.0000
第2期	2019年 9月25日～2020年 9月23日	0.0000
第3期	2020年 9月24日～2021年 9月21日	0.0000
第4期	2021年 9月22日～2022年 9月21日	0.0000
当中間期	2022年 9月22日～2023年 3月21日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2018年10月 4日～2019年 9月24日	24.36
第2期	2019年 9月25日～2020年 9月23日	1.86
第3期	2020年 9月24日～2021年 9月21日	28.13
第4期	2021年 9月22日～2022年 9月21日	21.65
当中間期	2022年 9月22日～2023年 3月21日	3.84

(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	2018年10月 4日～2019年 9月24日	149,835,081,121	4,090,945,074
第2期	2019年 9月25日～2020年 9月23日	265,601,504,023	119,947,170,483
第3期	2020年 9月24日～2021年 9月21日	27,271,595,688	181,389,655,088
第4期	2021年 9月22日～2022年 9月21日	21,374,040,998	33,046,143,927
当中間期	2022年 9月22日～2023年 3月21日	12,393,625,188	6,215,961,378

(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）

グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）

以下の運用状況は2023年 3月31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	191,033,961,197	80.74
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		45,583,367,935	19.26
合計（純資産総額）		236,617,329,132	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	45,459,415,000	19.21
債券先物取引	買建	日本	94,352,440,000	39.88
	買建	アメリカ	91,002,126,073	38.46
	買建	ドイツ	93,733,157,208	39.61
	買建	イギリス	96,729,570,708	40.88
	買建	オーストラリア	94,629,518,169	39.99

(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	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	11,260,048,407	4.2412	47,756,117,303	4.3473	48,950,808,439	20.69
日本	親投資信託受益証券	海外新興国株式インデックスMSCI エマージング (ヘッジなし) マザーファンド	22,083,949,919	2.1183	46,780,431,113	2.2121	48,851,905,615	20.65
日本	親投資信託受益証券	日本リートインデックスJ - REIT マザーファンド	19,466,492,559	2.3800	46,330,252,290	2.4019	46,756,568,477	19.76
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	17,612,050,427	2.5878	45,576,464,094	2.6388	46,474,678,666	19.64

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	80.74
合計	80.74

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	日本	大阪取引所	東証株価指数先物 2023年06月	買建	2,269	日本円	43,995,910,000	43,995,910,000	45,459,415,000	45,459,415,000	19.21
債券先物取引	日本	大阪取引所	東証長期国債標準先物 2023年06月	買建	637	日本円	94,454,360,000	94,454,360,000	94,352,440,000	94,352,440,000	39.88
	アメリカ	シカゴ商品取引所	TNOTE10Y2306	買建	5,948	米ドル	678,815,500	90,642,233,715	681,510,717.24	91,002,126,073	38.46
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUND10Y 2306	買建	4,757	ユーロ	647,047,140	94,287,709,240	643,241,540	93,733,157,208	39.61
	オーストラリア	シドニー先物取引所	AUSTR10Y2306	買建	8,626	豪ドル	1,068,740,180.04	95,855,306,748	1,055,073,231.9	94,629,518,169	39.99
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	GILT10Y 2306	買建	5,651	英ポンド	592,507,350	98,095,516,866	584,256,890	96,729,570,708	40.88

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

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

以下の運用状況は2023年 3月31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	178,767,527,894	66.62
	カナダ	9,551,301,463	3.56
	ドイツ	7,031,141,945	2.62
	イタリア	1,468,727,853	0.55
	フランス	9,270,656,925	3.45
	オランダ	5,354,781,399	2.00
	スペイン	2,138,612,432	0.80
	ベルギー	665,102,293	0.25
	オーストリア	142,869,254	0.05
	ルクセンブルク	170,450,543	0.06
	フィンランド	991,797,908	0.37
	アイルランド	5,037,175,252	1.88
	ポルトガル	151,968,246	0.06
	イギリス	11,451,105,487	4.27
	スイス	8,782,170,404	3.27
	スウェーデン	2,525,737,038	0.94
	ノルウェー	536,096,928	0.20
	デンマーク	2,464,922,864	0.92
	ケイマン	541,565,661	0.20
	オーストラリア	5,594,406,584	2.08
	バミューダ	160,805,515	0.06
	ニュージーランド	222,927,420	0.08
	香港	1,772,569,918	0.66
	シンガポール	932,638,269	0.35
	イスラエル	620,501,215	0.23
	ジャージー	850,644,930	0.32
	アラブ首長国連邦	0	0.00
マン島	51,447,770	0.02	
小計		257,249,653,410	95.86
投資証券	アメリカ	4,898,897,002	1.83
	カナダ	13,133,750	0.00
	フランス	103,725,275	0.04
	ベルギー	30,683,561	0.01
	イギリス	103,898,836	0.04
	オーストラリア	330,489,720	0.12
	香港	89,296,784	0.03
	シンガポール	123,715,218	0.05
小計		5,693,840,146	2.12
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		5,415,277,623	2.02
合計（純資産総額）		268,358,771,179	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	4,494,619,800	1.67
	買建	ドイツ	935,544,258	0.35

(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		4,361,901,505	1.63

(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	632,234	20,300.55	12,834,702,263	21,679.93	13,706,789,369	5.11
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	281,404	33,443.86	9,411,237,872	37,929.19	10,673,427,612	3.98
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	365,030	15,889.11	5,800,005,060	13,620.06	4,971,730,502	1.85
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	97,710	18,036.51	1,762,347,531	36,564.51	3,572,719,239	1.33
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	237,380	13,888.39	3,296,827,523	13,471.84	3,197,945,783	1.19
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	217,520	13,956.78	3,035,879,399	13,529.25	2,942,884,548	1.10
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	106,705	29,258.03	3,121,978,846	26,075.73	2,782,411,666	1.04
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	89,340	18,347.70	1,639,184,016	27,752.87	2,479,441,870	0.92
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	163,841	14,165.34	2,320,864,370	14,620.19	2,395,388,139	0.89
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	37,095	71,874.61	2,666,188,983	62,767.11	2,328,346,012	0.87
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	103,981	22,784.29	2,369,134,289	20,487.50	2,130,311,559	0.79
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	51,695	38,813.80	2,006,479,606	40,737.33	2,105,916,398	0.78
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	116,740	16,466.17	1,922,261,827	17,191.98	2,006,992,621	0.75
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	64,642	26,108.54	1,687,708,824	29,691.73	1,919,332,862	0.72
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	93,939	17,555.75	1,649,169,869	19,688.99	1,849,564,830	0.69

スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	109,590	15,820.70	1,733,790,925	16,185.75	1,773,797,263	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	34,060	41,872.97	1,426,193,561	47,971.98	1,633,925,904	0.61
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	73,131	23,365.69	1,708,756,973	21,683.93	1,585,767,975	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	40,370	38,886.44	1,569,845,656	38,104.12	1,538,263,357	0.57
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	70,226	20,049.38	1,407,987,889	21,087.05	1,480,859,707	0.55
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	16,052	72,892.12	1,170,064,379	90,885.56	1,458,895,073	0.54
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	32,049	46,920.02	1,503,739,742	45,492.33	1,457,983,867	0.54
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	100,543	13,123.57	1,319,483,171	14,143.49	1,422,029,679	0.53
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	16,540	62,671.88	1,036,593,031	84,624.63	1,399,691,504	0.52
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	65,905	15,923.59	1,049,444,245	21,116.97	1,391,714,303	0.52
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	163,092	7,888.54	1,286,559,125	8,258.83	1,346,949,184	0.50
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	耐久消費財・アパレル	11,034	96,720.77	1,067,216,981	120,510.44	1,329,712,195	0.50
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	54,661	23,815.21	1,301,763,432	24,146.22	1,319,857,073	0.49
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	223,180	6,086.93	1,358,483,010	5,391.94	1,203,373,482	0.45
アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	15,554	69,042.57	1,073,888,244	75,173.38	1,169,246,816	0.44

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	5.20
		素材	4.29
		資本財	6.67
		商業・専門サービス	1.53
		運輸	1.83
		自動車・自動車部品	1.93
		耐久消費財・アパレル	1.76
		消費者サービス	2.08

	メディア・娯楽	5.26
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.01
	生活必需品流通・小売り	1.81
	食品・飲料・タバコ	4.21
	家庭用品・パーソナル用品	1.82
	ヘルスケア機器・サービス	4.60
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.76
	銀行	5.37
	金融サービス	6.46
	保険	3.11
	ソフトウェア・サービス	8.54
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.57
	電気通信サービス	1.44
	公益事業	3.06
	半導体・半導体製造装置	5.23
	不動産管理・開発	0.31
投資証券		2.12
合計		97.98

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 EMINI2306	買建	165	米ドル	32,514,337.5	4,341,639,486	33,660,000	4,494,619,800	1.67
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2306	買建	165	ユーロ	6,222,050	906,677,126	6,420,150	935,544,258	0.35

(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	26,900,000.00	3,541,566,700	3,571,163,210	1.33
	ユーロ	買建	5,450,000.00	774,105,310	790,738,295	0.29

(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。

海外新興国株式インデックスMSCIEマージング(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2023年 3月31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	370,927,512	0.37
	メキシコ	2,348,194,760	2.36
	ブラジル	4,510,215,241	4.54
	チリ	508,203,874	0.51
	コロンビア	86,311,109	0.09
	ペルー	252,086,273	0.25
	オランダ	60,027,099	0.06
	ルクセンブルク	79,081,263	0.08
	ギリシャ	349,384,800	0.35
	トルコ	558,226,718	0.56
	チェコ	167,203,369	0.17
	キプロス	264	0.00
	ハンガリー	173,411,658	0.17
	ポーランド	573,474,061	0.58
	ロシア	4,518,236	0.00
	ケイマン	11,422,688,472	11.50
	バミューダ	266,150,572	0.27
	香港	1,977,343,443	1.99
	シンガポール	22,326,901	0.02
	マレーシア	1,323,205,889	1.33
	タイ	1,939,329,180	1.95
	フィリピン	654,885,875	0.66
	インドネシア	1,741,494,314	1.75
	韓国	10,790,035,799	10.86
	台湾	13,552,350,658	13.64
	中国	15,990,401,606	16.10
	インド	11,765,955,185	11.85
	カタール	820,380,507	0.83
	エジプト	69,095,743	0.07
	南アフリカ	3,124,975,079	3.15
	英ヴァージン諸島	203	0.00
	アラブ首長国連邦	1,140,118,010	1.15
	クウェート	795,946,209	0.80
サウジアラビア	3,587,136,810	3.61	
小計	91,025,086,692	91.64	
社債券	インド	0	0.00
投資証券	メキシコ	74,059,569	0.07
	南アフリカ	32,115,547	0.03

	小計	106,175,116	0.11
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		8,197,512,554	8.25
合計（純資産総額）		99,328,774,362	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	8,294,786,790	8.35

(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		140,125,545	0.14

(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 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,568,355	2,213.06	5,683,924,225	2,342.76	6,017,052,202	6.06
中国	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	649,450	5,647.73	3,667,923,923	6,548.84	4,253,150,632	4.28
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	498,020	6,772.90	3,373,043,093	6,515.91	3,245,058,478	3.27
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	1,546,100	1,415.25	2,188,129,324	1,648.26	2,548,388,701	2.57
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	517,085	2,895.68	1,497,312,944	2,415.42	1,248,977,451	1.26
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	317,752	3,999.04	1,270,705,956	3,664.90	1,164,531,847	1.17
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	10,028,920	91.28	915,463,616	86.24	864,901,081	0.87
ブラジル	株式	VALE SA	素材	386,206	2,037.69	786,970,445	2,142.71	827,527,590	0.83
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	351,388	2,467.68	867,115,029	2,269.02	797,307,103	0.80
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	金融サービス	180,185	3,579.18	644,915,150	4,269.00	769,210,125	0.77
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	535,767	1,148.59	615,379,115	1,395.64	747,737,856	0.75
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	一般消費財・サービス流通・小売り	227,173	3,428.03	778,757,980	2,776.03	630,639,518	0.63
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,301,212	455.09	592,177,712	457.60	595,441,768	0.60

ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	232,110	1,974.84	458,381,696	2,542.99	590,254,569	0.59
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	658,000	792.17	521,248,164	864.10	568,583,064	0.57
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	22,740	13,089.95	297,665,618	24,848.52	565,055,445	0.57
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	159,432	3,508.21	559,322,162	3,406.86	543,162,822	0.55
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費財・サービス流通・小売り	52,870	6,055.58	320,158,911	10,207.03	539,645,845	0.54
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	203,852	3,579.96	729,782,858	2,618.80	533,848,637	0.54
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	57,210	11,190.94	640,233,959	9,155.28	523,773,569	0.53
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	94,576	5,562.69	526,097,890	5,147.79	486,857,955	0.49
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	207,575	2,379.16	493,854,636	2,311.65	479,842,617	0.48
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	84,380	5,941.77	501,366,624	5,505.53	464,557,465	0.47
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	5,775,800	66.28	382,827,524	78.54	453,645,771	0.46
韓国	株式	SAMSUNG SDI CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5,758	62,009.29	357,049,506	74,335.10	428,021,506	0.43
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA - H	銀行	5,888,575	76.85	452,582,660	72.63	427,703,101	0.43
中国	株式	BANK OF CHINA LTD - H	銀行	8,281,000	50.76	420,356,494	51.37	425,396,626	0.43
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE CV	電気通信サービス	2,660,649	138.51	368,538,360	142.64	379,539,505	0.38
韓国	株式	LG CHEM LTD	素材	5,207	55,075.15	286,776,355	71,757.59	373,641,823	0.38
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	228,145	2,599.86	593,147,271	1,633.63	372,705,771	0.38

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	4.34
		素材	7.90
		資本財	3.56
		商業・専門サービス	0.06
		運輸	1.88
		自動車・自動車部品	3.00
		耐久消費財・アパレル	1.45
		消費者サービス	2.66
		メディア・娯楽	6.93
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.41
		生活必需品流通・小売り	1.45
		食品・飲料・タバコ	3.71

	家庭用品・パーソナル用品	0.78
	ヘルスケア機器・サービス	0.98
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.51
	銀行	13.95
	金融サービス	2.96
	保険	2.46
	ソフトウェア・サービス	2.24
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.79
	電気通信サービス	2.80
	公益事業	2.37
	半導体・半導体製造装置	8.78
	不動産管理・開発	1.67
社債券		
投資証券		0.11
合計		91.75

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	ニューヨーク証券取引所	MINMSC1E2306	買建	1,245	米ドル	59,530,660	7,949,129,029	62,119,275	8,294,786,790	8.35

(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	1,050,000.00	140,124,600	140,125,545	0.14

(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。

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2023年 3月31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	40,153,468,536	76.02

	カナダ	940,970,825	1.78
	ドイツ	27,500,418	0.05
	イタリア	6,434,329	0.01
	フランス	941,343,306	1.78
	オランダ	103,203,846	0.20
	スペイン	221,356,092	0.42
	ベルギー	603,126,503	1.14
	アイルランド	20,379,271	0.04
	イギリス	2,472,569,217	4.68
	オーストラリア	3,475,751,622	6.58
	ニュージーランド	154,640,746	0.29
	香港	830,033,552	1.57
	シンガポール	2,034,263,769	3.85
	韓国	119,822,133	0.23
	イスラエル	66,663,458	0.13
	ガーンジー	117,111,690	0.22
	小計	52,288,639,313	99.00
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		528,301,154	1.00
合計（純資産総額）		52,816,940,467	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 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	292,166	14,937.68	4,364,284,708	16,279.97	4,756,455,935	9.01
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	29,296	84,330.98	2,470,560,550	93,739.39	2,746,189,325	5.20
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	50,045	39,761.54	1,989,866,580	39,343.27	1,968,934,408	3.73
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	198,602	8,437.70	1,675,745,710	8,360.31	1,660,374,942	3.14
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	103,500	13,356.93	1,382,442,767	14,362.48	1,486,517,384	2.81
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	149,601	10,112.94	1,512,906,766	9,473.95	1,417,312,918	2.68
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	317,662	3,913.47	1,243,163,704	4,247.58	1,349,297,712	2.55
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	91,038	16,112.56	1,466,855,640	12,481.04	1,136,249,748	2.15
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	44,308	24,438.43	1,082,818,159	21,800.10	965,919,176	1.83
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	541,743	1,620.30	877,788,753	1,673.61	906,669,428	1.72
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	42,395	21,374.58	906,175,572	21,208.56	899,137,321	1.70
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	107,877	9,019.49	972,996,044	7,815.51	843,113,869	1.60
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	49,844	18,237.73	909,041,760	16,555.04	825,169,882	1.56
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	183,855	4,456.96	819,435,296	4,099.37	753,689,855	1.43
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	126,661	6,385.82	808,835,053	5,936.74	751,953,906	1.42
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	39,213	19,930.76	781,545,273	18,610.07	729,756,914	1.38

アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	36,551	21,330.63	779,656,122	19,826.53	724,679,659	1.37
アメリカ	投資証券	MP CAREY INC	66,789	10,762.85	718,840,428	10,295.16	687,603,642	1.30
香港	投資証券	LINK REIT	801,080	1,046.96	838,701,788	857.30	686,769,088	1.30
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	92,046	6,436.25	592,431,292	6,915.51	636,545,834	1.21
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	20,474	33,269.03	681,150,281	27,264.15	558,206,318	1.06
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	81,599	6,041.23	492,959,061	6,798.01	554,711,006	1.05
アメリカ	投資証券	UDR INC	97,975	5,615.08	550,138,056	5,325.17	521,734,158	0.99
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	173,299	3,158.49	547,364,505	2,896.26	501,919,950	0.95
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	195,519	2,602.53	508,844,129	2,511.69	491,084,935	0.93
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	55,466	9,102.78	504,895,321	8,775.59	486,746,964	0.92
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	382,666	1,525.24	583,660,464	1,259.91	482,125,332	0.91
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	34,863	16,441.29	573,192,730	13,781.63	480,469,012	0.91
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	226,300	2,281.96	516,409,757	2,108.43	477,139,678	0.90
アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	59,731	7,683.61	458,949,820	7,755.42	463,239,135	0.88

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.00
合計	99.00

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。

日本リートインデックスJ - REITマザーファンド

以下の運用状況は2023年 3月31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	56,544,353,000	98.36
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		941,920,424	1.64
合計(純資産総額)		57,486,273,424	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	6,579	652,978.03	4,295,942,459	551,000	3,625,029,000	6.31
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	5,642	595,839.55	3,361,726,761	528,000	2,978,976,000	5.18
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	28,456	101,495.49	2,888,155,663	96,700	2,751,695,200	4.79
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	18,238	159,528.24	2,909,476,041	148,500	2,708,343,000	4.71
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	9,507	314,695.2	2,991,807,266	280,300	2,664,812,100	4.64
日本	投資証券	G L P 投資法人 投資証券	18,203	152,671.06	2,779,071,305	143,100	2,604,849,300	4.53
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	8,501	290,223.14	2,467,186,913	271,500	2,308,021,500	4.01
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	11,237	176,664.28	1,985,176,514	168,000	1,887,816,000	3.28
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	12,616	138,608.43	1,748,683,952	143,000	1,804,088,000	3.14
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,639	334,935.88	1,888,703,427	316,500	1,784,743,500	3.10
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	24,822	41,403.97	1,027,729,343	55,700	1,382,585,400	2.41
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	18,187	65,382.32	1,189,108,253	75,100	1,365,843,700	2.38
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	3,857	382,917.14	1,476,911,408	349,000	1,346,093,000	2.34
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	8,605	166,830.36	1,435,575,247	144,200	1,240,841,000	2.16
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	16,947	75,627.33	1,281,656,361	71,900	1,218,489,300	2.12
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	1,947	632,638.78	1,231,747,704	597,000	1,162,359,000	2.02
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,978	396,718.77	1,181,428,505	378,000	1,125,684,000	1.96
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	3,803	306,809.97	1,166,798,315	294,500	1,119,983,500	1.95
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	6,904	163,946.13	1,131,884,081	153,700	1,061,144,800	1.85
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,228	496,652.28	1,106,541,279	465,000	1,036,020,000	1.80
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	3,282	316,187.78	1,037,728,293	306,500	1,005,933,000	1.75
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,093	505,665.21	1,058,357,294	475,000	994,175,000	1.73
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	6,632	146,610.21	972,318,912	147,600	978,883,200	1.70
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	6,474	147,114.95	952,422,186	144,900	938,082,600	1.63
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	7,815	112,006.92	875,334,079	108,900	851,053,500	1.48
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,697	315,570.52	851,093,692	315,500	850,903,500	1.48
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	4,136	203,270.38	840,726,291	204,800	847,052,800	1.47
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,276	155,632.49	821,117,017	149,600	789,289,600	1.37
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,938	428,617.97	830,661,628	390,500	756,789,000	1.32
日本	投資証券	N T T 都市開発リート投資法人 投資証券	5,421	142,035.98	769,977,047	134,900	731,292,900	1.27

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.36
合計	98.36

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。

マネー・オープン・マザーファンド

以下の運用状況は2023年 3月31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(%)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		310,823,518	100.00
合計(純資産総額)		310,823,518	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

該当事項はありません。

ロ. 種類別の投資比率

該当事項はありません。

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

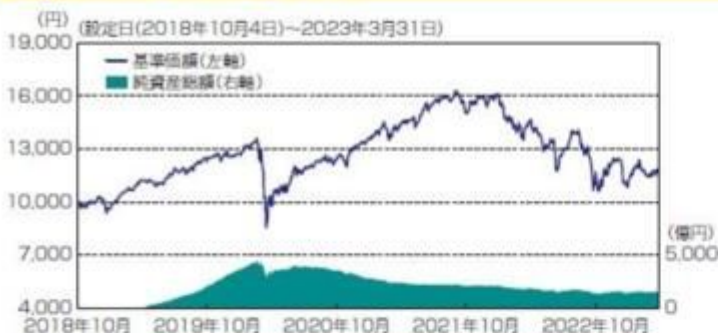
該当事項はありません。

参考情報

運用実績

2023年3月31日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 11,941円

純資産総額…………… 1,576.36億円

※基準価額は、運用管理費用(個托報酬)控除後の1万口当たりの値です。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2019年9月	2020年9月	2021年9月	2022年9月	設定未累計
0円	0円	0円	0円	0円

主要な資産の状況

<資産構成比>

資産	比率	資産の内訳	比率
株式	59.7%	日本株式(先物)	18.9%
		海外先進国株式	20.4%
		海外新興国株式	20.4%
不動産投信(REIT)	38.9%	日本REIT	19.5%
		海外先進国REIT	19.4%
債券	196.1%	日本国債(先物)	39.3%
		米国国債(先物)	37.9%
		ドイツ国債(先物)	39.1%
		イギリス国債(先物)	40.3%
		豪州国債(先物)	39.4%
合計	294.6%	合計	294.6%
現金その他	20.4%	現金その他	20.4%

<通貨別構成比>

通貨名	比率
日本円	34.2%
アメリカドル	32.9%
香港ドル	5.1%
ユーロ	4.2%
イギリスポンド	4.1%
その他	19.5%

※比率は当ファンド純資産総額比で、先物取引による繰玉は含みません。

※比率は当ファンドの純資産総額比です。

※先物取引にかかる証拠金は「現金その他」に含まれます。

※当ファンドはグローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)を通じて、主な投資対象ごとに次の資産へ投資を行ないます。

日本株式(先物)：国内の株価指数先物取引に係る権利など

海外先進国株式：海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド

海外新興国株式：海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド

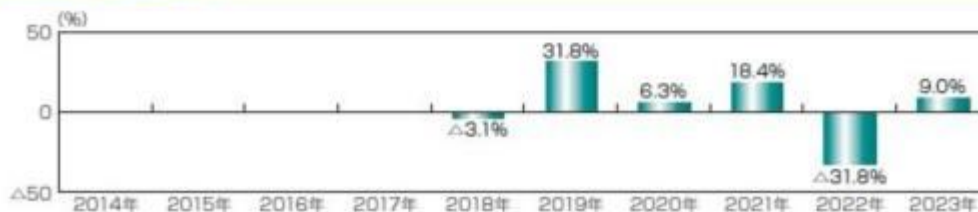
日本REIT：日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

海外先進国REIT：海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

世界国債(先物)*：世界の国債先物取引に係る権利など

*日本、米国、ドイツ、イギリス、豪州の国債(先物)を指します。

年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2018年は、設定時から2018年末までの騰落率です。

※2023年は、2023年3月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

(2) コースの選択

収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース＞と＜分配金受取りコース＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。

＜分配金再投資コース＞

収益分配金を自動的に再投資するコースです。なお、販売会社によっては、収益分配金を定期的に受け取るための「定期引出契約」を結ぶことができる場合があります。

＜分配金受取りコース＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 取扱時間

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

(5) 取得申込不可日

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

- ・ニューヨーク証券取引所の休業日
- ・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

(6) 申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。

(7) 申込単位

販売会社の照会先にお問い合わせください。

(8) 申込代金の支払い

取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。

(9) 受付の中止および取消

委託会社は、投資対象とする投資信託証券への投資ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、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、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

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

(10) 償還乗換

- ・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができる場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。

(11) 乗換優遇

受益者は、信託期間終了日の1年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができる場合があります。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

2【換金（解約）手続等】

<解約請求による換金>

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

- ・ニューヨーク証券取引所の休業日
- ・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。

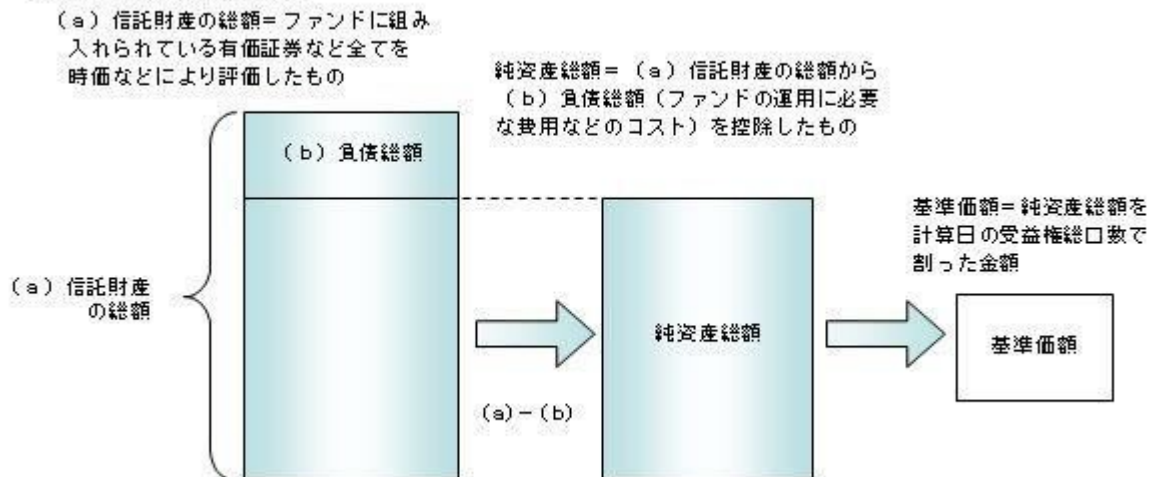
3【資産管理等の概要】

（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1万口当たり
に換算した価額で表示することがあります。

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

無期限とします（2018年10月4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9月22日から翌年9月21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) 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
 - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）
 - 二) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 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週間前までに知れ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、知れ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ため、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、原則として知れ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。

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4期計算期間(2021年9月22日から2022年9月21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】

【グローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2021年 9月21日現在	第4期 2022年 9月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,110,209,422	2,139,738,515
投資信託受益証券	213,401,254,405	152,323,345,432
親投資信託受益証券	218,252,051	163,584,923
流動資産合計	216,729,715,878	154,626,668,870
資産合計	216,729,715,878	154,626,668,870
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,583,419,677	381,514,918
未払受託者報酬	24,927,162	18,799,936
未払委託者報酬	423,762,815	319,600,009
未払利息	674	2,910
その他未払費用	17,069,689	13,999,549
流動負債合計	2,049,180,017	733,917,322
負債合計	2,049,180,017	733,917,322
純資産の部		
元本等		
元本	137,280,410,187	125,608,307,258
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	77,400,125,674	28,284,444,290
（分配準備積立金）	41,927,608,639	32,621,328,677
元本等合計	214,680,535,861	153,892,751,548
純資産合計	214,680,535,861	153,892,751,548
負債純資産合計	216,729,715,878	154,626,668,870

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自	2020年 9月24日	自	2021年 9月22日
	至	2021年 9月21日	至	2022年 9月21日
営業収益				
有価証券売買等損益		69,613,757,203		42,887,131,523
営業収益合計		69,613,757,203		42,887,131,523
営業費用				
支払利息		513,122		289,474
受託者報酬		57,034,512		41,185,675
委託者報酬		969,588,764		700,158,591
その他費用		23,491,109		18,476,646
営業費用合計		1,050,627,507		760,110,386
営業利益又は営業損失（ ）		68,563,129,696		43,647,241,909
経常利益又は経常損失（ ）		68,563,129,696		43,647,241,909
当期純利益又は当期純損失（ ）		68,563,129,696		43,647,241,909
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（ ）		26,645,313,706		3,114,037,751
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		64,238,851,490		77,400,125,674
剰余金増加額又は欠損金減少額		12,167,323,797		9,931,096,499
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		12,167,323,797		9,931,096,499
剰余金減少額又は欠損金増加額		40,923,865,603		18,513,573,725
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		40,923,865,603		18,513,573,725
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（ ）		77,400,125,674		28,284,444,290

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	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。
-----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

		第3期 2021年 9月21日現在	第4期 2022年 9月21日現在
1.	期首元本額	291,398,469,587円	137,280,410,187円
	期中追加設定元本額	27,271,595,688円	21,374,040,998円
	期中一部解約元本額	181,389,655,088円	33,046,143,927円
2.	受益権の総数	137,280,410,187口	125,608,307,258口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2020年 9月24日 至 2021年 9月21日		第4期 自 2021年 9月22日 至 2022年 9月21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 0円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益 0円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 38,628,508,558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 35,472,517,035円	C	信託約款に定める収益調整金 13,296,432,088円
D	信託約款に定める分配準備積立 金 3,299,100,081円	D	信託約款に定める分配準備積立 金 32,621,328,677円
E	分配対象収益(A+B+C+D) 77,400,125,674円	E	分配対象収益(A+B+C+D) 45,917,760,765円
F	分配対象収益(1万口当たり) 5,638円	F	分配対象収益(1万口当たり) 3,655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3期 自 2020年 9月24日 至 2021年 9月21日	第4期 自 2021年 9月22日 至 2022年 9月21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3期 2021年 9月21日現在	第4期 2022年 9月21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)

第3期(2021年 9月21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	47,864,830,895
親投資信託受益証券	21,487
合計	47,864,809,408

第4期（2022年 9月21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	41,795,966,056
親投資信託受益証券	16,107
合計	41,795,982,163

（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3期 2021年 9月21日現在		第4期 2022年 9月21日現在	
1口当たり純資産額	1.5638円	1口当たり純資産額	1.2252円
(1万口当たり純資産額)	(15,638円)	(1万口当たり純資産額)	(12,252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	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	121,112,622,591	152,323,345,432	
投資信託受益証券 合計		121,112,622,591	152,323,345,432	
親投資信託受益証券	マネー・オープン・マザーファンド	161,056,339	163,584,923	
親投資信託受益証券 合計		161,056,339	163,584,923	
合計		121,273,678,930	152,486,930,355	

(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、「グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）」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、「マネー・オープン・マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

(参考)

グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）

貸借対照表

(単位：円)

	2021年 9月21日現在	2022年 9月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	45,375,369,573	20,180,690,449
親投資信託受益証券	267,893,685,368	191,520,790,434
派生商品評価勘定	1,190,809,287	-
未収入金	-	6,107,894,268
差入委託証拠金	24,959,929,586	31,360,605,393
流動資産合計	339,419,793,814	249,169,980,544
資産合計	339,419,793,814	249,169,980,544

	2021年 9月21日現在	2022年 9月21日現在
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,890,337,132	12,311,825,809
前受金	1,960,534,500	359,337,000
未払金	-	6,719,400
未払解約金	1,327,752,729	1,104,539,099
未払受託者報酬	6,019,893	4,525,898
未払委託者報酬	18,059,714	13,577,727
未払利息	9,845	27,451
その他未払費用	108,862,335	59,919,935
流動負債合計	6,311,576,148	13,860,472,319
負債合計	6,311,576,148	13,860,472,319
純資産の部		
元本等		
元本	207,828,189,020	187,095,112,660
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	125,280,028,646	48,214,395,565
（分配準備積立金）	79,223,146,871	77,892,586,458
元本等合計	333,108,217,666	235,309,508,225
純資産合計	333,108,217,666	235,309,508,225
負債純資産合計	339,419,793,814	249,169,980,544

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	(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。 (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。
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 9月21日現在	2022年 9月21日現在
1. 期首	2020年 9月24日	2021年 9月22日
期首元本額	441,527,076,985円	207,828,189,020円
期首からの追加設定元本額	548,581,330円	4,169,792,469円
期首からの一部解約元本額	234,247,469,295円	24,902,868,829円
2. 受益権の総数	207,828,189,020口	187,095,112,660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 9月24日 至 2021年 9月21日	自 2021年 9月22日 至 2022年 9月21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 9月21日現在	2022年 9月21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 9月21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	74,417,123
合計	74,417,123

(2022年 9月21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	5,829,762,978
合計	5,829,762,978

(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

(株式関連)

(2021年 9月21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	66,703,650,500	-	67,728,725,000	1,025,074,500
	合計	66,703,650,500	-	67,728,725,000	1,025,074,500

(2022年 9月21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	49,365,843,000	-	49,223,760,000	142,083,000

合計	49,365,843,000	-	49,223,760,000	142,083,000
----	----------------	---	----------------	-------------

(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。

(債券関連)

(2021年 9月21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	債券先物取引 買建	682,804,209,546	-	680,082,930,851	2,721,278,695
	合計	682,804,209,546	-	680,082,930,851	2,721,278,695

(2022年 9月21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	債券先物取引 買建	494,804,372,635	-	482,637,120,776	12,167,251,859
	合計	494,804,372,635	-	482,637,120,776	12,167,251,859

(注) 1. 時価の算定方法

債券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. 債券先物取引の残高は、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。

（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 9月21日現在		2022年 9月21日現在	
1口当たり純資産額	1.6028円	1口当たり純資産額	1.2577円
(1万口当たり純資産額)	(16,028円)	(1万口当たり純資産額)	(12,577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M S C I - K O K U S A I (ヘッジなし) マザーファンド	11,171,147,481	47,954,384,791	
	日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファン ド	18,690,339,580	49,351,841,660	
	海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファン ド	16,106,034,269	46,543,217,830	
	海外新興国株式インデックスM S C Iエマー ジング (ヘッジなし) マザーファンド	21,079,525,162	47,671,346,153	
合計		67,047,046,492	191,520,790,434	

(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。

「グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）」は、「海外株式インデックスMSCI - KOK USA I（ヘッジなし）マザーファンド」「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド」「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」「日本リートインデックスJ - REIT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 - KOK USA I（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年 9月21日現在	2022年 9月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	509,577,101	785,377,435
コール・ローン	2,678,048,842	2,666,393,573
株式	230,286,439,176	245,881,606,322
投資証券	5,508,921,383	6,127,766,749
派生商品評価勘定	1,481,011	43,269,431
未収入金	6,309,354	17,909,430
未収配当金	320,273,998	387,994,139
差入委託証拠金	648,325,385	654,130,888
流動資産合計	239,959,376,250	256,564,447,967
資産合計	239,959,376,250	256,564,447,967
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	90,627,006	111,064,256
未払金	1,010,765,778	-
未払解約金	17,087,808	2,238,913,250
未払利息	581	3,627
流動負債合計	1,118,481,173	2,349,981,133
負債合計	1,118,481,173	2,349,981,133
純資産の部		
元本等		
元本	63,130,131,603	59,219,776,408
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	175,710,763,474	194,994,690,426
元本等合計	238,840,895,077	254,214,466,834
純資産合計	238,840,895,077	254,214,466,834
負債純資産合計	239,959,376,250	256,564,447,967

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

(貸借対照表に関する注記)

		2021年 9月21日現在	2022年 9月21日現在
1.	期首	2020年 9月24日	2021年 9月22日
	期首元本額	83,958,817,698円	63,130,131,603円
	期首からの追加設定元本額	5,420,850,888円	9,236,924,091円
	期首からの一部解約元本額	26,249,536,983円	13,147,279,286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）	24,758,008,069円	28,997,787,689円
	DCインデックスバランス（株式20）	114,352,450円	115,662,350円
	DCインデックスバランス（株式40）	305,369,605円	309,959,238円
	DCインデックスバランス（株式60）	606,615,975円	621,597,197円
	DCインデックスバランス（株式80）	640,372,110円	671,195,864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	1,518,573,220円	1,451,811,553円
	日興五大陸株式ファンド	3,981,513,687円	3,672,260,311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）	21,452,644円	14,402,554円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	104,560,092円	89,961,945円
	インデックスファンド先進国株式（適格機関投資家向け）	6,529,156,590円	5,897,044,747円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	17,708,482,493円	11,171,147,481円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	3,575,544円	3,002,254円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	3,059,996円	2,543,483円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	4,005,987円	2,733,134円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	3,451,077円	2,604,996円

		2021年 9月21日現在	2022年 9月21日現在
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	2,456,227,563円	1,851,295,893円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	20,500,206円	17,945,851円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	59,087,014円	50,225,952円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	89,902,021円	77,455,664円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	85,255,489円	75,228,743円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,116,609,771円	4,123,909,509円
	計	63,130,131,603円	59,219,776,408円
2.	受益権の総数	63,130,131,603口	59,219,776,408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 9月24日 至 2021年 9月21日	自 2021年 9月22日 至 2022年 9月21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 9月21日現在	2022年 9月21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

	2021年 9月21日現在	2022年 9月21日現在
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 9月21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	44,530,315,154
投資証券	1,168,661,956
合計	45,698,977,110

(2022年 9月21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	44,920,958,222
投資証券	1,275,323,603
合計	46,196,281,825

(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 9月21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	3,186,270,688	-	3,109,119,862	77,150,826
	合計	3,186,270,688	-	3,109,119,862	77,150,826

（2022年 9月21日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,402,471,887	-	2,291,552,226	110,919,661
	合計	2,402,471,887	-	2,291,552,226	110,919,661

（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 9月21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	3,126,486,606	-	3,114,225,129	12,261,477
	米ドル	2,460,107,200	-	2,453,608,420	6,498,780
	加ドル	40,218,840	-	40,226,689	7,849
	ユーロ	506,971,180	-	501,203,120	5,768,060
	英ポンド	52,054,710	-	52,053,248	1,462
	スイスフラン	34,720,518	-	34,724,722	4,204
	豪ドル	29,176,940	-	29,172,830	4,110
	香港ドル	3,237,218	-	3,236,100	1,118
	売建	25,940,153	-	25,673,845	266,308
	米ドル	3,237,218	-	3,237,100	118

	英ポンド	22,702,935	-	22,436,745	266,190
	合計	3,152,426,759	-	3,139,898,974	11,995,169

(2022年 9月21日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,094,976,751	-	1,137,892,915	42,916,164
	米ドル	867,002,360	-	901,929,400	34,927,040
	ユーロ	227,974,391	-	235,963,515	7,989,124
	売建	121,383,266	-	121,174,594	208,672
	英ポンド	89,420,711	-	89,122,596	298,115
	スイスフラン	17,054,500	-	17,153,135	98,635
	豪ドル	14,908,055	-	14,898,863	9,192
	合計	1,216,360,017	-	1,259,067,509	43,124,836

(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 9月21日現在		2022年 9月21日現在	
1口当たり純資産額	3.7833円	1口当たり純資産額	4.2927円
(1万口当たり純資産額)	(37,833円)	(1万口当たり純資産額)	(42,927円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	APA CORP	12,750	39.60	504,900.00	
	BAKER HUGHES CO	37,155	23.00	854,565.00	
	CHENIERE ENERGY INC	8,810	168.05	1,480,520.50	
	CHEVRON CORP	70,981	156.28	11,092,910.68	
	CONOCOPHILLIPS	49,276	112.07	5,522,361.32	
	COTERRA ENERGY INC	31,210	28.92	902,593.20	
	DEVON ENERGY CORPORATION	24,040	65.12	1,565,484.80	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	6,600	130.79	863,214.00	
	EOG RESOURCES INC	22,102	119.63	2,644,062.26	
	EQT CORP	13,400	46.56	623,904.00	
	EXXON MOBIL CORP	160,161	92.44	14,805,282.84	
	HALLIBURTON CO	33,827	27.62	934,301.74	
	HESS CORP	10,280	119.31	1,226,506.80	
	KINDER MORGAN INC	77,230	17.90	1,382,417.00	
	MARATHON OIL CORP	26,600	25.76	685,216.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	20,622	97.20	2,004,458.40	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	35,741	64.28	2,297,431.48	
	ONEOK INC	17,270	59.70	1,031,019.00	
	PHILLIPS 66	18,185	83.22	1,513,355.70	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,770	231.74	2,032,359.80	
	SCHLUMBERGER LTD	54,771	38.50	2,108,683.50	
	TARGA RESOURCES CORP	8,640	68.52	592,012.80	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	230	1,818.50	418,255.00	
	VALERO ENERGY CORP	15,682	107.42	1,684,560.44	
	WILLIAMS COS INC	44,904	31.83	1,429,294.32	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,505	244.89	2,082,789.45	
	ALBEMARLE CORP	4,260	287.65	1,225,389.00	
ALCOA CORP	6,700	43.53	291,651.00		
AMCOR PLC	57,320	11.44	655,740.80		
AVERY DENNISON CORP	3,200	175.83	562,656.00		

BALL CORP	11,780	55.27	651,080.60
CELANESE CORP	3,610	99.39	358,797.90
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,060	104.31	840,738.60
CLEVELAND-CLIFFS INC	19,100	14.56	278,096.00
CORTEVA INC	27,272	61.40	1,674,500.80
CROWN HOLDINGS INC	4,855	90.67	440,202.85
DOW INC	27,425	46.09	1,264,018.25
DUPONT DE NEMOURS INC	19,162	54.25	1,039,538.50
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,815	77.33	372,343.95
ECOLAB INC	9,840	156.52	1,540,156.80
FMC CORP	4,840	106.32	514,588.80
FREEPORT-MCMORAN INC	56,018	29.72	1,664,854.96
INTERNATIONAL PAPER CO	12,760	34.83	444,430.80
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,645	101.56	979,546.20
LINDE PLC	19,185	281.53	5,401,153.05
LYONDELLBASELL INDU-CL A	9,750	77.36	754,260.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,360	334.57	789,585.20
MOSAIC CO/THE	14,160	54.31	769,029.60
NEWMONT CORP	30,272	42.80	1,295,641.60
NUCOR CORP	10,209	113.52	1,158,925.68
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	119.41	427,487.80
PPG INDUSTRIES INC	8,774	116.66	1,023,574.84
RPM INTERNATIONAL INC	4,960	88.95	441,192.00
SEALED AIR CORP	5,746	48.08	276,267.68
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,521	218.83	2,083,480.43
STEEL DYNAMICS INC	7,510	75.85	569,633.50
VULCAN MATERIALS CO	4,923	162.19	798,461.37
WESTLAKE CORP	1,650	89.25	147,262.50
WESTROCK CO	9,989	34.40	343,621.60
3M CO	21,526	116.52	2,508,209.52
AERCAP HOLDINGS NV	4,850	43.68	211,848.00
ALLEGION PLC	3,340	91.10	304,274.00
AMETEK INC	8,763	118.86	1,041,570.18
BOEING CO/THE	20,942	145.94	3,056,275.48
CARLISLE COS INC	1,910	289.59	553,116.90

CARRIER GLOBAL CORP	32,268	37.81	1,220,053.08
CATERPILLAR INC	20,286	177.99	3,610,705.14
CUMMINS INC	5,365	212.69	1,141,081.85
DEERE & CO	11,030	355.59	3,922,157.70
DOVER CORP	5,350	122.69	656,391.50
EATON CORP PLC	15,186	139.18	2,113,587.48
EMERSON ELECTRIC CO	22,540	78.02	1,758,570.80
FASTENAL CO	21,616	47.77	1,032,596.32
FORTIVE CORP	12,674	63.27	801,883.98
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,050	58.74	296,637.00
GENERAC HOLDINGS INC	2,440	183.49	447,715.60
GENERAL DYNAMICS CORP	8,962	229.11	2,053,283.82
GENERAL ELECTRIC CO	41,557	66.59	2,767,280.63
HEICO CORP	2,000	152.06	304,120.00
HEICO CORP-CLASS A	2,480	121.04	300,179.20
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	25,806	177.01	4,567,920.06
HOWMET AEROSPACE INC	14,603	34.28	500,590.84
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,530	232.81	356,199.30
IDEX CORP	2,880	206.22	593,913.60
ILLINOIS TOOL WORKS	11,685	194.84	2,276,705.40
INGERSOLL-RAND INC	15,778	47.19	744,563.82
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5,770	56.42	325,543.40
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	26,334	53.09	1,398,072.06
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,400	228.47	1,690,678.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,270	235.31	298,843.70
LOCKHEED MARTIN CORP	9,096	420.58	3,825,595.68
MASCO CORP	9,149	48.33	442,171.17
NORDSON CORP	2,010	221.63	445,476.30
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,659	494.00	2,795,546.00
OTIS WORLDWIDE CORP	16,194	67.62	1,095,038.28
OWENS CORNING	3,550	80.76	286,698.00
PACCAR INC	13,274	86.54	1,148,731.96
PARKER HANNIFIN CORP	4,895	258.96	1,267,609.20
PENTAIR PLC	5,998	42.04	252,155.92
PLUG POWER INC	20,280	26.00	527,280.00

QUANTA SERVICES INC	5,300	138.57	734,421.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	56,546	85.15	4,814,891.90
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,303	236.15	1,016,153.45
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,470	40.64	262,940.80
SMITH (A.O.) CORP	5,020	51.22	257,124.40
SNAP-ON INC	2,080	217.24	451,859.20
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,806	84.36	489,794.16
TEXTRON INC	7,956	62.25	495,261.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	8,996	154.74	1,392,041.04
TRANSDIGM GROUP INC	1,980	584.71	1,157,725.80
UNITED RENTALS INC	2,785	289.76	806,981.60
WABTEC CORP	6,760	86.92	587,579.20
WW GRAINGER INC	1,667	531.00	885,177.00
XYLEM INC	7,018	94.84	665,587.12
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,070	95.74	485,401.80
CINTAS CORP	3,572	406.00	1,450,232.00
CLARIVATE PLC	13,360	10.38	138,676.80
COPART INC	8,140	110.09	896,132.60
COSTAR GROUP INC	14,910	70.78	1,055,329.80
EQUIFAX INC	4,854	177.84	863,235.36
JACOBS SOLUTIONS INC	4,880	119.19	581,647.20
LEIDOS HOLDINGS INC	4,960	93.11	461,825.60
REPUBLIC SERVICES INC	8,130	144.34	1,173,484.20
ROBERT HALF INTL INC	4,485	76.61	343,595.85
ROLLINS INC	9,015	35.76	322,376.40
TRANSUNION	7,270	65.50	476,185.00
VERISK ANALYTICS INC	5,800	182.33	1,057,514.00
WASTE CONNECTIONS INC	9,566	144.01	1,377,599.66
WASTE MANAGEMENT INC	15,854	169.70	2,690,423.80
AMERCO	375	527.42	197,782.50
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,930	102.50	505,325.00
CSX CORP	82,849	29.47	2,441,560.03
DELTA AIR LINES INC	6,225	32.75	203,868.75
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,527	90.00	587,430.00
FEDEX CORP	9,353	157.40	1,472,162.20

GRAB HOLDINGS LTD - CL A	38,100	2.95	112,395.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,280	167.15	548,252.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,180	48.18	297,752.40
LYFT INC-A	10,570	16.87	178,315.90
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,080	229.59	2,084,677.20
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,655	253.58	926,834.90
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	35.09	191,942.30
UBER TECHNOLOGIES INC	54,310	31.49	1,710,221.90
UNION PACIFIC CORP	23,881	213.27	5,093,100.87
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	27,817	175.68	4,886,890.56
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	2,920	28.80	84,096.00
APTIV PLC	10,610	93.03	987,048.30
BORGWARNER INC	9,120	36.42	332,150.40
FORD MOTOR COMPANY	150,375	13.09	1,968,408.75
GENERAL MOTORS CORP	52,615	39.06	2,055,141.90
LEAR CORP	2,500	133.25	333,125.00
LUCID GROUP INC	16,510	15.34	253,263.40
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	10,770	35.75	385,027.50
TESLA INC	100,385	308.73	30,991,861.05
DR HORTON INC	12,876	71.93	926,170.68
GARMIN LTD	5,865	85.46	501,222.90
HASBRO INC	5,158	75.00	386,850.00
LENNAR CORP-CL A	9,880	76.88	759,574.40
LULULEMON ATHLETICA INC	4,470	331.57	1,482,117.90
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,118	98.20	207,987.60
NEWELL BRANDS INC	16,366	15.61	255,473.26
NIKE INC -CL B	48,368	102.42	4,953,850.56
NVR INC	118	4,084.53	481,974.54
PULTE GROUP INC	8,850	39.98	353,823.00
VF CORP	13,010	38.39	499,453.90
WHIRLPOOL CORP	2,259	142.89	322,788.51
AIRBNB INC-CLASS A	14,000	116.71	1,633,940.00
ARAMARK	8,880	36.92	327,849.60
BOOKING HOLDINGS INC	1,548	1,896.63	2,935,983.24
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,970	45.17	360,004.90

CARNIVAL CORP	30,727	10.42	320,175.34
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,080	1,699.63	1,835,600.40
DARDEN RESTAURANTS INC	4,833	132.75	641,580.75
DOMINO'S PIZZA INC	1,375	332.35	456,981.25
EXPEDIA GROUP INC	5,922	104.63	619,618.86
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,800	131.68	1,422,144.00
LAS VEGAS SANDS CORP	12,900	39.28	506,712.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,633	157.01	1,669,487.33
MCDONALD'S CORP	28,031	255.40	7,159,117.40
MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,080	34.57	486,745.60
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,748	49.49	432,938.52
STARBUCKS CORP	43,524	90.79	3,951,543.96
VAIL RESORTS INC	1,520	226.50	344,280.00
WYNN RESORTS LTD	4,180	67.80	283,404.00
YUM! BRANDS INC	10,804	115.25	1,245,161.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	29,820	75.04	2,237,692.80
ALPHABET INC-CL A	228,590	101.14	23,119,592.60
ALPHABET INC-CL C	214,480	101.83	21,840,498.40
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	19,410	8.71	169,061.10
CABLE ONE INC	210	1,006.98	211,465.80
CHARTER COMMUNICATION-A	4,486	362.94	1,628,148.84
COMCAST CORP-CLASS A	170,004	33.84	5,752,935.36
DISH NETWORK CORP-A	9,279	16.16	149,948.64
ELECTRONIC ARTS INC	10,884	120.54	1,311,957.36
FOX CORP - CLASS A	12,624	34.24	432,245.76
FOX CORP- CLASS B	5,466	31.70	173,272.20
IAC INC	3,090	60.59	187,223.10
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,096	26.88	405,780.48
LIBERTY BROADBAND-C	5,230	88.94	465,156.20
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	3,325	40.49	134,629.25
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	5,726	40.18	230,070.68
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	7,680	61.64	473,395.20
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,420	86.86	557,641.20
MATCH GROUP INC	9,892	51.81	512,504.52
META PLATFORMS INC-CLASS A	87,260	146.09	12,747,813.40

NETFLIX INC	16,870	242.85	4,096,879.50
NEWS CORP - CLASS A	14,750	16.46	242,785.00
OMNICOM GROUP	7,807	65.41	510,655.87
PARAMOUNT GLOBAL	22,823	22.61	516,028.03
PINTEREST INC- CLASS A	20,950	24.76	518,722.00
ROBLOX CORP -CLASS A	12,670	36.41	461,314.70
ROKU INC	4,700	68.40	321,480.00
SEA LTD-ADR	13,870	57.44	796,692.80
SIRIUS XM HOLDINGS INC	30,280	6.00	181,680.00
SNAP INC - A	40,460	11.12	449,915.20
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	6,220	121.69	756,911.80
THE WALT DISNEY CO.	69,122	107.57	7,435,453.54
TWITTER INC	24,800	41.68	1,033,664.00
WARNER BROS DISCOVERY INC	86,760	13.21	1,146,099.60
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	9,840	41.75	410,820.00
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,158	165.87	357,947.46
AMAZON.COM INC	347,880	122.19	42,507,457.20
AUTOZONE INC	747	2,131.47	1,592,208.09
BATH & BODY WORKS INC	9,270	37.55	348,088.50
BEST BUY CO INC	7,784	70.92	552,041.28
BURLINGTON STORES INC	2,585	133.47	345,019.95
CARMAX INC	6,249	82.19	513,605.31
CHEWY INC - CLASS A	3,410	32.49	110,790.90
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	8,660	245.76	2,128,281.60
DOLLAR TREE INC	8,706	142.62	1,241,649.72
DOORDASH INC - A	6,960	57.66	401,313.60
EBAY INC	21,437	39.90	855,336.30
ETSY INC	5,160	103.97	536,485.20
GENUINE PARTS CO	5,321	157.15	836,195.15
HOME DEPOT INC	39,015	274.17	10,696,742.55
LKQ CORP	10,260	49.19	504,689.40
LOWE'S COS INC	24,252	190.41	4,617,823.32
MERCADOLIBRE INC	1,740	905.69	1,575,900.60
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,495	701.07	1,749,169.65
POOL CORP	1,540	326.97	503,533.80

ROSS STORES INC	13,162	88.30	1,162,204.60
TARGET CORP	17,700	160.03	2,832,531.00
TJX COMPANIES INC	44,606	63.72	2,842,294.32
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,230	190.40	805,392.00
ULTA BEAUTY INC	1,970	416.62	820,741.40
WAYFAIR INC- CLASS A	2,840	42.94	121,949.60
COSTCO WHOLESALE CORP	16,874	499.52	8,428,900.48
KROGER CO	26,620	46.92	1,249,010.40
SYSCO CORP	19,586	79.53	1,557,674.58
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	27,082	33.99	920,517.18
WALMART INC	57,502	133.55	7,679,392.10
ALTRIA GROUP INC	68,718	42.92	2,949,376.56
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	21,533	86.75	1,867,987.75
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,680	71.01	829,396.80
BUNGE LTD	5,577	90.21	503,101.17
CAMPBELL SOUP CO	7,885	47.77	376,666.45
COCA-COLA CO/THE	156,322	59.90	9,363,687.80
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	8,260	46.90	387,394.00
CONAGRA BRANDS INC	18,040	33.98	612,999.20
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,245	241.62	1,508,916.90
GENERAL MILLS INC	22,999	75.41	1,734,354.59
HERSHEY CO/THE	5,535	222.47	1,231,371.45
HORMEL FOODS CORP	11,500	46.01	529,115.00
JM SMUCKER CO/THE	4,100	139.20	570,720.00
KELLOGG CO	9,358	71.47	668,816.26
KEURIG DR PEPPER INC	29,830	37.43	1,116,536.90
KRAFT HEINZ CO/THE	28,081	33.94	953,069.14
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,250	77.36	715,580.00
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,200	49.92	359,424.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	52,345	59.75	3,127,613.75
MONSTER BEVERAGE CORP	15,130	87.70	1,326,901.00
PEPSICO INC	52,401	168.92	8,851,576.92
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	58,768	96.01	5,642,315.68
TYSON FOODS INC-CL A	10,906	71.83	783,377.98
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,090	75.08	682,477.20

CLOROX COMPANY	4,646	141.30	656,479.80
COLGATE-PALMOLIVE CO	29,810	75.16	2,240,519.60
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,910	239.50	2,133,945.00
KIMBERLY-CLARK CORP	12,863	121.56	1,563,626.28
PROCTER & GAMBLE CO	91,039	137.50	12,517,862.50
ABBOTT LABORATORIES	66,626	102.31	6,816,506.06
ABIOMED INC	1,770	258.99	458,412.30
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,840	232.22	659,504.80
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,774	138.90	802,008.60
BAXTER INTERNATIONAL INC	19,499	56.58	1,103,253.42
BECTON DICKINSON AND CO	10,847	244.11	2,647,861.17
BOSTON SCIENTIFIC CORP	54,438	40.43	2,200,928.34
CARDINAL HEALTH INC	10,715	67.79	726,369.85
CENTENE CORP	22,327	83.41	1,862,295.07
CIGNA CORP	12,060	288.08	3,474,244.80
COOPER COS INC/THE	1,715	283.53	486,253.95
CVS HEALTH CORP	49,728	101.34	5,039,435.52
DAVITA INC	2,108	91.42	192,713.36
DENTSPLY SIRONA INC	8,222	30.84	253,566.48
DEXCOM INC	14,640	87.37	1,279,096.80
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	23,870	87.19	2,081,225.30
ELEVANCE HEALTH INC	9,151	475.47	4,351,025.97
HCA HEALTHCARE INC	8,980	201.76	1,811,804.80
HENRY SCHEIN INC	5,280	70.17	370,497.60
HOLOGIC INC	9,208	64.65	595,297.20
HUMANA INC	4,820	502.89	2,423,929.80
IDEXX LABORATORIES INC	3,310	338.00	1,118,780.00
INSULET CORP	2,735	255.04	697,534.40
INTUITIVE SURGICAL INC	13,525	199.55	2,698,913.75
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,575	220.21	787,250.75
MASIMO CORP	2,020	151.64	306,312.80
MCKESSON CORP	5,549	345.56	1,917,512.44
MEDTRONIC PLC	50,628	88.46	4,478,552.88
MOLINA HEALTHCARE INC	2,230	337.90	753,517.00
NOVOCURE LTD	3,430	82.44	282,769.20

QUEST DIAGNOSTICS	4,386	124.34	545,355.24
RESMED INC	5,515	220.20	1,214,403.00
STERIS PLC	3,710	183.11	679,338.10
STRYKER CORP	12,983	217.96	2,829,774.68
TELADOC HEALTH INC	6,610	29.45	194,664.50
TELEFLEX INC	1,760	220.24	387,622.40
UNITEDHEALTH GROUP INC	35,630	522.80	18,627,364.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,460	96.14	236,504.40
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	5,240	168.04	880,529.60
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,952	111.77	888,795.04
ABBVIE INC	67,186	141.77	9,524,959.22
AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,240	128.14	1,440,293.60
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,520	212.01	958,285.20
AMGEN INC	20,396	227.71	4,644,373.16
AVANTOR INC	23,770	21.77	517,472.90
BIO-RAD LABORATORIES-A	860	437.39	376,155.40
BIO-TECHNE CORP	1,480	300.09	444,133.20
BIOGEN INC	5,543	204.20	1,131,880.60
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,140	86.96	620,894.40
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	80,885	69.73	5,640,111.05
CATALENT INC	6,520	87.15	568,218.00
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,910	194.18	370,883.80
DANAHER CORP	26,229	274.37	7,196,450.73
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	16,526	13.85	228,885.10
ELI LILLY & CO	30,774	301.73	9,285,439.02
EXACT SCIENCES CORP	6,510	37.89	246,663.90
GILEAD SCIENCES INC	47,844	64.58	3,089,765.52
HORIZON THERAPEUTICS PLC	7,990	63.48	507,205.20
ILLUMINA INC	6,075	194.70	1,182,802.50
INCYTE CORP	7,110	68.26	485,328.60
IQVIA HOLDINGS INC	7,298	199.66	1,457,118.68
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,450	137.84	337,708.00
JOHNSON & JOHNSON	99,791	164.97	16,462,521.27
MERCK & CO. INC.	95,953	86.00	8,251,958.00
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	860	1,167.55	1,004,093.00

MODERNA INC	13,145	129.70	1,704,972.22
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,630	107.09	388,736.70
PERKINELMER INC	4,920	127.75	628,530.00
PFIZER INC	213,080	44.77	9,539,591.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,085	704.22	2,876,738.70
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	13,010	41.02	533,670.20
SEAGEN INC	5,320	141.99	755,386.80
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43,590	8.42	367,027.80
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	14,859	532.16	7,907,365.44
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,680	286.94	2,777,579.20
VIATRIS INC	45,819	9.04	414,203.76
WATERS CORP	2,336	281.98	658,705.28
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,780	263.69	733,058.20
ZOETIS INC	18,055	152.94	2,761,331.70
BANK OF AMERICA CORP	276,529	34.17	9,448,995.93
CITIGROUP INC	73,967	47.25	3,494,940.75
CITIZENS FINANCIAL GROUP	17,690	36.81	651,168.90
FIFTH THIRD BANCORP	25,549	35.14	897,791.86
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	450	850.00	382,500.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,750	141.92	957,960.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	56,330	13.90	782,987.00
JPMORGAN CHASE & CO	111,700	115.83	12,938,211.00
KEYCORP	35,998	17.61	633,924.78
M & T BANK CORP	6,893	187.18	1,290,231.74
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	15,790	163.83	2,586,875.70
REGIONS FINANCIAL CORP	37,044	22.19	822,006.36
SIGNATURE BANK	2,390	169.08	404,101.20
SVB FINANCIAL GROUP	2,155	365.17	786,941.35
TRUIST FINANCIAL CORP	50,330	47.29	2,380,105.70
US BANCORP	53,221	44.99	2,394,412.79
WEBSTER FINANCIAL CORP	7,030	47.24	332,097.20
WELLS FARGO & CO	144,320	43.41	6,264,931.20
ALLY FINANCIAL INC	12,240	32.16	393,638.40
AMERICAN EXPRESS CO	24,394	153.48	3,743,991.12
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,265	275.14	1,173,472.10

APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,530	53.86	836,445.80
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	29,462	43.27	1,274,820.74
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	48,855	277.13	13,539,186.15
BLACKROCK INC	5,805	622.31	3,612,509.55
BLACKSTONE INC	26,890	90.94	2,445,376.60
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	14,935	101.37	1,513,960.95
CARLYLE GROUP INC/THE	6,070	30.12	182,828.40
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,940	119.44	470,593.60
CME GROUP INC	13,790	187.25	2,582,177.50
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	4,270	67.94	290,103.80
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,860	100.29	1,089,149.40
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,420	29.26	421,929.20
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,460	441.64	644,794.40
FRANKLIN RESOURCES INC	10,315	24.54	253,130.10
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	42.30	105,750.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	12,798	323.26	4,137,081.48
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	21,560	94.85	2,044,966.00
INVESCO LTD	13,527	16.37	221,436.99
KKR & CO INC -A	20,050	47.68	955,984.00
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,150	229.16	721,854.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,420	235.80	334,836.00
MOODY'S CORP	6,442	270.81	1,744,558.02
MORGAN STANLEY	50,073	87.19	4,365,864.87
MSCI INC	3,115	447.77	1,394,803.55
NASDAQ INC	13,455	59.20	796,536.00
NORTHERN TRUST CORP	7,340	93.59	686,950.60
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,010	108.40	759,884.00
S&P GLOBAL INC	13,230	339.35	4,489,600.50
SCHWAB (CHARLES) CORP	55,573	73.35	4,076,279.55
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,175	53.41	222,986.75
STATE STREET CORP	14,207	68.95	979,572.65
SYNCHRONY FINANCIAL	19,010	31.64	601,476.40
T ROWE PRICE GROUP INC	8,125	111.79	908,293.75
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,200	61.34	257,628.00
AFLAC INC	23,484	60.53	1,421,486.52

ALLEGHANY CORP	510	842.85	429,853.50
ALLSTATE CORP	10,523	130.08	1,368,831.84
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,900	127.80	370,620.00
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	30,095	53.41	1,607,373.95
AON PLC	8,082	276.22	2,232,410.04
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,055	46.43	652,573.65
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,940	179.17	1,422,609.80
ASSURANT INC	2,170	150.79	327,214.30
BROWN & BROWN INC	9,090	61.44	558,489.60
CHUBB LTD	16,255	187.58	3,049,112.90
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,900	97.03	572,477.00
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,055	223.95	236,267.25
EVEREST RE GROUP LTD	1,469	271.46	398,774.74
FNF GROUP	10,241	39.88	408,411.08
GLOBE LIFE INC	3,586	103.65	371,688.90
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,382	64.96	804,334.72
LINCOLN NATIONAL CORP	6,453	48.50	312,970.50
LOEWS CORP	7,105	53.80	382,249.00
MARKEL CORP	525	1,176.20	617,505.00
MARSH & MCLENNAN COS	19,183	155.47	2,982,381.01
METLIFE INC	26,275	65.49	1,720,749.75
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,930	76.84	763,021.20
PROGRESSIVE CORP	22,160	125.10	2,772,216.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,442	93.02	1,343,394.84
TRAVELERS COS INC/THE	9,034	160.95	1,454,022.30
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,198	208.35	874,653.30
WR BERKLEY CORP	8,091	66.38	537,080.58
CBRE GROUP INC - A	12,410	74.98	930,501.80
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	49,200	4.83	237,636.00
ZILLOW GROUP INC - C	6,370	32.34	206,005.80
ACCENTURE PLC-CL A	23,978	270.24	6,479,814.72
ADOBE INC	17,929	291.06	5,218,414.74
AFFIRM HOLDINGS INC	6,670	22.14	147,673.80
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,030	85.93	518,157.90
ANSYS INC	3,295	239.35	788,658.25

APPROVIN CORP-CLASS A	3,960	21.78	86,248.80
AUTODESK INC	8,285	194.97	1,615,326.45
AUTOMATIC DATA PROCESSING	15,901	233.54	3,713,519.54
AVALARA INC	3,310	92.20	305,182.00
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,530	32.71	246,306.30
BILL.COM HOLDINGS INC	3,630	142.06	515,677.80
BLACK KNIGHT INC	5,860	67.32	394,495.20
BLOCK INC	20,030	61.47	1,231,244.10
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,400	162.11	713,284.00
CADENCE DESIGN SYS INC	10,420	166.99	1,740,035.80
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,280	57.83	305,342.40
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,050	116.08	470,124.00
CITRIX SYSTEMS INC	4,518	103.72	468,606.96
CLOUDFLARE INC-CLASS A	9,750	61.13	596,017.50
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	19,868	61.96	1,231,021.28
COUPA SOFTWARE INC	2,800	66.64	186,592.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	7,490	173.87	1,302,286.30
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,650	154.11	254,281.50
DATADOG INC-CLASS A	8,220	93.57	769,145.40
DOCUSIGN INC	7,910	55.54	439,321.40
DROPBOX INC-CLASS A	11,660	21.18	246,958.80
DYNATRACE INC	7,560	37.45	283,122.00
EPAM SYSTEMS INC	2,205	386.91	853,136.55
FAIR ISAAC CORP	1,055	450.07	474,823.85
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	23,358	81.73	1,909,049.34
FISERV INC	23,714	102.17	2,422,859.38
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,910	198.74	578,333.40
FORTINET INC	26,325	50.77	1,336,520.25
GARTNER INC	3,050	291.04	887,672.00
GLOBAL PAYMENTS INC	10,829	124.16	1,344,528.64
GODADDY INC-CLASS A	6,420	75.43	484,260.60
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,870	60.58	173,864.60
HUBSPOT INC	1,725	284.09	490,055.25
INTL BUSINESS MACHINES CORP	34,322	126.30	4,334,868.60
INTUIT INC	10,211	417.82	4,266,360.02

JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,840	189.56	538,350.40
MASTERCARD INC	33,025	313.27	10,345,741.75
MICROSOFT CORP	269,884	242.45	65,433,375.80
MONGODB INC	2,520	217.90	549,108.00
NORTONLIFELOCK INC	22,205	20.91	464,306.55
OKTA INC	5,670	58.50	331,695.00
ORACLE CORP	60,773	68.11	4,139,249.03
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	64,650	7.62	492,633.00
PALO ALTO NETWORKS INC	11,475	175.02	2,008,354.50
PAYCHEX INC	12,502	120.04	1,500,740.08
PAYCOM SOFTWARE INC	2,030	346.92	704,247.60
PAYPAL HOLDINGS INC	42,077	91.63	3,855,515.51
PTC INC	4,450	112.33	499,868.50
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,990	43.41	129,795.90
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,065	378.54	1,538,765.10
SALESFORCE INC	37,446	149.80	5,609,410.80
SERVICENOW INC	7,600	411.20	3,125,120.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	8,310	182.74	1,518,569.40
SPLUNK INC	6,120	88.63	542,415.60
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	52.29	442,896.30
SYNOPSYS INC	5,852	316.26	1,850,753.52
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	16,510	61.57	1,016,520.70
TWILIO INC - A	6,965	74.51	518,962.15
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,570	353.86	555,560.20
UNITY SOFTWARE INC	6,770	35.20	238,304.00
VERISIGN INC	3,690	174.73	644,753.70
VISA INC-CLASS A SHARES	62,592	192.07	12,022,045.44
VMWARE INC-CLASS A	7,697	111.00	854,367.00
WESTERN UNION CO	14,561	14.30	208,222.30
WIX.COM LTD	2,280	82.34	187,735.20
WORKDAY INC-CLASS A	7,550	152.65	1,152,507.50
ZENDESK INC	4,780	76.52	365,765.60
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	8,530	77.09	657,577.70
ZSCALER INC	3,360	172.68	580,204.80
AMPHENOL CORP-CL A	22,960	72.15	1,656,564.00

APPLE INC	614,664	156.90	96,440,781.60
ARISTA NETWORKS INC	8,720	114.07	994,690.40
ARROW ELECTRONICS INC	2,520	96.48	243,129.60
CDW CORP/DE	5,190	168.25	873,217.50
CISCO SYSTEMS INC	157,840	42.58	6,720,827.20
COGNEX CORP	6,480	44.41	287,776.80
CORNING INC	29,878	31.70	947,132.60
DELL TECHNOLOGIES -C	10,172	36.95	375,855.40
F5 INC	2,385	146.83	350,189.55
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	48,285	12.76	616,116.60
HP INC	40,565	26.45	1,072,944.25
JUNIPER NETWORKS INC	12,963	26.88	348,445.44
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,950	164.46	1,142,997.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,505	239.51	1,558,012.55
NETAPP INC	8,686	66.30	575,881.80
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,794	59.93	467,094.42
TE CONNECTIVITY LTD	12,265	121.63	1,491,791.95
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,750	372.84	652,470.00
TRIMBLE INC	9,520	58.46	556,539.20
WESTERN DIGITAL CORP	11,818	35.54	420,011.72
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,025	285.65	578,441.25
AT&T INC	272,677	16.56	4,515,531.12
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,435	17.58	95,547.30
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	11,131	18.57	206,702.67
LUMEN TECHNOLOGIES INC	34,386	8.56	294,344.16
T-MOBILE US INC	23,959	139.64	3,345,634.76
VERIZON COMMUNICATIONS INC	159,487	40.59	6,473,577.33
AES CORP	25,138	25.89	650,822.82
ALLIANT ENERGY CORP	8,800	61.13	537,944.00
AMEREN CORPORATION	9,572	91.24	873,349.28
AMERICAN ELECTRIC POWER	19,288	99.76	1,924,170.88
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,705	145.44	975,175.20
ATMOS ENERGY CORP	4,740	113.51	538,037.40
CENTERPOINT ENERGY INC	22,202	31.99	710,241.98
CMS ENERGY CORP	11,100	66.75	740,925.00

CONSOLIDATED EDISON INC	12,896	97.37	1,255,683.52
CONSTELLATION ENERGY	12,568	87.75	1,102,842.00
DOMINION ENERGY INC	30,601	80.03	2,448,998.03
DTE ENERGY COMPANY	7,188	128.67	924,879.96
DUKE ENERGY CORP	29,376	105.64	3,103,280.64
EDISON INTERNATIONAL	14,439	67.71	977,664.69
ENERGY CORP	7,507	114.30	858,050.10
ESSENTIAL UTILITIES INC	9,190	45.90	421,821.00
EVERGY INC	8,720	66.71	581,711.20
EVERSOURCE ENERGY	13,070	88.61	1,158,132.70
EXELON CORP	37,486	42.78	1,603,651.08
FIRSTENERGY CORP	21,265	41.38	879,945.70
NEXTERA ENERGY INC	74,690	85.69	6,400,186.10
NISOURCE INC	15,610	28.86	450,504.60
NRG ENERGY INC	9,580	42.80	410,024.00
P G & E CORP	57,890	13.30	769,937.00
PPL CORP	27,988	28.90	808,853.20
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	19,298	65.38	1,261,703.24
SEMPRA ENERGY	12,097	168.86	2,042,699.42
SOUTHERN CO	40,525	77.22	3,129,340.50
UGI CORP	7,720	36.10	278,692.00
VISTRA CORP	16,750	24.91	417,242.50
WEC ENERGY GROUP INC	12,040	100.96	1,215,558.40
XCEL ENERGY INC	20,844	73.48	1,531,617.12
ADVANCED MICRO DEVICES	61,974	75.25	4,663,543.50
ANALOG DEVICES INC	19,907	149.78	2,981,670.46
APPLIED MATERIALS INC	33,133	88.12	2,919,679.96
BROADCOM INC	15,325	493.06	7,556,144.50
ENPHASE ENERGY INC	5,190	304.71	1,581,444.90
ENTEGRIS INC	5,050	92.13	465,256.50
INTEL CORP	155,392	28.96	4,500,152.32
KLA CORP	5,689	329.90	1,876,801.10
LAM RESEARCH CORP	5,282	403.40	2,130,758.80
MARVELL TECHNOLOGY INC	32,664	45.29	1,479,352.56
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	21,248	65.37	1,388,981.76

	MICRON TECHNOLOGY INC	42,337	50.80	2,150,719.60	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,705	410.84	700,482.20	
	NVIDIA CORP	94,970	131.76	12,513,247.20	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	10,037	160.90	1,614,953.30	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	16,640	68.48	1,139,507.20	
	QORVO INC	4,150	85.82	356,153.00	
	QUALCOMM INC	42,432	124.77	5,294,240.64	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,210	98.14	609,449.40	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	2,005	294.36	590,191.80	
	TERADYNE INC	6,190	80.84	500,399.60	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	34,912	166.06	5,797,486.72	
米ドル小計		12,958,725		1,271,922,813.13	(182,813,465,931)
加ドル	ARC RESOURCES LTD	27,920	18.48	515,961.60	
	CAMECO CORP	14,032	37.93	532,233.76	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	44,124	71.20	3,141,628.80	
	CENOVUS ENERGY INC	49,873	24.56	1,224,880.88	
	ENBRIDGE INC	76,617	54.38	4,166,432.46	
	IMPERIAL OIL LTD	9,622	61.91	595,698.02	
	KEYERA CORP	8,460	30.72	259,891.20	
	PARKLAND CORP	6,170	31.51	194,416.70	
	PEMBINA PIPELINE CORP	21,272	46.44	987,871.68	
	SUNCOR ENERGY INC	54,389	41.72	2,269,109.08	
	TC ENERGY CORP	37,693	62.94	2,372,397.42	
	TOURMALINE OIL CORP	11,250	77.45	871,312.50	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	17,586	54.97	966,702.42	
	BARRICK GOLD CORP	66,724	20.12	1,342,486.88	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	67.83	390,022.50	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	24.00	543,600.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	7,365	158.66	1,168,530.90	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	24,510	8.84	216,668.40	
	KINROSS GOLD CORP	46,025	4.68	215,397.00	
	LUNDIN MINING CORP	25,010	7.11	177,821.10	
	NUTRIEN LTD	21,298	120.13	2,558,528.74	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	7,660	21.34	163,464.40	

TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,975	43.20	776,520.00	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,450	103.21	252,864.50	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	17,985	42.43	763,103.55	
CAE INC	12,305	23.05	283,630.25	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,260	101.17	329,814.20	
WSP GLOBAL INC	4,590	158.27	726,459.30	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,410	37.78	279,949.80	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,040	86.38	348,975.20	
THOMSON REUTERS CORP	6,546	146.07	956,174.22	
AIR CANADA	7,190	19.14	137,616.60	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	22,548	156.18	3,521,546.64	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	35,371	97.60	3,452,209.60	
TFI INTERNATIONAL INC	3,210	129.05	414,250.50	
MAGNA INTERNATIONAL INC	11,178	72.53	810,740.34	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,930	41.56	329,570.80	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	11,578	78.12	904,473.36	
QUEBECOR INC -CL B	6,110	26.60	162,526.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	17,465	33.71	588,745.15	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,260	154.87	350,006.20	
DOLLARAMA INC	11,190	78.50	878,415.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	31,700	57.59	1,825,603.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	36.36	252,702.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,509	112.86	621,745.74	
METRO INC	9,920	70.46	698,963.20	
WESTON (GEORGE) LTD	3,038	148.17	450,140.46	
SAPUTO INC	9,620	33.75	324,675.00	
BANK OF MONTREAL	24,811	126.07	3,127,922.77	
BANK OF NOVA SCOTIA	45,649	71.08	3,244,730.92	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	34,840	63.02	2,195,616.80	
NATIONAL BANK OF CANADA	13,200	90.33	1,192,356.00	
ROYAL BANK OF CANADA	53,709	127.25	6,834,470.25	
TORONTO-DOMINION BANK	69,360	87.79	6,089,114.40	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	53,499	63.39	3,391,301.61	
IGM FINANCIAL INC	3,335	36.47	121,627.45	
ONEX CORPORATION	2,765	65.54	181,218.10	

	TMX GROUP LTD	2,170	130.26	282,664.20	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	652.39	587,151.00	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	8,904	31.18	277,626.72	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,835	73.56	355,662.60	
	INTACT FINANCIAL CORP	6,745	200.93	1,355,272.85	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	73,821	22.66	1,672,783.86	
	POWER CORP OF CANADA	20,479	33.85	693,214.15	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	21,544	57.32	1,234,902.08	
	FIRSTSERVICE CORP	1,500	156.24	234,360.00	
	BLACKBERRY LTD	22,208	7.47	165,893.76	
	CGI INC	8,530	103.10	879,443.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	740	1,926.24	1,425,417.60	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	4,390	23.86	104,745.40	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,250	42.32	95,220.00	
	OPEN TEXT CORP	10,940	37.49	410,140.60	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	44,440	41.35	1,837,594.00	
	BCE INC	3,000	61.74	185,220.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	13,875	54.88	761,460.00	
	TELUS CORP	12,662	28.52	361,120.24	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	17.11	463,338.80	
	ALTAGAS LTD	11,170	28.73	320,914.10	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	52.90	288,040.50	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	40.23	183,448.80	
	EMERA INC	10,460	60.57	633,562.20	
	FORTIS INC	17,195	56.02	963,263.90	
	HYDRO ONE LTD	13,230	34.94	462,256.20	
	NORTHLAND POWER INC	8,600	44.86	385,796.00	
加ドル小計		1,548,169		88,315,347.91	(9,496,549,360)
ユーロ	ENI SPA	94,656	11.14	1,054,467.84	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	21,935	9.88	216,849.41	
	NESTE OYJ	15,550	42.76	664,918.00	
	OMV AG	5,480	38.64	211,747.20	
	REPSOL SA	54,849	11.95	655,445.55	
	TENARIS SA	15,625	13.41	209,609.37	

TOTALENERGIES SE	94,347	48.87	4,610,737.89
AIR LIQUIDE SA	19,939	118.56	2,363,967.84
AKZO NOBEL	6,937	60.10	416,913.70
ARCELORMITTAL	19,142	21.68	414,998.56
ARKEMA	2,215	78.40	173,656.00
BASF SE	34,455	41.60	1,433,328.00
COVESTRO AG	7,410	29.82	220,966.20
CRH PLC	29,210	34.23	999,858.30
EVONIK INDUSTRIES AG	8,230	18.02	148,304.60
HEIDELBERGCEMENT AG	5,715	43.40	248,031.00
KONINKLIJKE DSM NV	6,392	115.50	738,276.00
OCI NV	3,520	37.52	132,070.40
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,890	30.92	305,798.80
SOLVAY SA	2,811	80.40	226,004.40
STORA ENSO OYJ-R SHS	21,835	13.99	305,471.65
SYMRISE AG	4,910	100.00	491,000.00
UMICORE	7,960	30.52	242,939.20
UPM-KYMMENE OYJ	19,568	34.30	671,182.40
VOESTALPINE AG	4,249	19.54	83,025.46
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	9,846	22.34	219,959.64
AIRBUS GROUP SE	22,578	91.97	2,076,498.66
ALSTOM	11,635	18.73	217,923.55
BOUYGUES SA	8,460	27.98	236,710.80
BRENTAG SE	6,075	65.82	399,856.50
CNH INDUSTRIAL NV	39,510	11.99	473,724.90
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	19,146	39.62	758,564.52
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	17,696	24.98	442,134.56
DASSAULT AVIATION SA	900	125.90	113,310.00
EIFFAGE	3,250	87.02	282,815.00
FERROVIAL SA	18,485	24.25	448,261.25
GEA GROUP AG	6,020	32.51	195,710.20
IMCD NV	2,320	125.50	291,160.00
KINGSPAN GROUP PLC	5,900	53.72	316,948.00
KION GROUP AG	2,874	21.00	60,354.00
KNORR-BREMSE AG	2,970	45.00	133,650.00

KONE OYJ-B	13,114	38.80	508,823.20
LEGRAND SA	10,198	67.42	687,549.16
MTU AERO ENGINES AG	2,020	154.70	312,494.00
PRYSMIAN SPA	9,565	30.78	294,410.70
RATIONAL AG	230	433.20	99,636.00
RHEINMETALL AG	1,730	150.40	260,192.00
SAFRAN SA	13,110	96.52	1,265,377.20
SCHNEIDER ELECTRIC SE	20,418	116.06	2,369,713.08
SIEMENS AG-REG	28,976	99.37	2,879,345.12
SIEMENS ENERGY AG	15,843	12.15	192,492.45
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	10,210	17.93	183,065.30
THALES SA	4,245	113.15	480,321.75
VINCI SA	20,330	90.40	1,837,832.00
WARTSILA OYJ ABP	18,180	7.33	133,295.76
BUREAU VERITAS SA	10,920	23.81	260,005.20
RANDSTAD NV	4,965	46.57	231,220.05
TELEPERFORMANCE	2,060	268.50	553,110.00
WOLTERS KLUWER	9,987	99.30	991,709.10
ADP	1,090	129.50	141,155.00
AENA SA	2,870	115.20	330,624.00
ATLANTIA SPA	18,740	22.76	426,522.40
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	6.11	145,906.80
DEUTSCHE POST AG-REG	37,463	33.11	1,240,399.93
GETLINK	17,310	17.11	296,260.65
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	12,385	75.07	929,741.95
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,210	70.15	155,031.50
CONTINENTAL AG	4,385	55.48	243,279.80
FERRARI NV	4,474	193.60	866,166.40
MERCEDES-BENZ GROUP AG	30,552	57.00	1,741,464.00
MICHELIN (CGDE)	26,626	24.20	644,349.20
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	71.90	407,673.00
RENAULT SA	6,837	31.20	213,314.40
STELLANTIS NV	83,216	13.22	1,100,115.52
VALEO SA	7,420	18.49	137,232.90
VOLKSWAGEN AG	1,151	205.40	236,415.40

VOLKSWAGEN AG-PFD	7,123	146.90	1,046,368.70
ADIDAS AG	6,241	135.74	847,153.34
ESSILORLUXOTTICA	11,025	143.90	1,586,497.50
HERMES INTERNATIONAL	1,202	1,244.50	1,495,889.00
KERING	2,877	495.40	1,425,265.80
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	10,529	634.00	6,675,386.00
MONCLER SPA	8,080	44.30	357,944.00
PUMA SE	4,200	55.68	233,856.00
SEB SA	987	64.65	63,809.55
ACCOR SA	7,336	24.31	178,338.16
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,356	117.80	748,736.80
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	31.76	123,864.00
SODEXO	3,570	80.32	286,742.40
BOLLORE SE	33,530	4.73	158,596.90
PUBLICIS GROUPE	8,645	50.32	435,016.40
SCOUT24 SE	2,970	54.64	162,280.80
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,510	33.24	116,672.40
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	27,730	18.17	503,854.10
VIVENDI SE	26,070	8.45	220,500.06
D'IETTEREN GROUP	830	149.50	124,085.00
DELIVERY HERO SE	6,600	42.90	283,140.00
INDITEX	40,125	21.86	877,132.50
JUST EAT TAKEAWAY	6,460	15.85	102,429.76
PROSUS	31,890	57.51	1,833,993.90
ZALANDO SE	8,260	21.39	176,681.40
CARREFOUR SA	24,333	15.96	388,354.68
HELLOFRESH SE	6,070	24.73	150,111.10
JERONIMO MARTINS	9,035	22.12	199,854.20
KESKO OYJ-B SHS	10,930	19.83	216,741.90
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	38,478	27.20	1,046,793.99
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	33,171	49.42	1,639,476.67
DANONE	24,684	49.53	1,222,598.52
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,850	9.15	181,706.90
HEINEKEN HOLDING NV	4,025	70.30	282,957.50
HEINEKEN NV	9,673	89.24	863,218.52

JDE PEET'S NV	4,010	29.84	119,658.40
KERRY GROUP PLC-A	6,180	95.56	590,560.80
PERNOD-RICARD SA	7,926	184.65	1,463,535.90
REMY COINTREAU	810	175.00	141,750.00
BEIERSDORF AG	3,805	102.65	390,583.25
HENKEL AG & CO KGAA	3,450	59.60	205,620.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7,203	61.54	443,272.62
L'OREAL	9,211	334.05	3,076,934.55
AMPLIFON SPA	4,830	24.60	118,818.00
BIOMERIEUX	1,690	84.76	143,244.40
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	112.10	180,481.00
DIASORIN ITALIA SPA	930	125.00	116,250.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,613	31.72	241,484.36
FRESENIUS SE & CO KGAA	15,695	23.90	375,110.50
KONINKLIJKE PHILIPS NV	34,620	17.68	612,358.56
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,640	43.96	467,734.40
ARGENX SE	1,755	373.20	654,966.00
BAYER AG-REG	37,484	52.08	1,952,166.72
EUROFINS SCIENTIFIC	5,050	62.46	315,423.00
GRIFOLS SA	12,050	11.79	142,069.50
IPSEN	1,350	96.95	130,882.50
MERCK KGAA	4,950	165.90	821,205.00
ORION OYJ-CLASS B	3,620	42.79	154,899.80
QIAGEN N.V.	8,944	43.25	386,828.00
RECORDATI SPA	3,720	39.00	145,080.00
SANOFI	43,406	79.77	3,462,496.62
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	960	369.60	354,816.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	322.40	348,192.00
UCB SA	4,928	68.42	337,173.76
ABN AMRO BANK NV-CVA	15,170	10.35	157,009.50
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	250,583	4.91	1,230,613.11
BANCO SANTANDER SA	657,249	2.63	1,733,165.61
BNP PARIBAS	41,122	48.44	1,991,949.68
CAIXABANK S.A	163,050	3.56	581,925.45
COMMERZBANK AG	44,204	8.09	357,963.99

CREDIT AGRICOLE SA	40,742	9.27	377,759.82
ERSTE GROUP BANK AG	11,458	25.68	294,241.44
FINECOBANK SPA	23,540	11.94	281,185.30
ING GROEP NV-CVA	152,015	9.78	1,486,858.71
INTESA SANPAOLO	630,593	1.84	1,166,092.57
KBC GROEP NV	9,719	54.26	527,352.94
MEDIOBANCA SPA	26,720	8.19	218,997.12
SOCIETE GENERALE	31,389	23.44	735,915.10
UNICREDIT SPA	79,316	10.50	833,135.26
AMUNDI SA	2,140	47.20	101,008.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	79,235	8.98	711,688.77
DEUTSCHE BOERSE AG	7,190	169.80	1,220,862.00
EURAZEO SE	1,487	55.20	82,082.40
EURONEXT NV	3,470	65.24	226,382.80
EXOR NV	4,164	64.34	267,911.76
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,062	73.76	299,613.12
SOFINA	655	182.20	119,341.00
WENDEL	1,000	76.85	76,850.00
AEGON NV	69,679	4.66	324,913.17
AGEAS	6,794	39.89	271,012.66
ALLIANZ SE-REG	15,428	171.86	2,651,456.08
ASSICURAZIONI GENERALI	42,248	14.87	628,439.00
AXA SA	69,562	24.94	1,734,876.28
HANNOVER RUECK SE-REG	2,275	156.45	355,923.75
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,176	252.70	1,307,975.20
NN GROUP NV	10,990	41.47	455,755.30
POSTE ITALIANE SPA	19,560	8.11	158,631.60
SAMPO OYJ-A SHS	18,999	44.93	853,625.07
AROUNDTOWN SA	35,980	2.49	89,806.08
LEG IMMOBILIEN SE	3,080	63.84	196,627.20
VONOVIA SE	27,119	23.26	630,787.94
ADYEN NV	835	1,281.40	1,069,969.00
AMADEUS IT GROUP SA	17,090	50.38	860,994.20
BECHTLE AG	3,070	37.69	115,708.30
CAP GEMINI SA	6,109	161.80	988,436.20

DASSAULT SYSTEMES SE	24,650	35.64	878,649.25
EDENRED	9,626	48.21	464,069.46
NEMETSCHKE SE	2,350	51.76	121,636.00
NEXI SPA	21,240	8.84	187,846.56
SAP SE	39,852	83.27	3,318,476.04
WORLDLINE SA	8,950	43.50	389,325.00
NOKIA OYJ	203,856	4.60	937,737.60
CELLNEX TELECOM SA	19,720	33.25	655,690.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	121,656	18.73	2,279,590.12
ELISA OYJ	5,465	49.48	270,408.20
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	9.16	138,987.54
KONINKLIJKE KPN NV	131,606	2.96	390,080.18
ORANGE S.A.	76,994	9.79	754,464.20
PROXIMUS	5,600	11.10	62,160.00
TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.18	72,252.54
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	46,470	2.31	107,578.05
TELEFONICA SA	195,629	3.80	743,781.45
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,000	21.23	84,920.00
ACCIONA SA	830	193.40	160,522.00
E.ON SE	82,679	8.24	681,605.67
EDF	19,505	11.92	232,499.60
EDP RENOVAVEIS SA	11,010	23.44	258,074.40
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	105,831	4.90	519,312.71
ELIA GROUP SA/NV	1,356	132.80	180,076.80
ENAGAS SA	10,860	16.97	184,294.20
ENDESA SA	12,050	17.30	208,465.00
ENEL SPA	314,737	4.84	1,523,484.44
ENGIE	70,164	12.60	884,206.72
FORTUM OYJ	16,755	12.10	202,735.50
IBERDROLA SA	228,442	10.36	2,367,801.33
NATURGY ENERGY GROUP SA	6,252	26.00	162,552.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	15,580	17.34	270,157.20
RWE AG	24,345	40.43	984,268.35
SNAM SPA	72,420	4.66	337,911.72
TERNA SPA	53,627	6.96	373,351.17

	VEOLIA ENVIRONNEMENT	26,140	20.97	548,155.80	
	VERBUND AG	2,780	88.25	245,335.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	1,865	261.60	487,884.00	
	ASML HOLDING NV	15,422	465.60	7,180,483.20	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	50,255	24.26	1,219,437.57	
	STMICROELECTRONICS NV	26,093	35.70	931,650.56	
ユーロ小計		7,013,302		150,629,797.97	(21,571,693,367)
英ポンド	BP PLC	738,978	4.52	3,343,875.45	
	SHELL PLC-NEW	282,307	23.02	6,500,118.67	
	ANGLO AMERICAN PLC	47,564	27.78	1,321,327.92	
	ANTOFAGASTA PLC	14,330	11.00	157,630.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,571	64.84	361,223.64	
	GLENCORE PLC	375,493	4.80	1,805,745.83	
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,339	19.65	144,211.35	
	MONDI PLC	18,370	14.11	259,200.70	
	RIO TINTO PLC	42,585	47.44	2,020,232.40	
	ASHTED GROUP PLC	16,790	40.91	686,878.90	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	121,015	7.71	933,993.77	
	BUNZL PLC	12,896	27.02	348,449.92	
	DCC PLC	3,820	46.50	177,630.00	
	FERGUSON PLC	7,952	96.98	771,184.96	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	162,972	1.05	172,098.43	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	321,031	0.75	243,405.70	
	SMITHS GROUP PLC	13,603	14.93	203,092.79	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,890	100.65	290,878.50	
	EXPERIAN PLC	34,998	26.05	911,697.90	
	INTERTEK GROUP PLC	6,025	38.21	230,215.25	
	RELX PLC	73,255	22.01	1,612,342.55	
	RENTOKIL INITIAL PLC	73,630	5.11	376,691.08	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	4.04	164,834.56	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,515	35.07	158,341.05	
	BURBERRY GROUP PLC	15,504	17.22	266,978.88	
	PERSIMMON PLC	12,440	13.37	166,322.80	
	TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.03	127,874.74	

COMPASS GROUP PLC	64,468	18.51	1,193,302.68
ENTAIN PLC	21,400	11.98	256,479.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,203	46.45	334,579.35
WHITBREAD PLC	8,260	26.20	216,412.00
AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	6.02	219,828.48
INFORMA PLC	56,580	5.43	307,342.56
PEARSON PLC	26,089	8.87	231,409.43
WPP PLC	41,144	7.75	319,030.57
JD SPORTS FASHION PLC	97,350	1.22	119,643.15
KINGFISHER PLC	78,137	2.37	185,653.51
NEXT PLC	4,637	57.24	265,421.88
OCADO GROUP PLC	22,670	6.06	137,470.88
SAINSBURY (J) PLC	70,601	1.94	137,107.14
TESCO PLC	277,818	2.24	622,590.13
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,125	13.21	173,381.25
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	81,627	34.81	2,841,844.00
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	19.06	146,571.40
DIAGEO PLC	86,562	37.53	3,249,104.67
IMPERIAL BRANDS PLC	34,492	19.14	660,176.88
HALEON PLC	194,651	2.65	516,701.07
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	27,075	62.76	1,699,227.00
UNILEVER PLC	96,572	39.77	3,841,151.30
NMC HEALTH PLC	8,090	-	-
SMITH & NEPHEW PLC	31,596	10.38	327,966.48
ASTRAZENECA PLC	58,782	100.76	5,922,874.32
GSK PLC	154,800	13.12	2,031,904.80
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,740	12.31	70,659.40
BARCLAYS PLC	633,451	1.70	1,082,694.44
HSBC HOLDINGS PLC	767,161	5.34	4,097,406.90
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,633,236	0.49	1,290,285.64
NATWEST GROUP PLC	192,985	2.69	519,708.60
STANDARD CHARTERED PLC	99,570	6.02	600,207.96
3I GROUP PLC	36,819	10.99	404,640.81
ABRDN PLC	88,515	1.42	126,045.36
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	8.43	109,836.72

	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	12,467	75.48	941,009.16	
	M&G PLC	99,522	1.96	195,212.40	
	SCHRODERS PLC(N)	30,300	4.27	129,668.85	
	ST JAMES'S PLACE PLC	20,540	10.72	220,188.80	
	ADMIRAL GROUP PLC	6,795	21.52	146,228.40	
	AVIVA PLC	109,854	4.36	479,512.71	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	228,301	2.59	591,984.49	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,230	6.04	182,649.66	
	PRUDENTIAL PLC	105,872	9.53	1,009,807.13	
	AVEVA GROUP PLC	4,515	30.48	137,617.20	
	SAGE GROUP PLC/THE	38,840	7.14	277,317.60	
	HALMA PLC	14,690	20.35	298,941.50	
	BT GROUP PLC	267,752	1.36	366,686.36	
	VODAFONE GROUP PLC	1,043,328	1.06	1,109,892.32	
	NATIONAL GRID PLC	139,008	10.19	1,416,491.52	
	SEVERN TRENT PLC	9,023	26.12	235,680.76	
	SSE PLC	39,837	17.07	680,017.59	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	10.05	262,485.77	
英債券小計		10,886,058		66,696,529.72	(10,907,550,470)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	6,150	16.28	100,122.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	619.50	167,265.00	
	GIVAUDAN-REG	348	2,915.00	1,014,420.00	
	HOLCIM LTD	20,009	43.54	871,191.86	
	SIG GROUP AG	10,900	22.18	241,762.00	
	SIKA AG-REG	5,505	203.30	1,119,166.50	
	ABB LTD-REG	62,865	25.99	1,633,861.35	
	GEBERIT AG-REG	1,380	422.00	582,360.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,070	153.40	164,138.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	158.20	234,136.00	
	VAT GROUP AG	1,135	219.60	249,246.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,637	29.03	192,672.11	
	SGS SA-REG	238	2,190.00	521,220.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,990	211.30	420,487.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	19,969	101.80	2,032,844.20	

	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,125	227.30	255,712.50	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,850	42.08	77,848.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	130	1,908.00	248,040.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	40	9,590.00	383,600.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	99,100.00	396,400.00	
	NESTLE SA-REG	106,840	106.32	11,359,228.80	
	ALCON INC	19,044	62.88	1,197,486.72	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,051	228.80	469,268.80	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,050	94.26	381,753.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,400	57.80	80,920.00	
	LONZA GROUP AG-REG	2,873	465.60	1,337,668.80	
	NOVARTIS AG-REG	81,933	76.85	6,296,551.05	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,020	383.20	390,864.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	26,723	317.00	8,471,191.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	105,898	4.89	518,794.30	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,420	48.08	404,833.60	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	880	881.80	775,984.00	
	UBS GROUP AG-REG	132,152	15.60	2,061,571.20	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,740	136.50	237,510.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,215	503.80	612,117.00	
	SWISS RE AG	11,379	80.16	912,140.64	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,746	421.50	2,421,939.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,711	81.00	219,591.00	
	TEMENOS AG	2,640	73.36	193,670.40	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	46.43	309,223.80	
	SWISSCOM AG-REG	964	483.70	466,286.80	
	スイスフラン小計	669,434		50,025,086.43 (7,461,741,891)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	11,160	338.20	3,774,312.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	4,160	434.90	1,809,184.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	22,680	147.50	3,345,300.00	
	ALFA LAVAL AB	10,710	270.70	2,899,197.00	
	ASSA ABLOY AB-B	38,560	207.70	8,008,912.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	102,900	102.52	10,549,308.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	60,750	92.21	5,601,757.50	

EPIROC AB-A	24,905	156.05	3,886,425.25	
EPIROC AB-B	15,450	139.15	2,149,867.50	
HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	63.98	959,700.00	
INDUTRADE AB	12,110	177.45	2,148,919.50	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	186.15	1,265,820.00	
LIFCO AB-B SHS	8,470	151.30	1,281,511.00	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	60,410	103.85	6,273,578.50	
SANDVIK AB	37,320	154.50	5,765,940.00	
SKANSKA AB-B SHS	14,390	144.95	2,085,830.50	
SKF AB-B SHARES-B	14,079	148.45	2,090,027.55	
VOLVO AB-A SHS	7,120	171.60	1,221,792.00	
VOLVO AB-B SHS-B	58,310	164.66	9,601,324.60	
SECURITAS AB-B SHS	14,629	85.72	1,253,997.88	
VOLVO CAR AB-B	20,400	54.95	1,120,980.00	
ELECTROLUX AB-B	8,095	117.38	950,191.10	
EVOLUTION AB	7,110	845.30	6,010,083.00	
EMBRACER GROUP AB	23,940	60.94	1,458,903.60	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,848	106.78	2,973,609.44	
SWEDISH MATCH AB	60,180	109.05	6,562,629.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	23,695	230.50	5,461,697.50	
GETINGE AB-B SHS	9,750	181.95	1,774,012.50	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	7,130	211.90	1,510,847.00	
NORDEA BANK ABP	122,382	101.30	12,397,296.60	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	62,450	110.75	6,916,337.50	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	47,710	94.28	4,498,098.80	
SWEDBANK AB - A SHARES	34,550	151.35	5,229,142.50	
EQT AB	10,680	241.60	2,580,288.00	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	229.80	1,145,323.20	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	227.30	1,359,254.00	
INVESTOR AB-A SHS	19,180	172.90	3,316,222.00	
INVESTOR AB-B SHS	69,350	165.10	11,449,685.00	
KINNEVIK AB - B	8,285	144.10	1,193,868.50	
LUNDBERGS AB-B SHS	2,260	410.40	927,504.00	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	23,220	50.29	1,167,733.80	
SAGAX AB-B	7,910	192.00	1,518,720.00	

	ERICSSON LM-B SHS	111,765	71.44	7,984,491.60	
	HEXAGON AB-B SHS	69,540	106.40	7,399,056.00	
	TELE2 AB-B SHS	23,245	99.64	2,316,131.80	
	TELIA CO AB	94,230	34.12	3,215,127.60	
スウェーデンクローナ小計		1,445,782		178,409,938.82	(2,353,227,093)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	13,060	326.00	4,257,560.00	
	EQUINOR ASA	36,424	351.55	12,804,857.20	
	NORSK HYDRO A S	50,660	62.14	3,148,012.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,670	402.70	2,686,009.00	
	ADEVINTA ASA	11,400	73.60	839,040.00	
	MOWI ASA	16,360	183.15	2,996,334.00	
	ORKLA ASA	25,960	82.08	2,130,796.80	
	SALMAR ASA	2,760	598.50	1,651,860.00	
	DNB BANK ASA	35,845	182.90	6,556,050.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,410	197.00	1,459,770.00	
	TELENOR ASA	23,915	102.30	2,446,504.50	
ノルウェークローネ小計		230,464		40,976,794.40	(569,577,442)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,840	381.90	1,466,496.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,915	379.30	3,002,159.50	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	315	1,201.00	378,315.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	38,290	151.04	5,783,321.60	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	110	14,160.00	1,557,600.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	195	14,710.00	2,868,450.00	
	DSV A/S	7,210	948.00	6,835,080.00	
	PANDORA A/S	3,310	390.20	1,291,562.00	
	CARLSBERG AS-B	3,630	925.40	3,359,202.00	
	COLOPLAST-B	4,485	816.60	3,662,451.00	
	DEMANT A/S	3,640	206.80	752,752.00	
	GN STORE NORD A/S	4,970	177.05	879,938.50	
	GENMAB A/S	2,475	2,585.00	6,397,875.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	62,895	737.90	46,410,220.50	
	DANSKE BANK A/S	26,635	103.95	2,768,708.25	
	TRYG A/S	13,945	163.40	2,278,613.00	

	ORSTED A/S	7,410	684.30	5,070,663.00
デンマーククローネ小計		191,270		94,763,407.35 (1,825,143,225)
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	31.11	272,990.25
	SANTOS LTD	121,660	7.83	952,597.80
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,370	25.82	216,113.40
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	71,206	33.06	2,354,070.36
	BHP GROUP LTD	192,167	39.18	7,529,103.06
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	16.36	299,551.60
	EVOLUTION MINING LTD	69,000	2.10	144,900.00
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	64,055	17.30	1,108,151.50
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	16,955	32.57	552,224.35
	MINERAL RESOURCES LTD	6,240	71.58	446,659.20
	NEWCREST MINING LTD	35,409	17.15	607,264.35
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42,190	7.70	324,863.00
	ORICA LIMITED	17,675	14.34	253,459.50
	RIO TINTO LTD	14,138	94.72	1,339,151.36
	SOUTH32 LTD	169,887	4.02	682,945.74
	REECE LTD	10,200	14.80	150,960.00
	BRAMBLES LTD	54,798	11.96	655,384.08
	AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	3.66	269,266.20
	QANTAS AIRWAYS LTD	35,030	5.28	184,958.40
	TRANSURBAN GROUP	113,696	13.27	1,508,745.92
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	22,000	35.02	770,440.00
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,130	58.96	125,584.80
	IDP EDUCATION LTD	7,220	28.27	204,109.40
	LOTTERY CORP LTD/THE	85,554	4.37	373,870.98
	REA GROUP LTD	1,820	122.83	223,550.60
	SEEK LTD	12,860	20.32	261,315.20
	WESFARMERS LTD	42,745	46.04	1,967,979.80
COLES GROUP LTD	52,085	16.75	872,423.75	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	50,462	7.12	359,289.44	
WOOLWORTHS GROUP LTD	45,862	34.87	1,599,207.94	
TREASURY WINE ESTATES LTD	27,906	13.09	365,289.54	
COCHLEAR LTD	2,527	206.96	522,987.92	

	RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,105	62.76	445,909.80	
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	30.52	538,983.20	
	CSL LTD	18,432	283.03	5,216,808.96	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	110,339	23.84	2,630,481.76	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	64,807	96.53	6,255,819.71	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	122,073	30.22	3,689,046.06	
	WESTPAC BANKING CORP	134,371	21.89	2,941,381.19	
	ASX LTD	7,105	72.35	514,046.75	
	MACQUARIE GROUP LTD	13,964	172.85	2,413,677.40	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	4.49	427,111.25	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	108,430	3.52	381,673.60	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	55,210	12.14	670,249.40	
	SUNCORP GROUP LTD	51,856	10.48	543,450.88	
	COMPUTERSHARE LTD	20,910	25.06	524,004.60	
	WISETECH GLOBAL LTD	5,920	57.62	341,110.40	
	XERO LTD	5,480	85.56	468,868.80	
	TELSTRA CORPORATION LTD	163,984	3.80	623,139.20	
	APA GROUP	45,818	10.44	478,339.92	
	ORIGIN ENERGY LTD	68,320	5.91	403,771.20	
	豪ドル小計	2,613,411		57,007,283.52	(5,481,820,383)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,165	7.74	365,057.10	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,130	19.58	452,885.40	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	5.16	395,520.20	
	MERCURY NZ LTD	20,400	6.07	123,828.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	45,980	5.08	233,578.40	
	ニュージーランドドル小計	213,252		1,570,869.10	(133,209,699)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	102,208	48.30	4,936,646.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	52,500	89.60	4,704,000.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	71,000	13.28	942,880.00	
	MTR CORP	57,500	40.30	2,317,250.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	16.52	859,040.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	86,000	45.10	3,878,600.00	
	SANDS CHINA LTD	96,600	19.28	1,862,448.00	

	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	22.70	1,541,330.00	
	WH GROUP LTD	339,394	5.43	1,842,909.42	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	134,500	26.65	3,584,425.00	
	HANG SENG BANK LTD	29,100	123.50	3,593,850.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	46,400	292.60	13,576,640.00	
	AIA GROUP LTD	457,190	71.65	32,757,663.50	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	77,038	53.60	4,129,236.80	
	ESR GROUP LTD	75,800	21.65	1,641,070.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	13.58	1,059,240.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	24.95	1,444,629.95	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	61,666	26.55	1,637,232.30	
	SINO LAND CO	143,050	11.40	1,630,770.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	55,980	96.10	5,379,678.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	17,517	59.10	1,035,254.70	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	18.66	776,256.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	39.50	2,520,100.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	10.22	1,533,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	44.15	1,103,750.00	
	CLP HOLDINGS LTD	59,500	65.85	3,918,075.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	95,000	6.09	578,550.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	436,237	7.38	3,219,429.06	
	POWER ASSETS HOLDINGS	55,000	43.60	2,398,000.00	
香港ドル小計		3,085,381		110,401,954.13 (2,021,459,780)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	53,360	7.17	382,591.20	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	63,300	3.69	233,577.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	5.32	286,748.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.80	169,935.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	3.95	292,142.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	68,695	33.66	2,312,273.70	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	131,740	12.37	1,629,623.80	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	41,800	27.39	1,144,902.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	25,200	9.53	240,156.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	105,000	3.66	384,300.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	8.27	143,071.00	

	UOL GROUP LTD	15,550	7.04	109,472.00	
	VENTURE CORP LTD	9,900	17.24	170,676.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	304,780	2.69	819,858.20	
シンガポールドル小計		1,175,585		8,319,326.40	(847,822,553)
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	26,090	29.08	758,697.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,010	685.00	691,850.00	
	BANK HAPOALIM BM	41,135	32.42	1,333,596.70	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	62,565	33.08	2,069,650.20	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	48,330	19.49	941,951.70	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,900	132.50	649,250.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,780	266.20	473,836.00	
	NICE LTD	2,440	675.60	1,648,464.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	68,700	6.09	418,383.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	3,740	154.20	576,708.00	
イスラエルシュケル小計		260,690		9,562,386.80	(398,345,128)
合 計		42,291,523		245,881,606,322	(245,881,606,322)

(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	859,755.60	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	12,380	424,138.80	
		AMERICAN TOWER CORP	17,269	4,108,295.10	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	62,230	378,358.40	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,375	1,036,730.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,717	454,673.01	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,700	459,207.00	
		CROWN CASTLE INC	16,520	2,665,336.80	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,005	1,207,798.75	
		DUKE REALTY CORPORATION	14,585	766,879.30	

		EQUINIX INC	3,493	2,153,434.50
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,980	473,313.80
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	13,690	956,383.40
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	622,728.00
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,130	918,680.40
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	9,370	448,073.40
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	11,000	253,770.00
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	502,447.50
		HOST HOTELS & RESORTS INC	27,179	481,068.30
		INVITATION HOMES INC	22,810	814,317.00
		IRON MOUNTAIN INC	11,435	579,182.75
		KIMCO REALTY CORP	24,630	498,757.50
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	23,470	308,395.80
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,490	718,265.30
		PROLOGIS INC	27,998	3,105,818.14
		PUBLIC STORAGE	6,014	1,841,967.92
		REALTY INCOME CORP	22,221	1,401,922.89
		REGENCY CENTERS CORP	6,005	341,504.35
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,210	1,273,230.30
		SIMON PROPERTY GROUP INC	12,504	1,229,393.28
		SUN COMMUNITIES INC	3,840	565,593.60
		UDR INC	12,100	511,830.00
		VENTAS INC	15,485	718,658.85
		VICI PROPERTIES INC	36,480	1,203,110.40
		VORNADO REALTY TRUST	6,851	178,948.12
		WELLTOWER INC	17,230	1,198,518.80
		WEYERHAEUSER CO	27,758	827,743.56
		WP CAREY INC	7,310	601,393.70
米ドル小計			547,259	37,089,624.32 (5,330,891,703)
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	117,600.00
加ドル小計			2,800	117,600.00 (12,645,528)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	98,945.00
		GECINA SA	1,950	167,797.50

		KLEPIERRE	8,402	157,201.42	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,940	238,947.80	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	5,160	140,248.80	
ユーロ小計			22,377	803,140.52	(115,017,753)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	30,601	120,170.12	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	157,241.34	
		SEGRO PLC	45,033	381,519.57	
英ポンド小計			102,258	658,931.03	(107,761,580)
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	42,067	348,314.76	
		GOODMAN GROUP	63,582	1,134,302.88	
		GPT GROUP	71,335	293,900.20	
		LENDLEASE GROUP	28,927	282,327.52	
		MIRVAC GROUP	135,075	282,306.75	
		SCENTRE GROUP	198,271	551,193.38	
		STOCKLAND	96,900	333,336.00	
		VICINITY CENTRES	154,902	286,568.70	
豪ドル小計			791,059	3,512,250.19	(337,737,978)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	81,700	5,143,015.00	
香港ドル小計			81,700	5,143,015.00	(94,168,604)
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	138,243	389,845.26	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	433,780.92	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	144,556	247,190.76	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	106,000	200,340.00	
シンガポールドル小計			598,355	1,271,156.94	(129,543,603)
合計				6,127,766,749	(6,127,766,749)

(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 601銘柄	97.2%		72.6%
	投資証券 38銘柄		2.8%	2.1%
加ドル	株式 84銘柄	99.9%		3.8%
	投資証券 1銘柄		0.1%	0.0%
ユーロ	株式 222銘柄	99.5%		8.6%
	投資証券 5銘柄		0.5%	0.0%
英ポンド	株式 80銘柄	99.0%		4.3%
	投資証券 3銘柄		1.0%	0.0%
スイスフラン	株式 41銘柄	100.0%		3.0%
スウェーデンクローナ	株式 46銘柄	100.0%		0.9%
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%		0.7%
豪ドル	株式 51銘柄	94.2%		2.2%
	投資証券 8銘柄		5.8%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式 29銘柄	95.5%		0.8%
	投資証券 1銘柄		4.5%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	86.7%		0.3%
	投資証券 4銘柄		13.3%	0.1%
イスラエルシェケル	株式 10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。

海外新興国株式インデックスMSCIEマージング（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

	2021年 9月21日現在	2022年 9月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	4,884,951,784	1,933,542,413
コール・ローン	72,182,422	1,260,817,628
株式	101,825,227,115	89,562,031,570
投資証券	94,686,312	100,035,022
派生商品評価勘定	106,000	1,086,299
未収入金	1,123,056	31,275,549
未収配当金	162,398,173	151,418,286
未収利息	1,187	10,491
差入委託証拠金	701,610,414	4,214,592,065
流動資産合計	107,742,286,463	97,254,809,323
資産合計	107,742,286,463	97,254,809,323
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	269,483,638	213,183,222
未払解約金	39,631,656	1,290,576,504
未払利息	15	1,715
流動負債合計	309,115,309	1,503,761,441
負債合計	309,115,309	1,503,761,441
純資産の部		
元本等		
元本	48,129,522,181	42,339,806,937
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	59,303,648,973	53,411,240,945
元本等合計	107,433,171,154	95,751,047,882
純資産合計	107,433,171,154	95,751,047,882
負債純資産合計	107,742,286,463	97,254,809,323

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(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。 (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。
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 9月21日現在	2022年 9月21日現在
1.	期首	2020年 9月24日	2021年 9月22日
	期首元本額	77,623,204,655円	48,129,522,181円
	期首からの追加設定元本額	3,184,836,680円	9,267,492,418円
	期首からの一部解約元本額	32,678,519,154円	15,057,207,662円
	元本の内訳		
	日興五大陸株式ファンド	1,690,604,244円	1,751,341,825円
	インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	14,089,546,047円	16,229,704,319円
	インデックスファンド新興国株式（適格機関投資家向け）	3,534,396,885円	3,279,235,631円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	28,814,975,005円	21,079,525,162円
	計	48,129,522,181円	42,339,806,937円
2.	受益権の総数	48,129,522,181口	42,339,806,937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 9月24日 至 2021年 9月21日	自 2021年 9月22日 至 2022年 9月21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 9月21日現在	2022年 9月21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 9月21日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,527,432,633
投資証券	3,777,282
合計	2,531,209,915

(2022年 9月21日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,672,839,224
投資証券	8,732,217
合計	2,681,571,441

(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 9月21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	5,770,008,794	-	5,500,622,183	269,386,611
合計		5,770,008,794	-	5,500,622,183	269,386,611

(2022年 9月21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	6,280,209,766	-	6,068,855,520	211,354,246
合計		6,280,209,766	-	6,068,855,520	211,354,246

(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 9月21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	39,623,000	-	39,525,973	97,027
	米ドル	39,623,000	-	39,525,973	97,027
	売建	39,623,000	-	39,517,000	106,000
	台湾ドル	39,623,000	-	39,517,000	106,000
	合計	79,246,000	-	79,042,973	8,973

(2022年 9月21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	388,720,878	-	389,145,016	424,138
	米ドル	388,720,878	-	389,145,016	424,138
	売建	478,457,608	-	479,624,423	1,166,815
	メキシコペソ	5,340,975	-	5,392,350	51,375
	ブラジルリアル	41,041,518	-	41,041,518	-
	香港ドル	54,660,300	-	54,926,100	265,800
	インドネシアルピア	26,736,160	-	26,736,160	-
	韓国ウォン	112,488,000	-	112,597,000	109,000
	台湾ドル	145,840,000	-	146,556,800	716,800
	南アフリカランド	29,735,455	-	29,595,295	140,160
	サウジアラビアリアル	62,615,200	-	62,779,200	164,000
		合計	867,178,486	-	868,769,439

(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 9月21日現在		2022年 9月21日現在	
1口当たり純資産額	2.2322円	1口当たり純資産額	2.2615円
(1万口当たり純資産額)	(22,322円)	(1万口当たり純資産額)	(22,615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	COSAN SA -ADR	3,000	14.26	42,780.00	
	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	1,500	10.05	15,075.00	
	GAZPROM PAO-SPON ADR	649,360	0.00	64.93	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	129,600	1.70	220,708.80	
	LUKOIL PJSC	43,315	0.00	4.33	
	LUKOIL PJSC-SPON-ADR	2,640	0.00	0.26	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	10,221	0.00	1.02	
	PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR	12,200	13.54	165,188.00	

PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	2,850	12.07	34,399.50
ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	126,380	0.00	12.63
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	174,750	0.00	17.47
TATNEFT-SPONSORED-ADR	27,469	0.00	2.74
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	22,750	6.21	141,277.50
GERDAU SA -SPON ADR	18,050	4.65	83,932.50
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	72,014	0.00	7.20
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	18,540	0.00	1.85
PHOSAGRO PJSC REG S-GDR	17,606	0.00	1.76
PHOSAGRO PJSC REG S-GDR(FUKA)	113	0.00	0.01
POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,870	0.00	0.78
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	5,470	104.66	572,490.20
SEVERSTAL - GDR REG S	26,330	0.00	2.63
SOUTHERN COPPER CORP(US)	8,265	47.32	391,099.80
VALE SA-SP ADR	8,700	13.40	116,580.00
GRUPO AEROPORTUARIO PAC-ADR	250	145.21	36,302.50
GRUPO AEROPORTUARIO SUR-ADR	150	216.17	32,425.50
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	42,850	26.14	1,120,099.00
LI AUTO INC - ADR	55,600	25.34	1,408,904.00
NIO INC - ADR	138,400	20.41	2,824,744.00
XPENG INC - ADR	42,850	15.93	682,600.50
H WORLD GROUP LTD-ADR	19,572	36.43	713,007.96
TAL EDUCATION GROUP- ADR	41,750	5.24	218,770.00
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	55,040	26.70	1,469,568.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	42,550	49.89	2,122,819.50
AUTOHOME INC-ADR	7,790	32.82	255,667.80
GRUPO TELEVISIA SA-SPONS ADR	4,900	6.05	29,645.00
IQIYI INC-ADR	34,750	3.22	111,895.00
JOYY INC-ADR	4,790	27.68	132,587.20
KANZHUN LTD-ADR	18,650	21.11	393,701.50
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	70,000	4.58	320,600.00
VK CO LTD -GDR	15,200	0.00	1.52
WEIBO CORP-SPON-ADR	7,714	18.93	146,026.02
YANDEX NV-A	35,050	0.00	3.50
OZON HOLDINGS PLC - ADR	6,400	0.00	0.64

	PINDUODUO INC-ADR	51,070	66.10	3,375,727.00	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	45,898	9.90	454,390.20	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	43,800	0.00	4.38	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	15,430	0.00	1.54	
	AMBEV SA-ADR	8,500	3.00	25,500.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	6,980	10.09	70,428.20	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SP ADR	1,100	62.46	68,706.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEX-SP ADR	700	64.02	44,814.00	
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	51,300	1.23	63,099.00	
	BEIGENE LTD-ADR	4,787	153.74	735,953.38	
	HUTCHMED CHINA-ADR	9,650	10.94	105,571.00	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	4,750	41.39	196,602.50	
	ZAI LAB LTD-ADR	9,255	49.12	454,605.60	
	BANCO BRADESCO-ADR	7,300	3.89	28,397.00	
	CREDICORP LTD	7,245	131.04	949,384.80	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	576,360	0.00	57.63	
	SBERBANK PJSC-SPONSORED ADR	51,750	0.00	5.17	
	TCS GROUP HOLDING -REG S-GDR	13,410	0.00	1.34	
	VTB BANK PJSC	336,460,000	0.00	33,646.00	
	360 DIGITECH INC-ADR	9,200	14.42	132,664.00	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	69,250	3.56	246,530.00	
	KE HOLDINGS INC-ADR	67,320	18.05	1,215,126.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	54,680	0.82	45,001.64	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	45,240	3.13	141,601.20	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	60,892	0.00	6.08	
	TELEFONICA BRASIL-ADR	13,037	7.98	104,035.26	
	TIM SA-ADR	4,800	11.65	55,920.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BR-SP ADR	75,150	8.58	644,787.00	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	6,350	55.99	355,536.50	
米ドル小計		339,808,453		23,351,120.47 (3,356,256,545)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	1,475,603	7.13	10,521,049.39	
	GRUPO MEXICO SA-SER B	315,778	76.82	24,258,065.96	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	15,350	192.91	2,961,168.50	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	101,665	38.47	3,911,052.55	

	ALFA S.A.B. -A	322,500	13.29	4,286,025.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	40,600	76.36	3,100,216.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	35,862	289.40	10,378,462.80	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	18,675	431.66	8,061,250.50	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	23,600	141.38	3,336,568.00	
	GRUPO TELEVISA SAB	224,900	24.34	5,474,066.00	
	WALMART DE MEXICO -SER V	522,200	76.10	39,739,420.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	44,000	140.50	6,182,000.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	40,100	125.24	5,022,124.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	183,154	127.88	23,421,733.52	
	GRUMA S.A.B. -B	21,725	213.61	4,640,677.25	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	133,200	72.97	9,719,604.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	164,470	27.29	4,488,386.30	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	262,300	135.39	35,512,797.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	227,300	33.40	7,591,820.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,830,649	17.49	49,508,051.01	
メキシコペソ小計		7,003,631		262,114,537.78	(1,885,180,178)
ブラジルリアル	COSAN SA	111,200	18.48	2,054,976.00	
	PETRO RIO SA	75,700	28.33	2,144,581.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	356,160	34.76	12,380,121.60	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	476,260	31.09	14,806,923.40	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	77,480	12.98	1,005,690.40	
	BRASKEM SA-PREF A	20,800	29.50	613,600.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL	64,800	13.10	848,880.00	
	GERDAU SA-PREF	101,500	24.09	2,445,135.00	
	KLABIN SA - UNIT	81,100	18.57	1,506,027.00	
	SUZANO SA	75,447	44.03	3,321,931.41	
	VALE SA	395,306	69.45	27,454,001.70	
	WEG SA	168,672	31.13	5,250,759.36	
	CCR SA	108,820	13.70	1,490,834.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	74,379	64.21	4,775,875.59	
	RUMO SA	131,700	19.64	2,586,588.00	
	AMERICANAS SA	68,920	17.39	1,198,518.80	
	LOJAS RENNER S.A.	98,662	26.82	2,646,114.84	

	MAGAZINE LUIZA SA	292,700	4.46	1,305,442.00	
	VIBRA ENERGIA SA	120,200	18.65	2,241,730.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	50,800	21.51	1,092,708.00	
	RAIA DROGASIL SA	108,400	23.04	2,497,536.00	
	AMBEV SA	454,300	15.76	7,159,768.00	
	BRF SA	62,400	14.32	893,568.00	
	JBS SA	75,600	27.55	2,082,780.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	94,532	15.42	1,457,683.44	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	462,863	7.89	3,651,989.07	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	37,600	34.06	1,280,656.00	
	HYPERMARCAS SA	44,600	44.22	1,972,212.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	125,640	16.65	2,091,906.00	
	BANCO BRADESCO SA-PRF	542,479	20.16	10,936,376.64	
	BANCO DO BRASIL S.A.	88,300	40.79	3,601,757.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	24,150	31.28	755,412.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	484,415	28.60	13,854,269.00	
	ITAUSA SA-PRF	464,228	9.83	4,563,361.24	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	611,349	13.64	8,338,800.36	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	117,800	27.27	3,212,406.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	76,700	30.22	2,317,874.00	
	TOTVS SA	53,000	29.69	1,573,570.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	36,375	41.05	1,493,193.75	
	TIM SA	56,736	12.12	687,640.32	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	25,800	45.62	1,176,996.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	33,600	44.02	1,479,072.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	146,491	11.67	1,709,549.97	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	31,460	47.89	1,506,619.40	
	CPFL ENERGIA SA	18,300	34.67	634,461.00	
	ENERGISA SA-UNITS	21,000	44.97	944,370.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	21,050	39.89	839,684.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	105,400	24.60	2,592,840.00	
	ブラジルリアル小計	7,375,174		176,476,789.79	(4,927,126,084)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	39,100	6,850.00	267,835,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	109,000	1,532.50	167,042,500.00	

	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B-PRF	9,450	96,800.00	914,760,000.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	1,381,000	70.50	97,360,500.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	76,500	2,090.00	159,885,000.00	
	CENCOSUD SA	143,150	1,261.00	180,512,150.00	
	BANCO DE CHILE	4,688,284	86.00	403,192,424.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,845	26,000.00	151,970,000.00	
	BANCO SANTANDER CHILE SA	6,372,900	35.35	225,282,015.00	
	ENEL AMERICAS SA	1,956,620	101.20	198,009,944.00	
	ENEL CHILE SA	3,224,500	32.45	104,635,025.00	
チリペソ小計		18,006,349		2,870,484,558.00	(441,460,431)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	467,700	2,221.00	1,038,761,700.00	
	BANCOLOMBIA SA	22,980	33,100.00	760,638,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PRF	47,200	31,010.00	1,463,672,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	44,210	17,000.00	751,570,000.00	
コロンビアペソ小計		582,090		4,014,641,700.00	(130,327,313)
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	10,680	14.35	153,258.00	
	OPAP SA	17,880	13.19	235,837.20	
	JUMBO SA	12,640	14.60	184,544.00	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	240,000	0.91	219,600.00	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	258,200	0.94	243,224.40	
	NATIONAL BANK OF GREECE	53,400	3.31	177,021.00	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	18,790	15.52	291,620.80	
	PUBLIC POWER CORP	21,300	5.24	111,612.00	
ユーロ小計		632,890		1,616,717.40	(231,530,098)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	14,050	306.50	4,306,325.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	151,667	30.54	4,631,910.18	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	74,800	30.76	2,300,848.00	
	KOC HOLDING AS	73,684	48.02	3,538,305.68	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	135,400	27.64	3,742,456.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	52,700	72.45	3,818,115.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	6,260	344.60	2,157,196.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	43,290	116.30	5,034,627.00	

	AKBANK T.A.S.	336,489	11.88	3,997,489.32	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	95,700	26.84	2,568,588.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	332,912	8.29	2,759,840.48	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	116,756	22.50	2,627,010.00	
トルコリラ小計		1,433,708		41,482,710.66	(325,498,237)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	6,400	643.00	4,115,200.00	
	MONETA MONEY BANK AS	39,000	76.20	2,971,800.00	
	CEZ AS	17,560	936.00	16,436,160.00	
チェココルナ小計		62,960		23,523,160.00	(136,838,926)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	41,290	2,500.00	103,225,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	13,420	7,590.00	101,857,800.00	
	OTP BANK PLC	21,825	8,500.00	185,512,500.00	
ハンガリーフォリント小計		76,535		390,595,300.00	(139,371,824)
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	42,250	56.24	2,376,140.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	185,035	5.16	956,260.88	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	14,280	86.84	1,240,075.20	
	LPP SA	114	8,325.00	949,050.00	
	CD PROJEKT SA	5,810	89.29	518,774.90	
	CYFROWY POLSAT SA	19,980	17.40	347,652.00	
	ALLEGRO.EU SA	33,690	25.08	845,113.65	
	DINO POLSKA SA	4,900	343.20	1,681,680.00	
	BANK PEKAO SA	19,012	67.64	1,285,971.68	
	MBANK SA	1,600	248.60	397,760.00	
	PKO BANK POLSKI SA	86,555	23.72	2,053,084.60	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,440	215.80	742,352.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	58,800	27.65	1,625,820.00	
	ORANGE POLSKA SA	78,005	5.65	440,728.25	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	86,630	6.88	596,360.92		
ポーランドズロチ小計		640,101		16,056,824.08	(485,885,919)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	216,000	7.34	1,585,440.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	8.41	1,614,720.00	

CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,547,300	3.45	8,788,185.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	340,000	24.65	8,381,000.00	
CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	186,000	3.39	630,540.00	
PETROCHINA CO LTD-H	2,103,000	3.37	7,087,110.00	
YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	170,000	30.35	5,159,500.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	339,000	3.00	1,017,000.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	114,500	28.50	3,263,250.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	245,000	7.47	1,830,150.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	392,000	6.81	2,669,520.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	246,000	4.43	1,089,780.00	
CMOC GROUP LTD-H	351,000	3.36	1,179,360.00	
DONGYUE GROUP	161,000	8.35	1,344,350.00	
GANFENG LITHIUM CO LTD-H	28,560	65.50	1,870,680.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	119,000	9.55	1,136,450.00	
MMG LTD	372,000	2.01	747,720.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	183,000	6.20	1,134,600.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	60,000	12.56	753,600.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	146,500	5.73	839,445.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	573,750	8.70	4,991,625.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	248,000	3.48	863,040.00	
BOC AVIATION LTD	21,500	61.00	1,311,500.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	290,000	3.07	890,300.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	169,000	14.82	2,504,580.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	113,000	8.81	995,530.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	376,000	4.29	1,613,040.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	214,000	8.71	1,863,940.00	
CITIC LTD	576,000	8.08	4,654,080.00	
CRRG CORP LTD - H	401,000	2.80	1,122,800.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	241,000	5.03	1,212,230.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	69,000	16.64	1,148,160.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	126,000	8.40	1,058,400.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	88,500	7.15	632,775.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	192,400	9.15	1,760,460.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-H	61,478	10.54	647,978.12	
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	59,600	34.80	2,074,080.00	

ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TE-H	159,000	3.13	497,670.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	396,518	3.32	1,316,439.76
AIR CHINA LTD-H	174,000	6.18	1,075,320.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	204,000	4.86	991,440.00
CHINA COSCO HOLDINGS-H	316,850	9.71	3,076,613.50
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	139,000	11.76	1,634,640.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	144,000	4.27	614,880.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	210,000	5.12	1,075,200.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	62,000	6.54	405,480.00
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	13,500	146.00	1,971,000.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS	158,000	6.56	1,036,480.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	133,000	5.95	791,350.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	412,000	4.79	1,973,480.00
BYD CO LTD-H	81,500	222.00	18,093,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	312,000	4.67	1,457,040.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	66,800	37.00	2,471,600.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	611,000	13.02	7,955,220.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	356,500	10.76	3,835,940.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	332,845	6.39	2,126,879.55
MINIH GROUP LTD	74,000	21.65	1,602,100.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	132,000	14.48	1,911,360.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	124,200	92.20	11,451,240.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	374,000	4.12	1,540,880.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	221,200	25.60	5,662,720.00
LI NING CO LTD	241,000	65.90	15,881,900.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	83,700	72.50	6,068,250.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	148,500	9.88	1,467,180.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	118,000	15.58	1,838,440.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	74,000	15.76	1,166,240.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	152,500	18.90	2,882,250.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	125,600	16.12	2,024,672.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,530,000	0.56	856,800.00
BAIDU INC-CLASS A	222,860	124.50	27,746,070.00
BILIBILI INC-CLASS Z	19,617	133.60	2,620,831.20
CHINA LITERATURE LTD	48,400	27.85	1,347,940.00

CHINA RUYI HOLDINGS LTD	468,000	1.85	865,800.00	
KINGSOFT CORP LTD	97,200	22.90	2,225,880.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	177,300	57.70	10,230,210.00	
NETEASE INC	209,475	132.30	27,713,542.50	
TENCENT HOLDINGS LTD	628,150	293.40	184,299,210.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,523,300	86.20	131,308,460.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	466,000	3.98	1,854,680.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	60,000	14.82	889,200.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	114,800	51.15	5,872,020.00	
JD.COM INC - CL A	216,073	225.00	48,616,425.00	
MEITUAN-CLASS B	441,600	172.60	76,220,160.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	60,400	18.64	1,125,856.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	55,200	17.96	991,392.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	212,000	6.39	1,354,680.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	59,000	34.05	2,008,950.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	7,800	117.05	912,990.00	
CHINA FEIHE LTD	380,000	6.10	2,318,000.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	90,000	-	-	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	316,000	33.90	10,712,400.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	165,000	55.20	9,108,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	192,000	3.51	673,920.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	176,600	44.90	7,929,340.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	184,000	11.72	2,156,480.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	202,000	13.94	2,815,880.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	60,000	74.00	4,440,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	158,000	6.55	1,034,900.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	504,000	5.28	2,661,120.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	55,000	17.30	951,500.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	64,500	35.85	2,312,325.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	37,000	20.05	741,850.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	37,400	44.70	1,671,780.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	166,000	4.43	735,380.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	61,500	14.54	894,210.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	263,600	10.06	2,651,816.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	82,600	11.10	916,860.00	

SINOPHARM GROUP CO-H	136,000	15.62	2,124,320.00	
3SBIO INC	149,500	5.43	811,785.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	9,000	49.35	444,150.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	154,000	10.48	1,613,920.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	316,000	2.97	938,520.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	914,160	7.45	6,810,492.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	122,000	19.76	2,410,720.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	10,800	66.85	721,980.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	114,000	12.32	1,404,480.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	109,000	25.95	2,828,550.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	22,050	40.10	884,205.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	42,500	20.40	867,000.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,051,750	3.72	3,912,510.00	
WUXI APPTec CO LTD-H	30,229	68.70	2,076,732.30	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	364,000	49.45	17,999,800.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,682,000	2.47	6,624,540.00	
BANK OF CHINA LTD - H	7,728,000	2.69	20,788,320.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	779,245	4.35	3,389,715.75	
CHINA CITIC BANK - H	929,000	3.30	3,065,700.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	9,763,920	4.71	45,988,063.20	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	216,000	2.33	503,280.00	
CHINA MERCHANTS BANK - H	390,650	39.10	15,274,415.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	521,640	2.40	1,251,936.00	
IND & COMM BK OF CHINA - H	5,606,575	3.88	21,753,511.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	798,000	4.81	3,838,380.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	901,000	0.98	882,980.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	377,500	4.06	1,532,650.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	151,600	12.90	1,955,640.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	196,675	14.66	2,883,255.50	
FAR EAST HORIZON LTD	165,000	5.91	975,150.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	82,600	9.66	797,916.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	237,200	4.79	1,136,188.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	127,000	9.68	1,229,360.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	713,000	10.96	7,814,480.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	253,000	15.72	3,977,160.00	

CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	154,740	7.36	1,138,886.40
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO-H	81,000	16.18	1,310,580.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	691,000	2.35	1,623,850.00
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	708,001	8.44	5,975,528.44
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	626,500	44.05	27,597,325.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	70,700	21.15	1,495,305.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES	75,750	7.30	552,975.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	470,000	1.86	874,200.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	380,320	22.10	8,405,072.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	135,000	8.16	1,101,600.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	319,777	33.30	10,648,574.10
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	68,600	34.25	2,349,550.00
CHINA VANKE CO LTD-H	141,126	15.48	2,184,630.48
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	438,672	1.60	701,875.20
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	816,713	2.28	1,862,105.64
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	213,000	14.72	3,135,360.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	83,000	17.62	1,462,460.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	166,000	5.60	929,600.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	78,725	10.14	798,271.50
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	181,000	26.60	4,814,600.00
SEAZEN GROUP LTD	164,000	2.48	406,720.00
WHARF HOLDINGS LTD	129,000	28.95	3,734,550.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	129,200	10.62	1,372,104.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	304,000	5.72	1,738,880.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	86,856	21.05	1,828,318.80
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	271,000	12.14	3,289,940.00
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	71,000	5.55	394,050.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	94,000	12.90	1,212,600.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	74,500	13.68	1,019,160.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	66,500	22.95	1,526,175.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	70,500	25.50	1,797,750.00
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	105,000	8.00	840,000.00
LENOVO GROUP LTD	736,000	6.16	4,533,760.00
SUNNY OPTICAL TECH	72,200	95.65	6,905,930.00
XIAOMI CORP-CLASS B	1,539,000	10.04	15,451,560.00

ZTE CORP-H	57,400	15.82	908,068.00		
CHINA TOWER CORP LTD-H	4,472,000	0.93	4,158,960.00		
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	56,500	25.00	1,412,500.00		
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	504,000	1.90	957,600.00		
CGN POWER CO LTD-H	1,078,000	1.84	1,983,520.00		
CHINA GAS HOLDINGS LTD	315,000	11.48	3,616,200.00		
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	340,000	11.50	3,910,000.00		
CHINA POWER INTERNATIONAL	538,000	3.94	2,119,720.00		
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	96,000	28.80	2,764,800.00		
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	195,000	14.20	2,769,000.00		
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	80,800	109.80	8,871,840.00		
GUANGDONG INVEST	316,000	7.11	2,246,760.00		
HUANENG POWER INTL INC-H	492,000	3.89	1,913,880.00		
KUNLUN ENERGY CO LTD	398,000	6.38	2,539,240.00		
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	57,000	22.00	1,254,000.00		
HANERGY THIN FILM POWER GROU	240,000	-	-		
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	60,000	20.40	1,224,000.00		
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	502,000	9.92	4,979,840.00		
香港ドル小計	84,070,350		1,135,306,259.94 (20,787,457,619)		
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	357,700	2.25	804,825.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	36,700	21.68	795,656.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	249,500	8.70	2,170,650.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	404,400	4.42	1,787,448.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	23,700	6.61	156,657.00	
	SIME DARBY BERHAD	279,020	2.25	627,795.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	98,400	5.98	588,432.00	
	MISC BHD	107,500	6.98	750,350.00	
	GENTING BHD	218,900	4.46	976,294.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	315,400	2.87	905,198.00	
	MR DIY GROUP M BHD	220,950	2.04	450,738.00	
	IOI CORPORATION BERHAD	256,875	3.93	1,009,518.75	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	45,100	21.96	990,396.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	5,400	130.00	702,000.00	
	PPB GROUP BERHAD	63,980	16.38	1,047,992.40	

	QL RESOURCES BHD	114,500	5.05	578,225.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	197,820	4.44	878,320.80	
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	188,200	1.54	289,828.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	166,400	6.14	1,021,696.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	608,300	0.70	428,851.50	
	AMMB HOLDINGS BHD	195,800	4.06	794,948.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	707,000	5.48	3,874,360.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	64,800	20.78	1,346,544.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	10,900	18.90	206,010.00	
	MALAYAN BANKING BHD	489,650	8.70	4,259,955.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	1,458,450	4.45	6,490,102.50	
	RHB BANK BHD	154,859	5.67	878,050.53	
	AXIATA GROUP BERHAD	239,800	2.83	678,634.00	
	DIGI.COM BHD	295,800	3.49	1,032,342.00	
	MAXIS BHD	235,400	3.71	873,334.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	110,200	5.97	657,894.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	79,600	16.70	1,329,320.00	
	TENAGA NASIONAL BERHAD	229,625	8.80	2,020,700.00	
	INARI AMERTRON BHD	324,900	2.71	880,479.00	
	マレーシアリングット小計	8,555,529		42,283,544.48	(1,331,047,925)
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	143,810	169.50	24,375,795.00	
	PTT PCL-NVDR	964,400	37.00	35,682,800.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	138,100	55.00	7,595,500.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	157,300	40.75	6,409,975.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	221,145	44.25	9,785,666.25	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	130,900	55.25	7,232,225.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	81,300	337.00	27,398,100.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	445,400	73.25	32,625,550.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-NVDR	537,300	9.50	5,104,350.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	802,600	8.70	6,982,620.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	943,300	5.90	5,565,470.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	324,068	28.25	9,154,921.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	170,316	39.75	6,770,061.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	638,400	13.80	8,809,920.00	

	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	274,400	26.50	7,271,600.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	123,700	32.75	4,051,175.00	
	CP ALL PCL-NVDR	602,800	58.25	35,113,100.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	34,500	94.50	3,260,250.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	353,300	25.00	8,832,500.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	123,000	28.50	3,505,500.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	319,200	17.50	5,586,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,086,800	29.25	31,788,900.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	50,400	226.00	11,390,400.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	60,000	150.50	9,030,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	394,225	17.00	6,701,825.00	
	SCB X PCL-NVDR	85,100	107.50	9,148,250.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	118,500	17.70	2,097,450.00	
	JMT NETWORK SERVICES-NVDR	79,900	74.25	5,932,575.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	87,800	60.00	5,268,000.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	76,900	41.75	3,210,575.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	89,100	49.00	4,365,900.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	197,000	68.25	13,445,250.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	917,700	8.80	8,075,760.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	32,800	614.00	20,139,200.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	121,600	191.00	23,225,600.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	89,900	71.50	6,427,850.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	1,223,500	4.86	5,946,210.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	38,700	35.50	1,373,850.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	22,100	172.50	3,812,250.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	177,200	91.00	16,125,200.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	64,900	68.50	4,445,650.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	290,390	53.50	15,535,865.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	101,850	42.50	4,328,625.00	
	タイパーツ小計	12,935,604		472,928,263.25	(1,830,232,378)
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	159,100	57.50	9,148,250.00	
	AYALA CORPORATION	24,302	703.00	17,084,306.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	5,187	493.00	2,557,191.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	300,345	48.20	14,476,629.00	

	SM INVESTMENTS CORP	23,993	828.00	19,866,204.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	97,930	183.80	17,999,534.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	47,540	244.00	11,599,760.00	
	MONDE NISSIN CORP	642,900	13.88	8,923,452.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	83,760	121.50	10,176,840.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	158,607	96.85	15,361,087.95	
	BDO UNIBANK INC	211,104	123.10	25,986,902.40	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	188,237	52.90	9,957,737.30	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	580,000	3.64	2,111,200.00	
	AYALA LAND INC	753,060	27.65	20,822,109.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,148,010	35.60	40,869,156.00	
	CONVERGE INFORMATION AND COM	210,200	17.26	3,628,052.00	
	GLOBE TELECOM INC	2,630	2,180.00	5,733,400.00	
	PLDT INC	8,335	1,639.00	13,661,065.00	
	ACEN CORP	829,000	6.67	5,529,430.00	
	ACEN CORP(N)	68,270	6.67	455,360.90	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	20,530	301.00	6,179,530.00	
	フィリピンペソ小計	5,563,040		262,127,196.55 (655,396,629)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	1,612,200	3,890.00	6,271,458,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	175,600	34,150.00	5,996,740,000.00	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK	769,500	1,775.00	1,365,862,500.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	899,300	2,050.00	1,843,565,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	3,086,400	805.00	2,484,552,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	283,000	9,075.00	2,568,225,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,176,873	4,170.00	4,907,560,410.00	
	SEMEN GRESIK (PERSERO) PT	304,300	7,200.00	2,190,960,000.00	
	VALE INDONESIA TBK PT	236,200	6,475.00	1,529,395,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,068,300	7,175.00	14,840,052,500.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	1,608,200	2,240.00	3,602,368,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	728,100	5,550.00	4,040,955,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	35,100	23,050.00	809,055,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	212,300	8,875.00	1,884,162,500.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAK TBK	452,600	6,200.00	2,806,120,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	753,000	4,730.00	3,561,690,000.00	

	KALBE FARMA TBK PT	2,187,700	1,850.00	4,047,245,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	5,539,700	8,550.00	47,364,435,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	398,600	7,375.00	2,939,675,000.00	
	BANK MANDIRI TBK	1,902,600	9,200.00	17,503,920,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	6,817,700	4,490.00	30,611,473,000.00	
	PT BANK NEGARA INDONESIA	766,800	8,975.00	6,882,030,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,314,200	1,210.00	2,800,182,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,001,900	4,480.00	22,408,512,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	428,900	2,800.00	1,200,920,000.00	
	インドネシアルピア小計	39,759,073		196,461,112,910.00 (1,886,026,683)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	4,950	58,700.00	290,565,000.00	
	S-OIL CORPORATION	4,835	88,900.00	429,831,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,670	179,000.00	1,014,930,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	11,932	50,600.00	603,759,200.00	
	HYUNDAI STEEL CO	8,260	34,000.00	280,840,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	925	601,000.00	555,925,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,970	130,500.00	257,085,000.00	
	LG CHEM LTD	5,027	630,000.00	3,167,010,000.00	
	LG CHEM LTD-PRF	700	287,000.00	200,900,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	1,795	173,500.00	311,432,500.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	2,873	179,000.00	514,267,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	7,870	239,500.00	1,884,865,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	1,190	101,500.00	120,785,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,860	73,700.00	210,782,000.00	
	SKC CO LTD	2,170	105,000.00	227,850,000.00	
	CJ CORP	1,235	76,300.00	94,230,500.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,600	32,300.00	148,580,000.00	
	DOOSAN ENERBILITY	41,070	17,350.00	712,564,500.00	
	ECOPRO BM CO LTD	5,334	102,000.00	544,068,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	7,063	28,000.00	197,764,000.00	
	GS HOLDINGS	4,395	46,300.00	203,488,500.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	7,160	44,350.00	317,546,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	1,720	121,000.00	208,120,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,940	51,200.00	406,528,000.00	

KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	3,987	83,700.00	333,711,900.00	
LG CORP	9,361	80,100.00	749,816,100.00	
LG ENERGY SOLUTION	2,395	483,500.00	1,157,982,500.00	
SAMSUNG C&T CORP	8,347	113,500.00	947,384,500.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	16,910	22,950.00	388,084,500.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	63,069	5,510.00	347,510,190.00	
SK INC	3,841	225,500.00	866,145,500.00	
S1 CORPORATION	1,600	56,900.00	91,040,000.00	
CJ LOGISTICS	515	106,500.00	54,847,500.00	
HMM CO LTD	28,850	20,100.00	579,885,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,870	180,500.00	337,535,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	16,524	25,850.00	427,145,400.00	
PAN OCEAN CO LTD	30,520	5,330.00	162,671,600.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	7,952	39,900.00	317,284,800.00	
HANON SYSTEMS	18,900	10,350.00	195,615,000.00	
HYUNDAI MOBIS	6,200	215,500.00	1,336,100,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	14,030	198,500.00	2,784,955,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,530	92,000.00	324,760,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	2,410	92,000.00	221,720,000.00	
KIA CORP	26,500	80,400.00	2,130,600,000.00	
COWAY CO LTD	5,640	57,000.00	321,480,000.00	
F&F CO LTD / NEW	1,620	156,000.00	252,720,000.00	
HLB INC	9,778	43,050.00	420,942,900.00	
LG ELECTRONICS INC	10,505	89,700.00	942,298,500.00	
KANGWON LAND INC	8,450	25,950.00	219,277,500.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	8,070	23,050.00	186,013,500.00	
CJ ENM CO LTD	1,332	87,700.00	116,816,400.00	
HYBE CO LTD	1,650	157,500.00	259,875,000.00	
KAKAO CORP	31,305	65,300.00	2,044,216,500.00	
KAKAO GAMES CORP	3,130	46,400.00	145,232,000.00	
KRAFTON INC	2,490	225,500.00	561,495,000.00	
NAVER CORP	13,175	218,000.00	2,872,150,000.00	
NCSOFT CORP	1,670	357,000.00	596,190,000.00	
NETMARBLE CORP	2,210	59,700.00	131,937,000.00	
PEARL ABYSS CORP	3,205	55,700.00	178,518,500.00	

HOTEL SHILLA CO LTD	3,390	76,800.00	260,352,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	1,212	94,400.00	114,412,800.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	767	164,000.00	125,788,000.00	
E-MART CO LTD	2,142	92,400.00	197,920,800.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	744	404,500.00	300,948,000.00	
KT&G CORP	11,925	86,200.00	1,027,935,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	2,296	103,000.00	236,488,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	2,990	119,500.00	357,305,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	1,545	33,250.00	51,371,250.00	
LG H&H	1,015	679,000.00	689,185,000.00	
LG H&H-PRF	70	360,500.00	25,235,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,704	67,500.00	587,520,000.00	
SD BIOSENSOR INC	3,880	29,950.00	116,206,000.00	
ALTEOGEN INC	2,520	53,000.00	133,560,000.00	
CELLTRION INC	9,956	175,500.00	1,747,278,000.00	
CELLTRION PHARM INC	1,701	68,000.00	115,668,000.00	
GREEN CROSS CORP	670	140,000.00	93,800,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	703	280,000.00	196,840,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,800	800,000.00	1,440,000,000.00	
SEEGENE INC	3,730	27,700.00	103,321,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,940	66,400.00	195,216,000.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,410	93,200.00	224,612,000.00	
YUHAN CORP	5,188	56,100.00	291,046,800.00	
HANA FINANCIAL GROUP	30,808	39,050.00	1,203,052,400.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	23,970	9,930.00	238,022,100.00	
KAKAOBANK CORP	12,080	25,250.00	305,020,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	39,070	49,950.00	1,951,546,500.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	45,498	36,550.00	1,662,951,900.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	55,991	11,850.00	663,493,350.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,985	55,900.00	222,761,500.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	3,420	24,600.00	84,132,000.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	28,800	4,720.00	135,936,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	20,618	6,660.00	137,315,880.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	6,700	9,750.00	65,325,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,567	34,050.00	155,506,350.00	

	DONGBU INSURANCE CO LTD	4,980	59,300.00	295,314,000.00	
	MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	3,190	35,500.00	113,245,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,270	195,000.00	637,650,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	8,275	64,900.00	537,047,500.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,960	121,500.00	359,640,000.00	
	ILJIN MATERIALS CO LTD	2,500	62,900.00	157,250,000.00	
	L&F CO LTD	2,510	214,900.00	539,399,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	21,290	14,350.00	305,511,500.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,485	343,500.00	510,097,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,585	128,000.00	714,880,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	480,160	55,800.00	26,792,928,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	82,110	51,000.00	4,187,610,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	5,548	634,000.00	3,517,432,000.00	
	LG UPLUS CORP.	21,900	11,450.00	250,755,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	27,220	19,600.00	533,512,000.00	
	SK HYNIX INC	54,880	88,000.00	4,829,440,000.00	
	SK SQUARE CO LTD	9,643	40,200.00	387,648,600.00	
韓国ウォン小計		1,600,396		96,034,105,720.00	(9,920,323,120)
台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	102,080	80.90	8,258,272.00	
	ASIA CEMENT CORP	196,978	43.95	8,657,183.10	
	CHINA STEEL CORP	1,196,181	28.60	34,210,776.60	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	346,047	68.00	23,531,196.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	420,424	86.10	36,198,506.40	
	NAN YA PLASTICS CORP	476,145	67.20	31,996,944.00	
	TAIWAN CEMENT	606,420	38.55	23,377,491.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	14,696	795.00	11,683,320.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	322,957	32.80	10,592,989.60	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	7,000	1,575.00	11,025,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	248,786	42.50	10,573,405.00	
	CHINA AIRLINES LTD	272,000	22.70	6,174,400.00	
	EVA AIRWAYS CORP	252,000	35.10	8,845,200.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	105,200	172.50	18,147,000.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	167,000	28.95	4,834,650.00	
	WAN HAI LINES LTD	69,575	75.10	5,225,082.50	

YANG MING MARINE TRANSPORT	177,000	68.50	12,124,500.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	133,947	39.60	5,304,301.20	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	18,254	454.50	8,296,443.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	44,935	178.50	8,020,897.50	
GIANT MANUFACTURING	27,000	234.00	6,318,000.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	18,000	279.50	5,031,000.00	
POU CHEN	226,145	30.50	6,897,422.50	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	31,000	600.00	18,600,000.00	
MOMO.COM INC	6,000	614.00	3,684,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	56,448	277.50	15,664,320.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	464,703	65.50	30,438,046.50	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	421,316	17.55	7,394,095.80	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,756,746	22.20	38,999,761.20	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,297,217	27.40	35,543,745.80	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,092,117	26.50	28,941,100.50	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	923,004	23.15	21,367,542.60	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,111,114	34.45	38,277,877.30	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,093,905	17.60	19,252,728.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,083,746	14.80	16,039,440.80	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,019,824	27.25	27,790,204.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	374,161	48.70	18,221,640.70	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	140,392	197.50	27,727,420.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	961,507	20.50	19,710,893.50	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO(N)	30,915	20.50	633,757.50	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	770,731	43.05	33,179,969.55	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,544,715	13.10	20,235,766.50	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	701,060	56.90	39,890,314.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	1,254,954	8.69	10,905,550.26	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	105,986	58.90	6,242,575.40	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	53,000	290.50	15,396,500.00	
ACER INC	260,812	21.90	5,711,782.80	
ADVANTECH CO LTD	43,627	320.50	13,982,453.50	
ASUSTEK COMPUTER INC	70,797	253.50	17,947,039.50	
AUO CORP	830,994	17.10	14,209,997.40	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	66,405	176.00	11,687,280.00	

COMPAL ELECTRONICS	437,955	22.70	9,941,578.50	
DELTA ELECTRONICS INC	196,541	271.00	53,262,611.00	
E INK HOLDINGS INC	93,000	235.50	21,901,500.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,261,212	108.50	136,841,502.00	
INNOLUX CORP	1,037,282	11.65	12,084,335.30	
INVENTEC CORP	221,162	23.20	5,130,958.40	
LARGAN PRECISION CO LTD	10,186	1,915.00	19,506,190.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	209,787	68.20	14,307,473.40	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	68,000	122.00	8,296,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	20,000	220.50	4,410,000.00	
PEGATRON CORP	199,854	63.70	12,730,699.80	
QUANTA COMPUTER INC	273,416	79.30	21,681,888.80	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	142,120	56.10	7,972,932.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	131,000	129.00	16,899,000.00	
WIWYNN CORP	9,000	793.00	7,137,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	175,520	49.90	8,758,448.00	
YAGEO CORPORATION	43,829	333.50	14,616,971.50	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	69,000	116.00	8,004,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	374,371	118.00	44,175,778.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	179,000	72.70	13,013,300.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	169,188	96.80	16,377,398.40	
ASE INDUSTRIAL HOLDING CO LT	331,387	85.40	28,300,449.80	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	3,000	757.00	2,271,000.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	6,600	1,275.00	8,415,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	21,200	434.00	9,200,800.00	
MEDIATEK INC	153,432	605.00	92,826,360.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	105,000	47.65	5,003,250.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	59,522	243.50	14,493,607.00	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	715.00	5,720,000.00	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	270,000	31.55	8,518,500.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	47,815	305.00	14,583,575.00	
SILERGY CORP	33,800	509.00	17,204,200.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,476,355	476.50	1,179,983,157.50	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,202,592	40.15	48,284,068.80	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	83,000	72.20	5,992,600.00	

	WIN SEMICONDUCTORS CORP	35,000	156.50	5,477,500.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	280,000	20.50	5,740,000.00	
台湾ドル小計		33,454,092		2,772,063,416.71	(12,695,773,242)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	85,350	322.90	27,559,515.00	
	COAL INDIA LTD	162,930	229.85	37,449,460.50	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	71,780	233.70	16,774,986.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	270,530	69.10	18,693,623.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	251,580	133.20	33,510,456.00	
	PETRONET LNG LTD	78,980	211.10	16,672,678.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	305,252	2,502.85	763,999,968.20	
	ACC LTD	7,100	2,725.60	19,351,760.00	
	AMBUJA CEMENTS LIMITED	55,870	574.35	32,088,934.50	
	ASIAN PAINTS LTD	39,050	3,393.20	132,504,460.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	21,900	633.90	13,882,410.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	26,990	1,741.65	47,007,133.50	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	137,700	421.45	58,033,665.00	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	40,300	438.75	17,681,625.00	
	JSW STEEL LTD	73,870	689.00	50,896,430.00	
	PI INDUSTRIES LTD	7,770	3,178.55	24,697,333.50	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	16,120	2,833.90	45,682,468.00	
	SHREE CEMENT LTD	1,075	23,242.70	24,985,902.50	
	SRF LTD	15,800	2,682.40	42,381,920.00	
	TATA STEEL LTD	753,120	105.80	79,680,096.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	10,040	6,484.65	65,105,886.00	
	UPL LTD	51,435	719.90	37,028,056.50	
	VEDANTA LTD	75,460	280.10	21,136,346.00	
	ADANI ENTERPRISES LTD	28,870	3,834.55	110,703,458.50	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	131,100	110.20	14,447,220.00	
	BHARAT ELECTRONICS LTD(N)	262,200	110.20	28,894,440.00	
	HAVELLS INDIA LTD	25,550	1,319.40	33,710,670.00	
	LARSEN & TOUBRO LTD	68,790	1,932.70	132,950,433.00	
	SIEMENS LTD	5,990	2,947.90	17,657,921.00	
	INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,260	706.15	15,718,899.00	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	54,483	970.25	52,862,130.75	

CONTAINER CORP OF INDIA LTD	25,072	744.75	18,672,372.00	
INTERGLOBE AVIATION LTD	9,320	1,905.65	17,760,658.00	
BAJAJ AUTO LTD	7,410	3,768.60	27,925,326.00	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	7,940	1,901.95	15,101,483.00	
BHARAT FORGE LTD	22,430	769.45	17,258,763.50	
EICHER MOTORS LTD	14,230	3,711.55	52,815,356.50	
HERO MOTOCORP LTD	11,820	2,771.55	32,759,721.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	88,450	1,302.95	115,245,927.50	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	12,140	9,300.85	112,912,319.00	
MRF LTD	200	85,661.00	17,132,200.00	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	121,840	124.35	15,150,804.00	
TATA MOTORS LTD	166,808	434.25	72,436,374.00	
PAGE INDUSTRIES LTD	660	50,355.45	33,234,597.00	
TITAN CO LTD	36,030	2,684.00	96,704,520.00	
JUBILANT FOODWORKS LTD	37,900	624.30	23,660,970.00	
INFO EDGE INDIA LTD	7,230	4,065.95	29,396,818.50	
TRENT LTD	19,010	1,445.55	27,479,905.50	
ZOMATO LTD	173,500	62.85	10,904,475.00	
AVENUE SUPERMARTS LTD	16,340	4,349.30	71,067,562.00	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	10,580	3,650.60	38,623,348.00	
ITC LTD	298,355	336.00	100,247,280.00	
MARICO LTD	47,110	527.25	24,838,747.50	
NESTLE INDIA LIMITED	3,285	18,616.65	61,155,695.25	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	55,580	804.20	44,697,436.00	
UNITED SPIRITS LTD	26,760	870.65	23,298,594.00	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	12,900	1,593.95	20,561,955.00	
DABUR INDIA LTD	61,560	556.80	34,276,608.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	41,565	923.60	38,389,434.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	82,350	2,583.55	212,755,342.50	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	10,070	4,559.35	45,912,654.50	
AUROBINDO PHARMA LTD	27,210	533.45	14,515,174.50	
BIOCON LTD	38,770	298.55	11,574,783.50	
CIPLA LTD	49,210	1,092.30	53,752,083.00	
DIVI'S LABORATORIES LTD	13,460	3,631.55	48,880,663.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	11,710	4,216.00	49,369,360.00	

LUPIN LTD	20,890	671.25	14,022,412.50
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	96,364	911.95	87,879,149.80
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	10,420	1,513.50	15,770,670.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	14,800	666.20	9,859,760.00
AXIS BANK LTD	227,590	812.75	184,973,772.50
BANDHAN BANK LTD	59,940	293.30	17,580,402.00
ICICI BANK LTD	517,717	916.75	474,617,059.75
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	55,410	1,939.75	107,481,547.50
STATE BANK OF INDIA	179,630	574.05	103,116,601.50
YES BANK LTD	1,146,600	16.40	18,804,240.00
BAJAJ FINANCE LTD	27,480	7,635.40	209,820,792.00
BAJAJ FINSERV LTD	18,800	1,799.60	33,832,480.00
BAJAJ FINSERV LTD(N)	18,800	1,799.60	33,832,480.00
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	43,700	786.50	34,370,050.00
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	173,235	2,486.25	430,705,518.75
MUTHOOT FINANCE LTD	10,730	1,033.95	11,094,283.50
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	23,870	957.20	22,848,364.00
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	18,134	1,296.10	23,503,477.40
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	93,190	559.75	52,163,102.50
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	23,350	1,215.65	28,385,427.50
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	35,540	561.00	19,937,940.00
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	45,870	1,309.30	60,057,591.00
DLF LTD	58,800	391.95	23,046,660.00
GODREJ PROPERTIES LTD	12,400	1,311.35	16,260,740.00
HCL TECHNOLOGIES LTD	108,330	914.00	99,013,620.00
INFOSYS LTD	337,188	1,388.55	468,202,397.40
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	4,880	4,405.75	21,500,060.00
MINDTREE LTD	5,180	3,132.55	16,226,609.00
MPHASIS LTD	7,860	2,072.85	16,292,601.00
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	91,276	3,040.30	277,506,422.80
TATA ELXSI LTD	3,860	8,901.55	34,359,983.00
TECH MAHINDRA LTD	58,560	1,056.15	61,848,144.00
WIPRO LTD	134,209	404.90	54,341,224.10
BHARTI AIRTEL LTD	219,595	792.15	173,952,179.25
INDUS TOWERS LTD	64,590	199.90	12,911,541.00

	ADANI GREEN ENERGY LTD	32,380	2,399.95	77,710,381.00	
	ADANI POWER LTD	76,500	398.25	30,466,125.00	
	ADANI TOTAL GAS LTD	28,010	3,674.95	102,935,349.50	
	ADANI TRANSMISSION LTD	28,370	4,021.55	114,091,373.50	
	GAIL INDIA LTD	141,442	90.90	12,857,077.80	
	GAIL INDIA LTD(N)	82,721	90.90	7,519,338.90	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	30,240	423.60	12,809,664.00	
	NTPC LIMITED	393,722	171.90	67,680,811.80	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	316,963	232.70	73,757,290.10	
	TATA POWER CO LTD	150,180	235.25	35,329,845.00	
インドルピー小計		9,977,366		7,469,496,157.05	(13,519,788,044)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	50,690	19.07	966,658.30	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	248,600	3.65	907,887.20	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	473,800	2.37	1,122,906.00	
	INDUSTRIES QATAR	156,610	17.75	2,779,827.50	
	COMMERCIAL BANK PQSC	333,880	7.20	2,403,936.00	
	MASRAF AL RAYAN	556,500	4.20	2,337,300.00	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	75,300	11.20	843,360.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	168,330	25.28	4,255,382.40	
	QATAR NATIONAL BANK	465,170	20.06	9,331,310.20	
	BARWA REAL ESTATE CO	158,600	3.40	539,240.00	
	OOREDOO QPSC	77,600	8.99	697,624.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	44,020	18.15	798,963.00	
カタールリアル小計		2,809,100		26,984,394.60	(1,057,788,268)
エジプトポンド	EASTERN CO	132,525	9.95	1,318,623.75	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN	178,284	39.02	6,956,641.68	
エジプトポンド小計		310,809		8,275,265.43	(61,211,310)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	26,980	228.26	6,158,454.80	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	13,240	272.24	3,604,457.60	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,250	1,240.50	6,512,625.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	41,992	224.29	9,418,385.68	
	GOLD FIELDS LTD	90,000	132.48	11,923,200.00	

	HARMONY GOLD MINING CO LTD	62,200	36.36	2,261,592.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	87,240	190.43	16,613,113.20	
	KUMBA IRON ORE LTD	7,080	379.11	2,684,098.80	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	33,890	158.33	5,365,803.70	
	SASOL LTD	57,615	309.50	17,831,842.50	
	SIBANYE STILLWATER LTD	286,530	38.37	10,994,156.10	
	BIDVEST GROUP LTD	31,432	221.13	6,950,558.16	
	MULTICHOICE GROUP LTD	41,210	115.35	4,753,573.50	
	MR PRICE GROUP LTD	27,500	182.66	5,023,150.00	
	NASPERS LTD-N SHS	21,940	2,392.00	52,480,480.00	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	152,650	20.87	3,185,805.50	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	33,000	123.85	4,087,050.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	102,115	63.11	6,444,477.65	
	BID CORP LTD	33,389	299.21	9,990,322.69	
	CLICKS GROUP LTD	23,990	287.28	6,891,847.20	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	52,300	224.05	11,717,815.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	19,110	145.59	2,782,224.90	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,241	140.41	5,229,008.81	
	ABSA GROUP LTD	81,660	183.43	14,978,893.80	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	8,822	1,728.00	15,244,416.00	
	NEDBANK GROUP LTD	47,748	208.93	9,975,989.64	
	STANDARD BANK GROUP LTD	133,713	146.32	19,564,886.16	
	FIRSTRAND LTD	506,369	63.00	31,901,247.00	
	REINET INVESTMENTS SCA	11,960	289.11	3,457,755.60	
	REMGRO LTD	53,050	133.55	7,084,827.50	
	DISCOVERY LTD	45,065	109.45	4,932,364.25	
	OLD MUTUAL LTD	467,180	10.43	4,872,687.40	
	SANLAM LTD	176,311	54.40	9,591,318.40	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	41,918	92.30	3,869,031.40	
	MTN GROUP LTD	171,132	128.31	21,957,946.92	
	VODACOM GROUP LTD	63,035	126.26	7,958,799.10	
	南アフリカランド小計	3,095,857		368,294,205.96	(2,986,866,010)
アラブディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	322,900	4.33	1,398,157.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	287,800	9.13	2,627,614.00	

	ABU DHABI ISLAMIC BANK	161,550	9.84	1,589,652.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	294,733	6.15	1,812,607.95	
	EMIRATES NBD PJSC	184,670	12.95	2,391,476.50	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	443,001	18.82	8,337,278.82	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	402,050	4.65	1,869,532.50	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	402,750	6.50	2,617,875.00	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	349,451	25.54	8,924,978.54	
アラブディルハム小計		2,848,905		31,569,172.31	(1,233,407,562)
クウェート・ ディナール	AGILITY	150,552	0.77	116,527.24	
	BOUBAYAN BANK K.S.C	134,337	0.82	110,156.34	
	GULF BANK	185,500	0.33	61,957.00	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	508,089	0.89	456,263.92	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	722,026	1.03	745,852.85	
	MABANEE CO KPSC	49,854	0.90	44,918.45	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	232,400	0.58	135,954.00	
クウェート・ディナール小計		1,982,758		1,671,629.80	(776,288,162)
香港・オフショ ア人民元	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	214,717	4.22	906,105.74	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	49,400	31.35	1,548,690.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	166,233	5.16	857,762.28	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	73,700	22.95	1,691,415.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	14,900	35.42	527,758.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	117,200	4.47	523,884.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	34,200	29.58	1,011,636.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	123,000	5.37	660,510.00	
	BBMG CORPORATION-A	131,400	2.55	335,070.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	26,289	13.95	366,731.55	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	139,200	4.90	682,080.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH-A	38,100	29.01	1,105,281.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-A	16,100	83.90	1,350,790.00	
	GEM CO LTD-A	55,400	7.97	441,538.00	
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	16,600	47.03	780,698.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	50,954	19.00	968,126.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	438,792	1.95	855,644.40		

INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	66,500	4.12	273,980.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	20,600	16.11	331,866.00
LB GROUP CO LTD-A	14,800	16.55	244,940.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	42,100	13.71	577,191.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	32,300	26.31	849,813.00
RONGSHENG PETROCHEMICAL CO-A	77,800	14.48	1,126,544.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	27,244	17.46	475,680.24
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	15,340	29.99	460,046.60
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	145,000	3.35	485,750.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	12,100	60.56	732,776.00
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	30,700	10.62	326,034.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	8,800	114.30	1,005,840.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	14,600	14.45	210,970.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	25,800	89.55	2,310,390.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	5,200	83.23	432,796.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C-A	8,300	181.92	1,509,936.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	11,050	74.60	824,330.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	154,600	8.70	1,345,020.00
AECC AVIATION POWER CO-A	24,100	45.75	1,102,575.00
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	35,900	12.03	431,877.00
AVICOPTER PLC-A	9,400	43.98	413,412.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	12,200	25.75	314,150.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	40,900	25.61	1,047,449.00
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	193,700	2.37	459,069.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	48,800	8.71	425,048.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	185,000	5.51	1,019,350.00
CHINA STATE CONSTRUCTION-A	324,000	5.11	1,655,640.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	14,900	421.01	6,273,049.00
CRRC CORP LTD-A	170,200	4.82	820,364.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	21,700	22.06	478,702.00
EVE ENERGY CO LTD-A	17,383	85.18	1,480,683.94
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	60,060	6.59	395,795.40
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	3,500	235.01	822,535.00
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD-A	14,100	32.50	458,250.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	13,020	36.62	476,792.40

JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,879	49.38	586,585.02	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	30,800	23.53	724,724.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	157,500	3.12	491,400.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	54,234	24.84	1,347,172.56	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	122,702	7.23	887,135.46	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	69,100	14.96	1,033,736.00	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	87,700	2.60	228,020.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	73,500	4.23	310,905.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	23,976	58.12	1,393,485.12	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	13,100	114.15	1,495,365.00	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	12,200	25.15	306,830.00	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	1,600	504.20	806,720.00	
TBEA CO LTD-A	39,500	22.92	905,340.00	
WEICHAJ POWER CO LTD-A	57,500	10.61	610,075.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	43,900	12.15	533,385.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	20,100	27.82	559,182.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	49,000	5.79	283,710.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	49,900	4.97	248,003.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	5,400	45.20	244,080.00	
AIR CHINA LTD-A	37,700	10.44	393,588.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	253,100	4.49	1,136,419.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	113,700	5.00	568,500.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	71,400	6.53	466,242.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	103,710	12.22	1,267,336.20	
DAQIN RAILWAY CO LTD-A	45,100	6.74	303,974.00	
S F HOLDING CO LTD-A	32,200	49.03	1,578,766.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	5,238	60.36	316,165.68	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	24,570	17.41	427,763.70	
BYD CO LTD -A	12,800	274.21	3,509,888.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	2,300	160.78	369,794.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	65,482	13.51	884,661.82	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS-A	18,271	17.60	321,569.60	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	5,200	141.55	736,060.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC-A	11,800	14.79	174,522.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	79,600	14.89	1,185,244.00	

SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	12,500	19.83	247,875.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	18,100	34.20	619,020.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	53,100	25.87	1,373,697.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	9,400	24.17	227,198.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	3,780	126.33	477,527.40	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	106,800	3.85	411,180.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	6,493	45.90	298,028.70	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	7,000	59.25	414,750.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	76,498	5.12	391,669.76	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	17,320	12.85	222,562.00	
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	17,300	18.28	316,244.00	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	22,700	7.80	177,060.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	143,200	5.43	777,576.00	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	14,300	7.85	112,255.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	17,400	25.66	446,484.00	
PERFECT WORLD CO LTD-A	15,300	13.25	202,725.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	58,200	3.97	231,054.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	14,200	194.23	2,758,066.00	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	32,200	6.97	224,434.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	67,900	4.33	294,007.00	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	5,122	48.39	247,853.58	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	3,200	259.09	829,088.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	8,900	46.85	416,965.00	
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	52,000	8.39	436,280.00	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	8,791	20.83	183,116.53	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING-A	25,727	80.78	2,078,227.06	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	14,600	59.48	868,408.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	15,177	24.75	375,630.75	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	54,300	32.66	1,773,438.00	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	7,500	43.79	328,425.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	12,683	149.13	1,891,415.79	
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	34,800	5.11	177,828.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	5,647	32.12	181,381.64	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	7,760	1,878.00	14,573,280.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	10,500	225.70	2,369,850.00	

MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	38,652	58.88	2,275,829.76
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	25,075	14.78	370,608.50
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	8,460	296.09	2,504,921.40
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	6,300	66.05	416,115.00
TONGWEI CO LTD-A	38,200	50.30	1,921,460.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	6,600	102.40	675,840.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO-A	43,080	21.31	918,034.80
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	25,500	165.79	4,227,645.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	7,900	42.90	338,910.00
BY-HEALTH CO LTD-A	25,500	17.14	437,070.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	50,903	27.03	1,375,908.09
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	3,700	62.72	232,064.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	5,880	45.40	266,952.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	10,000	26.96	269,600.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	19,667	11.53	226,760.51
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	16,073	19.60	315,030.80
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	23,271	4.37	101,694.27
OVCTEK CHINA INC-A	6,720	39.94	268,396.80
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	17,900	16.79	300,541.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	7,755	284.50	2,206,297.50
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	3,400	124.80	424,320.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	33,670	6.53	219,865.10
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	1,960	143.65	281,554.00
BEIJING TANTAN BIOLOGICAL-A	11,544	20.62	238,037.28
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	4,060	114.55	465,073.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	3,300	54.85	181,005.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	3,300	161.72	533,676.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	9,700	36.37	352,789.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	12,800	84.99	1,087,872.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	13,100	26.29	344,399.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	3,400	91.77	312,018.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	20,930	18.20	380,926.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	1,300	491.67	639,171.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	47,673	34.13	1,627,079.49
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	21,091	15.83	333,870.53

PHARMARON BEIJING CO LTD-A	6,900	54.10	373,290.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	24,000	17.35	416,400.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	20,700	32.27	667,989.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	65,500	5.40	353,700.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	9,280	30.34	281,555.20
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	8,200	39.71	325,622.00
WUXI APPTEC CO LTD-A	19,488	74.05	1,443,086.40
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	12,740	51.93	661,588.20
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	4,900	289.35	1,417,815.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	11,620	18.95	220,199.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	24,480	21.26	520,444.80
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	672,600	2.84	1,910,184.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	86,023	4.13	355,274.99
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	38,000	16.07	610,660.00
BANK OF CHINA LTD-A	180,800	3.07	555,056.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	313,500	4.65	1,457,775.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	55,760	14.07	784,543.20
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	140,010	7.37	1,031,873.70
BANK OF NANJING CO LTD -A	79,112	10.55	834,631.60
BANK OF NINGBO CO LTD -A	57,607	31.14	1,793,881.98
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	71,427	5.90	421,419.30
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	47,700	5.55	264,735.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	387,100	2.84	1,099,364.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	128,810	34.54	4,449,097.40
CHINA MINSHENG BANKING-A	256,600	3.50	898,100.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	52,243	5.11	266,961.73
IND & COMM BK OF CHINA-A	384,100	4.37	1,678,517.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	152,821	17.08	2,610,182.68
PING AN BANK CO LTD-A	147,644	12.34	1,821,926.96
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	151,600	4.51	683,716.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	269,921	7.11	1,919,138.31
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	141,400	3.12	441,168.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	73,580	7.06	519,474.80
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	87,100	5.32	463,372.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	69,230	12.66	876,451.80

CITIC SECURITIES CO-A	94,970	18.42	1,749,347.40
CSC FINANCIAL CO LTD-A	29,800	24.85	740,530.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	43,500	7.67	333,645.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	115,922	19.29	2,236,135.38
EVERBRIGHT SECURITIE CO-A	30,800	14.17	436,436.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	55,200	5.76	317,952.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	64,900	6.53	423,797.00
GF SECURITIES CO LTD-A	46,700	15.42	720,114.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	32,317	8.83	285,359.11
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	38,588	14.18	547,177.84
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	68,900	6.71	462,319.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	60,400	9.09	549,036.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	49,200	12.33	606,636.00
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	41,400	7.64	316,296.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	68,640	5.74	393,993.60
NANJING SECURITIES CO LTD-A	44,100	8.14	358,974.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	60,160	8.05	484,288.00
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	70,300	3.36	236,208.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	220,000	4.01	882,200.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	23,800	8.03	191,114.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	79,937	6.36	508,399.32
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	88,900	3.68	327,152.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	55,200	6.08	335,616.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,800	10.14	444,132.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	22,867	29.84	682,351.28
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	53,312	20.10	1,071,571.20
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	15,000	27.10	406,500.00
PICC HOLDING CO-A	77,900	4.93	384,047.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	76,657	43.24	3,314,648.68
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	81,277	16.16	1,313,436.32
CHINA VANKE CO LTD -A	75,200	17.56	1,320,512.00
GEMDALE CORP-A	56,100	11.26	631,686.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	96,353	17.64	1,699,666.92
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	15,000	19.74	296,100.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	24,400	11.01	268,644.00

360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	64,500	7.13	459,885.00	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	2,700	213.00	575,100.00	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	27,440	13.22	362,756.80	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	31,000	8.64	267,840.00	
DHC SOFTWARE CO LTD -A	48,200	5.54	267,028.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	17,660	32.77	578,718.20	
IFLYTEK CO LTD-A	17,400	34.98	608,652.00	
NAVINFO CO LTD-A	30,300	12.63	382,689.00	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	1,900	111.50	211,850.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	19,097	40.06	765,025.82	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	21,371	18.19	388,738.49	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	320,712	3.38	1,084,006.56	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	23,100	9.07	209,517.00	
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	17,600	13.44	236,544.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	67,100	8.74	586,454.00	
GOERTEK INC -A	35,700	30.98	1,105,986.00	
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	47,875	8.63	413,161.25	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	36,300	8.31	301,653.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	14,536	21.39	310,925.04	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	41,100	9.86	405,246.00	
LINGYI ITECH GUANGDONG CO-A	45,000	4.75	213,750.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	51,560	33.50	1,727,260.00	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	2,880	96.30	277,344.00	
NINESTAR CORP-A	16,800	45.13	758,184.00	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	4,150	61.33	254,519.50	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	25,300	26.66	674,498.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	32,300	8.88	286,824.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	12,300	52.96	651,408.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	19,502	12.23	238,509.46	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	29,848	10.70	319,373.60	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	5,450	65.85	358,882.50	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	28,000	13.66	382,480.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	7,200	26.95	194,040.00	
ZTE CORP-A	36,100	23.11	834,271.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	217,000	3.43	744,310.00	

	CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	124,900	6.06	756,894.00	
	CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	180,000	5.69	1,024,200.00	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	155,209	23.42	3,634,994.78	
	HUADIAN POWER INTL CORP-A	71,900	6.24	448,656.00	
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	63,300	11.07	700,731.00	
	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	43,792	12.47	546,086.24	
	ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	4,104	123.10	505,202.40	
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	74,600	3.41	254,386.00	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	5,376	105.44	566,845.44	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	10,540	56.59	596,458.60	
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	18,320	64.30	1,177,976.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	54,235	50.04	2,713,919.40	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	4,400	310.35	1,365,540.00	
	TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	24,400	44.82	1,093,608.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	27,500	8.74	240,350.00	
	TRINA SOLAR CO LTD-A	16,250	66.38	1,078,675.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,579	155.97	1,026,126.63	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	10,160	85.84	872,134.40	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	13,500	73.78	996,030.00	
	香港・オフショア人民元小計	15,674,448		233,616,106.96 (4,774,996,418)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	38,122	14.36	547,431.92	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	242,138	36.20	8,765,395.60	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	12,380	46.30	573,194.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	28,540	14.30	408,122.00	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	21,850	156.80	3,426,080.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	38,390	45.75	1,756,342.50	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	87,530	63.30	5,540,649.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	90,540	90.00	8,148,600.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	38,016	22.44	853,079.04	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	66,710	12.86	857,890.60	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	23,330	47.60	1,110,508.00	
	SAUDI RESEARCH AND MARKETING	3,310	196.80	651,408.00	
	JARIR MARKETING CO	5,460	170.40	930,384.00	
	ALMARAI CO	22,890	53.00	1,213,170.00	

SAVOLA	22,370	30.50	682,285.00	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	9,040	198.60	1,795,344.00	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	5,030	205.40	1,033,162.00	
AL RAJHI BANK	198,222	85.00	16,848,870.00	
ALINMA BANK	100,870	36.50	3,681,755.00	
ARAB NATIONAL BANK	61,100	31.10	1,900,210.00	
BANK AL-JAZIRA	42,440	22.04	935,377.60	
BANK ALBILAD	52,106	49.25	2,566,220.50	
BANQUE SAUDI FRANSI	59,940	42.30	2,535,462.00	
RIYAD BANK	138,190	32.50	4,491,175.00	
SAUDI BRITISH BANK	92,990	38.60	3,589,414.00	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	52,710	18.74	987,785.40	
THE SAUDI NATIONAL BANK	221,725	63.50	14,079,537.50	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	3,200	203.40	650,880.00	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,060	171.20	1,037,472.00	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	49,000	15.10	739,900.00	
EMAAR ECONOMIC CITY	26,750	9.77	261,347.50	
ELM CO	2,310	313.80	724,878.00	
ETIHAD ETISALAT CO	38,960	36.40	1,418,144.00	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	30,850	11.30	348,605.00	
SAUDI TELECOM CO	147,575	38.50	5,681,637.50	
ACWA POWER CO	8,880	153.80	1,365,744.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	78,920	25.20	1,988,784.00	
サウジアラビアリアル小計	2,168,444		104,126,244.66 (3,985,952,645)	
合計	600,427,662		89,562,031,570 (89,562,031,570)	

(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
メキシコ ペソ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	317,500	6,950,075.00	
		OPERADORA DE SITES MEX- A-1	117,100	2,194,454.00	

メキシコペソ小計			434,600	9,144,529.00 (65,769,281)	
インドル ピー	社債券	BRITANNIA INDUSTRIES LTD-5.5%- 24/06/03	368,880.00		
インドルピー小計			368,880.00	()	
南アフリ カランド	投資証券	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	329,830	4,225,122.30	
南アフリカランド小計			329,830	4,225,122.30 (34,265,741)	
合計				100,035,022 (100,035,022)	

(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)投資証券における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	組入債券 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 72銘柄	100.0%			3.7%
メキシコペソ	株式 20銘柄	96.6%			2.1%
	投資証券 2銘柄			3.4%	0.1%
ブラジルリアル	株式 48銘柄	100.0%			5.5%
チリペソ	株式 11銘柄	100.0%			0.5%
コロンビアペソ	株式 4銘柄	100.0%			0.1%
ユーロ	株式 8銘柄	100.0%			0.3%
トルコリラ	株式 12銘柄	100.0%			0.4%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%			0.2%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.2%
ポーランドズロチ	株式 15銘柄	100.0%			0.5%
香港ドル	株式 195銘柄	100.0%			23.1%
マレーシアリングギット	株式 34銘柄	100.0%			1.5%
タイバーツ	株式 43銘柄	100.0%			2.0%
フィリピンペソ	株式 21銘柄	100.0%			0.7%
インドネシアルピア	株式 25銘柄	100.0%			2.1%

韓国ウォン	株式	111銘柄	100.0%			11.1%
台湾ドル	株式	88銘柄	100.0%			14.2%
インドルピー	株式	111銘柄	100.0%			15.1%
	社債券	1銘柄				
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%			1.2%
エジプトポンド	株式	2銘柄	100.0%			0.1%
南アフリカランド	株式	36銘柄	98.9%			3.3%
	投資証券	1銘柄			1.1%	0.0%
アラブディルハム	株式	9銘柄	100.0%			1.4%
クウェート・ディナール	株式	7銘柄	100.0%			0.9%
香港・オフショア人民元	株式	281銘柄	100.0%			5.3%
サウジアラビアリアル	株式	37銘柄	100.0%			4.4%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

海外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 9月21日現在	2022年 9月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	629,144,562	97,066,906
コール・ローン	23,874,302	2,217,199,357
投資証券	74,033,766,381	53,049,241,120
派生商品評価勘定	30,830	5,496
未収入金	433,641,862	9,646,871
未収配当金	158,122,636	166,641,059
流動資産合計	75,278,580,573	55,539,800,809
資産合計	75,278,580,573	55,539,800,809
負債の部		
流動負債		

	2021年 9月21日現在	2022年 9月21日現在
派生商品評価勘定	62,880	-
未払金	737,664,795	93,084,521
未払解約金	5,053,276	2,192,654,322
未払利息	5	3,015
流動負債合計	742,780,956	2,285,741,858
負債合計	742,780,956	2,285,741,858
純資産の部		
元本等		
元本	28,868,868,987	18,428,589,771
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	45,666,930,630	34,825,469,180
元本等合計	74,535,799,617	53,254,058,951
純資産合計	74,535,799,617	53,254,058,951
負債純資産合計	75,278,580,573	55,539,800,809

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 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 9月21日現在	2022年 9月21日現在
1. 期首	2020年 9月24日	2021年 9月22日
期首元本額	62,918,091,530円	28,868,868,987円
期首からの追加設定元本額	66,400,300円	3,307,478,503円

	2021年 9月21日現在	2022年 9月21日現在
期首からの一部解約元本額	34,115,622,843円	13,747,757,719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	2,231,519,731円	2,077,326,280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）	13,228,793円	10,631,291円
グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	26,300,921,035円	16,106,034,269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）	323,199,428円	234,597,931円
計	28,868,868,987円	18,428,589,771円
2. 受益権の総数	28,868,868,987口	18,428,589,771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 9月24日 至 2021年 9月21日	自 2021年 9月22日 至 2022年 9月21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 9月21日現在	2022年 9月21日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

	2021年 9月21日現在	2022年 9月21日現在
	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。	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 9月21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	330,629,399
合計	330,629,399

(2022年 9月21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	522,055,775
合計	522,055,775

(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 9月21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	111,947,940	-	111,978,770	30,830
	米ドル	32,862,600	-	32,869,800	7,200
	加ドル	34,216,560	-	34,235,480	18,920
	英ポンド	44,868,780	-	44,873,490	4,710
	売建	122,273,640	-	122,336,520	62,880
	ユーロ	12,843,960	-	12,848,100	4,140
	豪ドル	63,552,880	-	63,592,000	39,120
	ニュージーランドドル	5,371,800	-	5,372,920	1,120
	シンガポールドル	40,505,000	-	40,523,500	18,500
合計		234,221,580	-	234,315,290	32,050

(2022年 9月21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	3,148,253	-	3,153,749	5,496
	韓国ウォン	3,148,253	-	3,153,749	5,496
合計		3,148,253	-	3,153,749	5,496

(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 9月21日現在		2022年 9月21日現在	
1口当たり純資産額	2,5819円	1口当たり純資産額	2,8898円
(1万口当たり純資産額)	(25,819円)	(1万口当たり純資産額)	(28,898円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	27,275	412,670.75	
		AGREE REALTY CORPORATION	22,964	1,623,554.80	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	20,923	365,943.27	
		ALEXANDER'S INC	626	141,300.72	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	42,713	6,182,279.62	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,963	53,126.59	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	14,981	406,284.72	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	86,989	2,980,243.14	
		AMERICOLD REALTY TRUST INC	77,534	2,095,744.02	
		APARTMENT INCOME REIT CO	44,434	1,770,694.90	
		APARTMENT INVT&MGMT CO -A	43,707	368,012.94	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	61,227	963,712.98	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	19,170	234,832.50	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	9,695	82,698.35	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	40,255	7,764,384.40	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	8,117	218,509.64	
		BOSTON PROPERTIES INC	41,108	3,269,319.24	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	16,299	85,569.75	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	49,813	399,002.13	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	86,084	1,771,608.72	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	49,868	930,038.20	
		BRT APARTMENTS CORP	3,528	75,393.36	

CAMDEN PROPERTY TRUST	30,660	3,805,212.60	
CARETRUST REIT INC	27,904	561,707.52	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,087	183,340.69	
CENTERSPACE	4,435	321,315.75	
CHATHAM LODGING TRUST	13,970	172,808.90	
CITY OFFICE REIT INC	11,825	131,375.75	
CLIPPER REALTY INC	3,403	27,019.82	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	6,648	227,228.64	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	32,522	834,189.30	
COUSINS PROPERTIES INC	43,583	1,146,232.90	
CTO REALTY GROWTH INC	4,497	89,580.24	
CUBESMART	64,536	2,712,448.08	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	60,568	536,026.80	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	99,300	78,943.50	
DIGITAL REALTY TRUST INC	82,746	9,081,373.50	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	70,382	88,681.32	
DOUGLAS EMMETT INC	50,825	1,049,028.00	
DUKE REALTY CORPORATION	110,794	5,825,548.52	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	68,595.90	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	26,364	463,479.12	
EASTGROUP PROPERTIES INC	12,528	1,936,077.12	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	38,546	281,771.26	
EPR PROPERTIES	21,626	904,399.32	
EQUINIX INC	26,212	16,159,698.00	
EQUITY COMMONWEALTH	32,238	869,458.86	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	50,357	3,414,708.17	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	97,449	6,807,787.14	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	40,255	896,881.40	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	18,754	4,709,129.40	
EXTRA SPACE STORAGE INC	38,528	6,899,594.24	
FARMLAND PARTNERS INC	13,797	194,951.61	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	20,955	2,017,547.40	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	37,971	1,875,387.69	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	23,500	621,810.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	26,426	81,127.82	

GAMING AND LEISURE PROPERTIE	73,485	3,514,052.70	
GETTY REALTY CORPORATION	12,174	357,915.60	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	11,187	199,128.60	
GLADSTONE LAND CORP	8,928	179,988.48	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	17,274	175,331.10	
GLOBAL NET LEASE INC	29,938	387,996.48	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	109,713	2,531,078.91	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	155,482	3,834,186.12	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9,249	91,472.61	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	30,372	900,833.52	
HOST HOTELS & RESORTS INC	205,728	3,641,385.60	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	37,417	459,106.59	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	63,666	1,170,817.74	
INDUS REALTY TRUST INC	1,415	84,517.95	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	18,753	136,896.90	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	8,012	770,353.80	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	19,396	483,348.32	
INVITATION HOMES INC	166,838	5,956,116.60	
IRON MOUNTAIN INC	83,676	4,238,189.40	
ISTAR INC	24,455	298,595.55	
JBG SMITH PROPERTIES	28,837	613,939.73	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	229,200	150,126.00	
KILROY REALTY CORPORATION	30,322	1,425,134.00	
KIMCO REALTY CORP	177,802	3,600,490.50	
KITE REALTY GROUP TRUST	62,930	1,188,747.70	
LIFE STORAGE INC	24,248	2,772,516.32	
LTC PROPERTIES INC	11,748	483,665.16	
LXP INDUSTRIAL TRUST	80,568	785,538.00	
MACERICH CO/THE	61,884	543,960.36	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	520,647	252,513.79	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	172,591	2,267,845.74	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	33,218	5,313,883.46	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	50,998	2,198,013.80	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	24,468	1,101,304.68	
NATL HEALTH INVESTORS INC	12,911	806,162.84	

NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	38,331	268,700.31	
NETSTREIT CORP	14,291	272,386.46	
NEXPOINT RESIDENTIAL	6,556	327,013.28	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	14,177	245,120.33	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	67,456	2,142,402.56	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,571	110,161.10	
ORION OFFICE REIT INC	16,108	156,086.52	
PARAMOUNT GROUP INC	48,557	338,442.29	
PARK HOTELS & RESORTS INC	64,706	888,413.38	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	37,755	658,069.65	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	33,655	1,038,256.75	
PHYSICIANS REALTY TRUST	65,362	1,044,484.76	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	35,770	428,882.30	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	10,346	201,022.78	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	4,846	72,883.84	
PRIME US REIT	184,200	112,362.00	
PROLOGIS INC	213,057	23,634,413.01	
PUBLIC STORAGE	45,468	13,925,939.04	
REALTY INCOME CORP	177,738	11,213,490.42	
REGENCY CENTERS CORP	44,337	2,521,445.19	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	35,636	554,139.80	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	49,142	2,811,905.24	
RLJ LODGING TRUST	46,833	567,615.96	
RPT REALTY	24,154	215,453.68	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	15,848	1,370,852.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	66,615	934,608.45	
SAFEHOLD INC	4,934	174,022.18	
SAUL CENTERS INC	3,695	149,869.20	
SERVICE PROPERTIES TRUST	47,479	318,109.30	
SIMON PROPERTY GROUP INC	94,218	9,263,513.76	
SITE CENTERS CORP	53,537	664,929.54	
SL GREEN REALTY CORP	18,598	852,346.34	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	39,158	1,649,726.54	
STAG INDUSTRIAL INC	51,499	1,577,929.36	
STORE CAPITAL CORP	76,429	2,427,385.04	

		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	30,969	239,700.06	
		SUN COMMUNITIES INC	35,479	5,225,701.91	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	60,974	677,421.14	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	30,040	455,406.40	
		TERRENO REALTY CORP	19,079	1,101,239.88	
		UDR INC	87,938	3,719,777.40	
		UMH PROPERTIES INC	14,494	253,500.06	
		UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	3,743	172,365.15	
		URBAN EDGE PROPERTIES	33,856	508,517.12	
		URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	8,575	139,000.75	
		VENTAS INC	115,120	5,342,719.20	
		VERIS RESIDENTIAL INC	22,888	302,350.48	
		VICI PROPERTIES INC	277,002	9,135,525.96	
		VORNADO REALTY TRUST	46,610	1,217,453.20	
		WASHINGTON REIT	25,285	498,114.50	
		WELLTOWER INC	133,406	9,279,721.36	
		WHITESTONE REIT	13,437	129,935.79	
		WP CAREY INC	59,810	4,920,568.70	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	32,854	537,491.44	
米ドル小計			7,938,315	287,173,438.53 (41,275,438,319)	
加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	18,216	535,003.92	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,827	174,327.72	
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	5,633	76,552.47	
		BOARDWALK EQUITIES INC	6,432	298,959.36	
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	5,270	119,734.40	
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	12,112	42,392.00	
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	24,438	1,026,396.00	
		CHOICE PROPERTIES REIT	46,827	633,569.31	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,110	234,053.90	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	15,213	243,255.87	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	35,862	407,392.32	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	6,850	119,190.00	
		EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	14,405	46,384.10	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	30,658	459,870.00	

		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	9,217	668,601.18	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	37,539	445,212.54	
		INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	6,035	28,424.85	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	19,725	231,177.00	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	16,170	258,881.70	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,668	80,202.20	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	5,526	86,039.82	
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	7,796	72,035.04	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	34,061	399,194.92	
		PRIMARIS REIT	13,791	184,385.67	
		PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	7,394	46,508.26	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	42,882	839,200.74	
		SLATE GROCERY REIT	8,330	117,786.20	
		SLATE OFFICE REIT	12,591	56,029.95	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	20,560	558,204.00	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	26,445	467,283.15	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	12,783	76,186.68	
加ドル小計			540,366	9,032,435.27	(971,257,764)
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	11,462	994,901.60	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	2,768	18,836.24	
		ALTAREA	1,335	174,084.00	
		BEFIMMO S.C.A.	1,445	68,276.25	
		CARE PROPERTY INVEST	8,233	165,483.30	
		CARMILA	16,536	228,196.80	
		COFINIMMO	8,675	811,112.50	
		COVIVIO	13,321	684,699.40	
		CROMWELL REIT EUR	105,560	215,342.40	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	12,108	245,550.24	
		GECINA SA	15,682	1,349,436.10	
		HAMBORNER REIT AG	21,313	158,355.59	
		ICADE	9,254	390,518.80	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	15,466	48,408.58	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	86,278	467,626.76	
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	6,855	155,608.50	

		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	134,266	157,896.81	
		KLEPIERRE	56,067	1,049,013.57	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	18,057	78,909.09	
		MERCIALYS	21,737	171,939.67	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	96,488	825,454.84	
		MONTEA	3,515	278,739.50	
		NSI NV	5,121	139,803.30	
		RETAIL ESTATES	3,346	194,737.20	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	30,730	1,486,410.10	
		VASTNED RETAIL	5,393	108,399.30	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	40,661	1,105,165.98	
		WERELDHAVE NV	11,491	148,693.54	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	5,922	213,488.10	
	ユーロ小計		769,085	12,135,088.06 (1,737,865,961)	
英債券	投資証券	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	120,064	78,281.72	
		AEW UK REIT PLC	45,281	45,824.37	
		ASSURA PLC	858,075	523,854.78	
		BALANCED COMM PROPERTY TRUST	231,973	212,719.24	
		BIG YELLOW GROUP PLC	50,157	573,796.08	
		BRITISH LAND COMPANY PLC	269,963	1,060,144.70	
		CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	245,626	285,417.41	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	182,737	138,697.38	
		CUSTODIAN REIT PLC	129,693	128,785.14	
		DERWENT LONDON PLC	32,343	749,063.88	
		EDISTON PROPERTY INVESTMENT	63,418	47,690.33	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	172,930	167,223.31	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	73,484	367,787.42	
		HAMMERSON PLC	1,019,317	215,483.61	
		HOME REIT PLC	230,882	240,579.04	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	119,270	142,408.38	
		INTU PROPERTIES PLC	758,746		
		LAND SECURITIES GROUP PLC	216,344	1,277,727.66	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	281,881	552,204.87	
		LXI REIT PLC	493,207	682,598.48	

		NEWRIVER REIT PLC	92,155	70,222.11	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	156,792	133,743.57	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	384,912	495,766.65	
		PRS REIT PLC/THE	162,272	159,188.83	
		REGIONAL REIT LTD	124,500	86,278.50	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	60,394	555,322.83	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	161,348	74,381.42	
		SEGRO PLC	347,733	2,945,993.97	
		SHAFTESBURY PLC	83,688	334,752.00	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	358,524	408,717.36	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	107,950	90,246.20	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	536,234	841,351.14	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	255,547	166,105.55	
		UNITE GROUP PLC	114,763	1,095,412.83	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	134,730	222,304.50	
		WAREHOUSE REIT PLC	120,690	171,862.56	
		WORKSPACE GROUP PLC	39,488	193,175.29	
英債券小計			8,837,111	15,535,113.11	(2,540,612,398)
豪ドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	121,664	322,409.60	
		ARENA REIT	98,751	384,141.39	
		BWP TRUST	143,375	559,162.50	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	200,924	358,649.34	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	158,203	457,206.67	
		CENTURIA OFFICE REIT	129,702	208,171.71	
		CHARTER HALL GROUP	136,161	1,684,311.57	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	190,180	817,774.00	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	152,582	601,173.08	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	96,971	346,186.47	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	422,140	316,605.00	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	61,888	165,240.96	
		DEXUS/AU	311,947	2,582,921.16	
		GDI PROPERTY GROUP	157,640	139,511.40	
		GOODMAN GROUP	489,513	8,732,911.92	
		GPT GROUP	554,848	2,285,973.76	

		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	86,134	293,716.94	
		HEALTHCO REIT	75,774	119,722.92	
		HOME CONSORTIUM LTD	55,143	274,060.71	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	457,117	566,825.08	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	58,540	186,157.20	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	105,832	433,911.20	
		MIRVAC GROUP	1,140,484	2,383,611.56	
		NATIONAL STORAGE REIT	311,736	745,049.04	
		RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	109,389	85,870.36	
		RURAL FUNDS GROUP	114,473	294,195.61	
		SCENTRE GROUP	1,499,316	4,168,098.48	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	326,298	812,482.02	
		STOCKLAND	690,078	2,373,868.32	
		VICINITY CENTRES	1,118,827	2,069,829.95	
		WAYPOINT REIT	210,883	533,533.99	
豪ドル小計			9,786,513	35,303,283.91	(3,394,763,780)
ニュー ジーラン ドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	413,516	901,464.88	
		STRIDE PROPERTY GROUP	160,000	283,200.00	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	206,109	556,494.30	
ニュージーランドドル小計			779,625	1,741,159.18	(147,650,298)
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	562,000	1,798,400.00	
		FORTUNE REIT	418,600	2,624,622.00	
		LINK REIT	608,000	38,273,600.00	
		PROSPERITY REIT	360,000	806,400.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	288,000	1,062,720.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	664,110	1,394,631.00	
香港ドル小計			2,900,710	45,960,373.00	(841,534,429)
シンガ ポールド ル	投資証券	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	158,025	214,914.00	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	968,632	2,731,542.24	
		ASCOTT TRUST	573,892	619,803.36	
		CAPITALAND CHINA TRUST	339,685	366,859.80	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,452,092	3,005,830.44	

		CDL HOSPITALITY TRUSTS	244,100	317,330.00	
		DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	153,000	102,510.00	
		EC WORLD REIT	82,900	44,766.00	
		ESR-LOGOS REIT	1,621,418	648,567.20	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	318,000	197,160.00	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	365,940	100,633.50	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	311,405	710,003.40	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	829,660	1,128,337.60	
		KEPPEL DC REIT	382,877	738,952.61	
		KEPPEL REIT	577,400	623,592.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	539,552	434,339.36	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	573,108	1,467,156.48	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	926,387	1,584,121.77	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	664,831	1,256,530.59	
		MOORE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT	744,035	279,013.12	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	112,600	520,212.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	169,400	127,897.00	
		SPH REIT	316,300	289,414.50	
		STARHILL GLOBAL REIT	406,900	238,036.50	
		SUNTEC REIT	652,600	1,050,686.00	
シンガポールドル小計			13,484,739	18,798,209.47	(1,915,725,527)
韓国ウォン	投資証券	D&D PLATFORM REIT CO LTD	15,480	68,808,600.00	
		E KOCREF CR-REIT CO LTD	8,770	50,778,300.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	47,957	269,518,340.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,591	56,216,350.00	
		JR REIT XXVII	45,090	211,472,100.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	13,627	69,633,970.00	
		LOTTE REIT CO LTD	39,257	196,677,570.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL ESTATE	8,226	35,947,620.00	
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,699	56,320,065.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,720	157,760,000.00	
		SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	9,014	41,915,100.00	
		SK REITS CO LTD	22,780	124,151,000.00	
			254,211	1,339,199,015.00	

韓国ウォン小計				(138,339,258)	
イスラエル シュケ ル	投資証券	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	200,519	403,243.70	
		REIT 1 LTD	53,296	1,056,859.68	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	63,417	605,632.35	
イスラエルシュケル小計			317,232	2,065,735.73	
				(86,053,386)	
合計				53,049,241,120	
				(53,049,241,120)	

(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 146銘柄	100.0%	77.7%
加ドル	投資証券 31銘柄	100.0%	1.8%
ユーロ	投資証券 29銘柄	100.0%	3.3%
英ポンド	投資証券 37銘柄	100.0%	4.8%
豪ドル	投資証券 31銘柄	100.0%	6.4%
ニュージーランドドル	投資証券 3銘柄	100.0%	0.3%
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 25銘柄	100.0%	3.6%
韓国ウォン	投資証券 12銘柄	100.0%	0.3%
イスラエルシュケル	投資証券 3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。

日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2021年 9月21日現在	2022年 9月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	375,812,069	744,794,630
投資証券	77,690,550,600	59,653,937,700
未収配当金	681,143,650	579,364,210
流動資産合計	78,747,506,319	60,978,096,540
資産合計	78,747,506,319	60,978,096,540
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,238,027	478,707,044
未払利息	81	1,013
流動負債合計	2,238,108	478,708,057
負債合計	2,238,108	478,708,057
純資産の部		
元本等		
元本	29,585,033,053	22,912,181,985
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	49,160,235,158	37,587,206,498
元本等合計	78,745,268,211	60,499,388,483
純資産合計	78,745,268,211	60,499,388,483
負債純資産合計	78,747,506,319	60,978,096,540

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2021年 9月21日現在	2022年 9月21日現在
1.	期首	2020年 9月24日	2021年 9月22日
	期首元本額	58,321,343,473円	29,585,033,053円
	期首からの追加設定元本額	121,267,270円	2,732,116,718円
	期首からの一部解約元本額	28,857,577,690円	9,404,967,786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	2,174,755,227円	2,379,159,052円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	1,433,077,125円	1,389,497,593円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	148,748,786円	146,780,410円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	25,799,319,355円	18,690,339,580円
	財産3分法（適格機関投資家専用）	29,132,560円	306,405,350円
	計	29,585,033,053円	22,912,181,985円
2.	受益権の総数	29,585,033,053口	22,912,181,985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 9月24日 至 2021年 9月21日	自 2021年 9月22日 至 2022年 9月21日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。当該有価証券の性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2021年 9月21日現在	2022年 9月21日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

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

（有価証券に関する注記）

（2021年 9月21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	1,630,054,665
合計	1,630,054,665

（2022年 9月21日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	3,643,447,265
合計	3,643,447,265

(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 9月21日現在		2022年 9月21日現在	
1口当たり純資産額	2.6617円	1口当たり純資産額	2.6405円
(1万口当たり純資産額)	(26,617円)	(1万口当たり純資産額)	(26,405円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	1,084	126,611,200	
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,709	168,849,200	
	S O S i L A物流リート投資法人 投資証券	2,493	386,165,700	
	東海道リート投資法人 投資証券	647	77,445,900	
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,842	1,232,298,000	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	6,272	1,009,164,800	
	産業ファンド投資法人 投資証券	7,971	1,383,765,600	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,333	1,927,879,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	3,825	861,007,500	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,816	1,241,856,000	
	G L P投資法人 投資証券	16,426	2,715,217,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,481	838,578,000	
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	8,740	2,866,720,000	
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	933	636,306,000	
	O n eリート投資法人 投資証券	930	251,472,000	
	イオンリート投資法人 投資証券	5,904	940,507,200	
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	4,990	855,286,000	
	日本リート投資法人 投資証券	1,732	660,758,000	
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	16,209	1,363,176,900	
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	1,183	165,146,800	
	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	2,242	637,624,800	
	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	1,315	232,229,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,386	174,220,200	
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	17,248	2,883,865,600	
	いちごホテルリート投資法人 投資証券	884	90,256,400	
	ラサールロジポート投資法人 投資証券	6,530	1,125,119,000	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	6,660	391,608,000		

マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	666	88,178,400	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,107	1,076,677,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	861	57,773,100	
投資法人みらい 投資証券	6,480	332,424,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	1,251	168,009,300	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,646	773,620,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,066	439,438,200	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	865	108,557,500	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	2,333	247,764,600	
アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	2,080	322,400,000	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	6,222	4,131,408,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	5,334	3,419,094,000	
日本都市ファンド投資法人 投資証券	26,912	2,949,555,200	
オリックス不動産投資法人 投資証券	10,628	2,072,460,000	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	3,648	1,482,912,000	
N T T 都市開発リート投資法人 投資証券	5,127	779,816,700	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	3,576	703,399,200	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	3,654	415,825,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	12,007	1,857,482,900	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	3,812	556,170,800	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	23,476	1,041,160,600	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,979	1,058,765,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	3,645	568,620,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	3,596	1,143,528,000	
福岡リート投資法人 投資証券	2,759	472,616,700	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,568	1,119,552,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	4,370	382,812,000	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,115	784,960,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	2,409	382,308,300	
スタートアップリート投資法人 投資証券	831	218,220,600	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	8,040	2,536,620,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	17,201	1,192,029,300	
大和証券リビング投資法人 投資証券	7,217	863,153,200	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	4,893	663,490,800	
合計	314,159	59,653,937,700	

(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。

マネー・オープン・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2021年 9月21日現在	2022年 9月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	428,848,438	320,806,402
流動資産合計	428,848,438	320,806,402
資産合計	428,848,438	320,806,402
負債の部		
流動負債		
未払解約金	53,937	74,372
未払利息	93	436
流動負債合計	54,030	74,808
負債合計	54,030	74,808
純資産の部		
元本等		
元本	422,120,182	315,782,513
剰余金		
剰余金又は欠損金()	6,674,226	4,949,081
元本等合計	428,794,408	320,731,594
純資産合計	428,794,408	320,731,594
負債純資産合計	428,848,438	320,806,402

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

	2021年 9月21日現在	2022年 9月21日現在
1. 期首	2020年 9月24日	2021年 9月22日
期首元本額	634,336,092円	422,120,182円
期首からの追加設定元本額	7,839,366円	25,985,278円
期首からの一部解約元本額	220,055,276円	132,322,947円
元本の内訳		
上場インデックスファンド中国A株(パンダ) E F u n d C S I 3 0 0	198,295円	198,295円
上場インデックスファンド海外債券(F T S E W G B I) 毎月分配型	19,740円	19,740円
高金利先進国債券オープン(毎月分配型)	7,988,931円	6,753,467円
世界銀行債券ファンド(毎月分配型)	10,544,803円	9,453,676円

高金利先進国債券オープン（資産成長型）	646,237円	582,564円
資源ファンド（株式と通貨）ブラジルリアル・コース	5,343,847円	7,904,694円
資源ファンド（株式と通貨）南アフリカランド・コース	3,032,859円	2,653,229円
資源ファンド（株式と通貨）オーストラリアドル・コース	1,214,271円	1,326,398円
グローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）	214,857,306円	161,056,339円
グローバル3倍3分法ファンド（隔月分配型）	121,038,871円	78,638,884円
グローバル3倍3分法（適格機関投資家専用）	857,324円	4,986,437円
グローバル3倍3分法オープン（適格機関投資家専用）	50,075円	527,561円
日興・GS 世界ソブリン・ファンド（毎月分配型）	7,463,693円	7,148,340円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型（米ドルコース）	15,864,489円	14,319,160円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型（円ヘッジコース）	3,990,181円	2,592,879円
日興・アッシュモア・グローイング・マルチストラテジー・ファンド	2,338,123円	- 円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド資産成長型（米ドルコース）	1,373,445円	1,258,120円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型（ブラジルリアルコース）	2,500,658円	2,342,442円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型（南アフリカランドコース）	678,906円	476,875円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型（トルコリラコース）	19,653,762円	11,397,645円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型（メキシコペソコース）	715,599円	581,495円
日興・世界ソブリン・ファンド VA（適格機関投資家転売制限付）	592,437円	522,182円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型（インドネシアルピアコース）	264,719円	234,936円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型（インドルピーコース）	891,611円	807,155円
計	422,120,182円	315,782,513円
2. 受益権の総数	422,120,182口	315,782,513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 9月24日 至 2021年 9月21日	自 2021年 9月22日 至 2022年 9月21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 9月21日現在	2022年 9月21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 該当事項はありません。 (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。

(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 9月21日現在		2022年 9月21日現在	
1口当たり純資産額	1.0158円	1口当たり純資産額	1.0157円
(1万口当たり純資産額)	(10,158円)	(1万口当たり純資産額)	(10,157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

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

該当事項はありません。

【中間財務諸表】

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（2022年 9月22日から2023年 3月21日まで）の中間財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【グローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前計算期間末 2022年 9月21日現在	当中間計算期間末 2023年 3月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,139,738,515	2,301,653,845
投資信託受益証券	152,323,345,432	153,328,950,352
親投資信託受益証券	163,584,923	163,552,712
流動資産合計	154,626,668,870	155,794,156,909
資産合計	154,626,668,870	155,794,156,909
負債の部		
流動負債		
未払解約金	381,514,918	217,596,981
未払受託者報酬	18,799,936	16,319,368
未払委託者報酬	319,600,009	277,430,366
未払利息	2,910	517
その他未払費用	13,999,549	8,055,748
流動負債合計	733,917,322	519,402,980
負債合計	733,917,322	519,402,980
純資産の部		
元本等		
元本	125,608,307,258	131,785,971,068
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	28,284,444,290	23,488,782,861
（分配準備積立金）	32,621,328,677	31,082,606,475
元本等合計	153,892,751,548	155,274,753,929
純資産合計	153,892,751,548	155,274,753,929
負債純資産合計	154,626,668,870	155,794,156,909

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前中間計算期間		当中間計算期間	
	自	至	自	至
	2021年	2022年	2022年	2023年
	9月22日	3月21日	9月22日	3月21日
営業収益				
有価証券売買等損益		19,023,473,838		5,606,024,059
営業収益合計		19,023,473,838		5,606,024,059
営業費用				
支払利息		151,417		410,507
受託者報酬		21,940,518		16,319,368
委託者報酬		372,989,825		277,430,366
その他費用		9,833,250		8,055,748
営業費用合計		404,915,010		302,215,989
営業利益又は営業損失()		19,428,388,848		5,908,240,048
経常利益又は経常損失()		19,428,388,848		5,908,240,048
中間純利益又は中間純損失()		19,428,388,848		5,908,240,048
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()		669,653,005		336,035,528
期首剰余金又は期首欠損金()		77,400,125,674		28,284,444,290
剰余金増加額又は欠損金減少額		7,428,079,145		2,160,736,246
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		7,428,079,145		2,160,736,246
剰余金減少額又は欠損金増加額		11,802,489,445		1,384,193,155
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		11,802,489,445		1,384,193,155
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金()		54,266,979,531		23,488,782,861

(3) 【中間注記表】

(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	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。
-----------------	--

(中間貸借対照表に関する注記)

		前計算期間末 2022年 9月21日現在	当中間計算期間末 2023年 3月21日現在
1.	期首元本額	137,280,410,187円	125,608,307,258円
	期中追加設定元本額	21,374,040,998円	12,393,625,188円
	期中一部解約元本額	33,046,143,927円	6,215,961,378円
2.	受益権の総数	125,608,307,258口	131,785,971,068口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 2021年 9月22日 至 2022年 3月21日	当中間計算期間 自 2022年 9月22日 至 2023年 3月21日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	前計算期間末 2022年 9月21日現在	当中間計算期間末 2023年 3月21日現在
中間貸借対照表計上額、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。	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末日の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

（1口当たり情報）

前計算期間末 2022年 9月21日現在		当中間計算期間末 2023年 3月21日現在	
1口当たり純資産額	1.2252円	1口当たり純資産額	1.1782円
(1万口当たり純資産額)	(12,252円)	(1万口当たり純資産額)	(11,782円)

当ファンドは、「グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）」を主要投資対象としており、中間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、「マネー・オープン・マザーファンド」を主要投資対象としており、中間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）

グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	20,180,690,449	30,806,630,689
親投資信託受益証券	191,520,790,434	179,131,827,933
派生商品評価勘定	-	16,571,785,057
未収入金	6,107,894,268	-
前払金	-	129,500,100
差入委託証拠金	31,360,605,393	10,281,200,980
流動資産合計	249,169,980,544	236,920,944,759
資産合計	249,169,980,544	236,920,944,759
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,311,825,809	2,685,248,050
前受金	359,337,000	-
未払金	6,719,400	-
未払解約金	1,104,539,099	857,115,193
未払受託者報酬	4,525,898	3,733,595
未払委託者報酬	13,577,727	11,200,810
未払利息	27,451	6,920
その他未払費用	59,919,935	28,270,481
流動負債合計	13,860,472,319	3,585,575,049

	2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
負債合計	13,860,472,319	3,585,575,049
純資産の部		
元本等		
元本	187,095,112,660	192,595,076,706
剰余金		
剰余金又は欠損金()	48,214,395,565	40,740,293,004
(分配準備積立金)	77,892,586,458	78,782,391,415
元本等合計	235,309,508,225	233,335,369,710
純資産合計	235,309,508,225	233,335,369,710
負債純資産合計	249,169,980,544	236,920,944,759

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	(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。 (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。
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)

	2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
1. 期首	2021年 9月22日	2022年 9月22日
期首元本額	207,828,189,020円	187,095,112,660円
期首からの追加設定元本額	4,169,792,469円	7,879,639,561円
期首からの一部解約元本額	24,902,868,829円	2,379,675,515円
2. 受益権の総数	187,095,112,660口	192,595,076,706口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 9月21日現在	2023年 3月21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。	(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。	(2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（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）

（2022年 9月21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	49,365,843,000	-	49,223,760,000	142,083,000
	合計	49,365,843,000	-	49,223,760,000	142,083,000

（2023年 3月21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	45,851,725,100	-	43,167,725,000	2,684,000,100
	合計	45,851,725,100	-	43,167,725,000	2,684,000,100

（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中間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、同中間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。

(債券関連)

(2022年 9月21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	債券先物取引				
	買建	494,804,372,635	-	482,637,120,776	12,167,251,859
合計		494,804,372,635	-	482,637,120,776	12,167,251,859

(2023年 3月21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	債券先物取引				
	買建	453,653,436,020	-	470,226,272,127	16,572,836,107
合計		453,653,436,020	-	470,226,272,127	16,572,836,107

(注) 1. 時価の算定方法

債券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中間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、同中間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. 債券先物取引の残高は、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中間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。

(1口当たり情報)

2022年 9月21日現在		2023年 3月21日現在	
1口当たり純資産額	1.2577円	1口当たり純資産額	1.2115円
(1万口当たり純資産額)	(12,577円)	(1万口当たり純資産額)	(12,115円)

「グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）」は、「海外株式インデックスMSCI-KOK USA I（ヘッジなし）マザーファンド」「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジな

し)マザーファンド」「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」「日本リートインデックスJ-REIT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)

	2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	785,377,435	862,716,652
コール・ローン	2,666,393,573	2,360,129,303
株式	245,881,606,322	244,344,681,173
投資証券	6,127,766,749	5,436,544,693
派生商品評価勘定	43,269,431	47,167,656
未収入金	17,909,430	2,375,757
未収配当金	387,994,139	454,018,967
差入委託証拠金	654,130,888	630,720,865
流動資産合計	256,564,447,967	254,138,355,066
資産合計		
	256,564,447,967	254,138,355,066
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	111,064,256	39,372,711
未払金	-	1,205,223,159
未払解約金	2,238,913,250	15,569,831
未払利息	3,627	530
流動負債合計	2,349,981,133	1,260,166,231
負債合計		
	2,349,981,133	1,260,166,231
純資産の部		
元本等		
元本	59,219,776,408	60,927,997,834
剰余金		
剰余金又は欠損金()	194,994,690,426	191,950,191,001
元本等合計	254,214,466,834	252,878,188,835
純資産合計		
	254,214,466,834	252,878,188,835
負債純資産合計		
	256,564,447,967	254,138,355,066

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p>
--------------------	--

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

（貸借対照表に関する注記）

		2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
1.	期首	2021年 9月22日	2022年 9月22日
	期首元本額	63,130,131,603円	59,219,776,408円
	期首からの追加設定元本額	9,236,924,091円	6,712,600,040円
	期首からの一部解約元本額	13,147,279,286円	5,004,378,614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）	28,997,787,689円	31,122,803,666円
	DCインデックスバランス（株式20）	115,662,350円	122,768,649円
	DCインデックスバランス（株式40）	309,959,238円	333,282,207円
	DCインデックスバランス（株式60）	621,597,197円	680,856,174円
	DCインデックスバランス（株式80）	671,195,864円	748,975,804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	1,451,811,553円	1,433,903,555円
	日興五大陸株式ファンド	3,672,260,311円	3,615,313,473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）	14,402,554円	13,923,173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）	89,961,945円	86,196,465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）	5,897,044,747円	5,882,364,397円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	11,171,147,481円	10,899,590,692円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	- 円	1,252,485円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	3,002,254円	- 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	2,543,483円	- 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	2,733,134円	- 円

		2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	2,604,996円	- 円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,851,295,893円	1,657,561,313円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	17,945,851円	18,544,799円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	50,225,952円	51,216,261円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	77,455,664円	79,259,677円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	75,228,743円	78,955,996円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,123,909,509円	4,101,229,048円
	計	59,219,776,408円	60,927,997,834円
2.	受益権の総数	59,219,776,408口	60,927,997,834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）

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（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）

（2022年 9月21日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,402,471,887	-	2,291,552,226	110,919,661
	合計	2,402,471,887	-	2,291,552,226	110,919,661

(2023年 3月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,705,692,669	-	4,715,360,130	9,667,461
	合計	4,705,692,669	-	4,715,360,130	9,667,461

(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中間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、同中間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中間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)

(2022年 9月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,094,976,751	-	1,137,892,915	42,916,164
	米ドル	867,002,360	-	901,929,400	34,927,040
	ユーロ	227,974,391	-	235,963,515	7,989,124
	売建	121,383,266	-	121,174,594	208,672
	英ポンド	89,420,711	-	89,122,596	298,115
	スイスフラン	17,054,500	-	17,153,135	98,635
	豪ドル	14,908,055	-	14,898,863	9,192
	合計	1,216,360,017	-	1,259,067,509	43,124,836

(2023年 3月21日現在)

(単位：円)

--	--	--	--	--	--

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	4,422,227,403	-	4,420,354,887	1,872,516
	米ドル	3,216,194,100	-	3,217,065,760	871,660
	加ドル	47,473,160	-	47,468,358	4,802
	ユーロ	930,692,750	-	927,994,179	2,698,571
	英ポンド	110,335,324	-	110,305,793	29,531
	スイスフラン	34,068,391	-	34,072,460	4,069
	スウェーデンクローナ	25,944,390	-	25,906,670	37,720
	デンマーククローネ	12,845,925	-	12,843,090	2,835
	香港ドル	8,448,550	-	8,448,400	150
シンガポールドル	36,224,813	-	36,250,177	25,364	
合計		4,422,227,403	-	4,420,354,887	1,872,516

(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中間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。

同中間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。

同中間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。

- ・ 同中間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。
- ・ 同中間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中間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中間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。

(1口当たり情報)

2022年 9月21日現在		2023年 3月21日現在	
1口当たり純資産額	4,292円	1口当たり純資産額	4,150円
(1万口当たり純資産額)	(42,927円)	(1万口当たり純資産額)	(41,504円)

海外新興国株式インデックスMSCIEマージング(ヘッジなし)マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,933,542,413	472,170,290
コール・ローン	1,260,817,628	242,405,887

	2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
株式	89,562,031,570	85,511,486,962
投資証券	100,035,022	98,447,742
派生商品評価勘定	1,086,299	10,100,560
未収入金	31,275,549	1,847,344
未収配当金	151,418,286	225,013,786
未収利息	10,491	24,754
差入委託証拠金	4,214,592,065	6,606,206,946
流動資産合計	97,254,809,323	93,167,704,271
資産合計	97,254,809,323	93,167,704,271
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	213,183,222	70,054,878
未払金	-	23,561,738
未払解約金	1,290,576,504	-
未払利息	1,715	54
流動負債合計	1,503,761,441	93,616,670
負債合計	1,503,761,441	93,616,670
純資産の部		
元本等		
元本	42,339,806,937	43,946,572,272
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	53,411,240,945	49,127,515,329
元本等合計	95,751,047,882	93,074,087,601
純資産合計	95,751,047,882	93,074,087,601
負債純資産合計	97,254,809,323	93,167,704,271

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

		2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
1.	期首	2021年 9月22日	2022年 9月22日
	期首元本額	48,129,522,181円	42,339,806,937円
	期首からの追加設定元本額	9,267,492,418円	8,650,701,453円
	期首からの一部解約元本額	15,057,207,662円	7,043,936,118円
	元本の内訳		
	日興五大陸株式ファンド	1,751,341,825円	1,771,561,846円
	インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	16,229,704,319円	17,738,194,277円
	インデックスファンド新興国株式（適格機関投資家向け）	3,279,235,631円	3,155,811,610円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	21,079,525,162円	21,280,678,448円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	- 円	326,091円
	計	42,339,806,937円	43,946,572,272円
2.	受益権の総数	42,339,806,937口	43,946,572,272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）

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(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)

(2022年 9月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	6,280,209,766	-	6,068,855,520	211,354,246
合計		6,280,209,766	-	6,068,855,520	211,354,246

(2023年 3月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	9,250,543,139	-	9,191,655,111	58,888,028
合計		9,250,543,139	-	9,191,655,111	58,888,028

(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中間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、同中間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中間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)

(2022年 9月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	388,720,878	-	389,145,016	424,138
	米ドル	388,720,878	-	389,145,016	424,138
	売建	478,457,608	-	479,624,423	1,166,815
	メキシコペソ	5,340,975	-	5,392,350	51,375
	ブラジルリアル	41,041,518	-	41,041,518	-
	香港ドル	54,660,300	-	54,926,100	265,800
	インドネシアルピア	26,736,160	-	26,736,160	-
	韓国ウォン	112,488,000	-	112,597,000	109,000
	台湾ドル	145,840,000	-	146,556,800	716,800
	南アフリカランド	29,735,455	-	29,595,295	140,160
	サウジアラビアリアル	62,615,200	-	62,779,200	164,000
	合計	867,178,486	-	868,769,439	742,677

（2023年 3月21日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,890,942,000	-	1,889,875,710	1,066,290
	米ドル	1,890,942,000	-	1,889,875,710	1,066,290
合計		1,890,942,000	-	1,889,875,710	1,066,290

（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中間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。

同中間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。

同中間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。

- ・ 同中間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。
- ・ 同中間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中間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中間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。

(1口当たり情報)

2022年 9月21日現在		2023年 3月21日現在	
1口当たり純資産額	2.2615円	1口当たり純資産額	2.1179円
(1万口当たり純資産額)	(22,615円)	(1万口当たり純資産額)	(21,179円)

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)

	2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	97,066,906	371,983,058
コール・ローン	2,217,199,357	19,942,444
投資証券	53,049,241,120	51,087,489,644
派生商品評価勘定	5,496	21,331
未収入金	9,646,871	2,575,094
未収配当金	166,641,059	186,144,404
流動資産合計	55,539,800,809	51,668,155,975
資産合計	55,539,800,809	51,668,155,975
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	34,895
未払金	93,084,521	767,934,407
未払解約金	2,192,654,322	77,025
未払利息	3,015	4
流動負債合計	2,285,741,858	768,046,331
負債合計	2,285,741,858	768,046,331
純資産の部		
元本等		
元本	18,428,589,771	19,751,562,902
剰余金		
剰余金又は欠損金()	34,825,469,180	31,148,546,742
元本等合計	53,254,058,951	50,900,109,644
純資産合計	53,254,058,951	50,900,109,644
負債純資産合計	55,539,800,809	51,668,155,975

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>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）

		2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
1.	期首	2021年 9月22日	2022年 9月22日
	期首元本額	28,868,868,987円	18,428,589,771円
	期首からの追加設定元本額	3,307,478,503円	4,048,053,251円
	期首からの一部解約元本額	13,747,757,719円	2,725,080,120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	2,077,326,280円	2,163,312,428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）	10,631,291円	7,288,914円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	16,106,034,269円	17,351,538,028円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	- 円	1,432,508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）	234,597,931円	227,991,024円
	計	18,428,589,771円	19,751,562,902円
2.	受益権の総数	18,428,589,771口	19,751,562,902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）

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（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）

（2022年 9月21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	3,148,253	-	3,153,749	5,496
	韓国ウォン	3,148,253	-	3,153,749	5,496
	合計	3,148,253	-	3,153,749	5,496

（2023年 3月21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	675,656,918	-	675,643,354	13,564
	米ドル	557,123,700	-	557,090,520	33,180
	加ドル	6,781,880	-	6,781,194	686
	ユーロ	26,903,525	-	26,910,498	6,973
	英ポンド	30,724,311	-	30,730,353	6,042

	豪ドル	34,811,790	-	34,810,893	897
	香港ドル	7,434,724	-	7,434,592	132
	シンガポールドル	11,876,988	-	11,885,304	8,316
	合計	675,656,918	-	675,643,354	13,564

(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中間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。

同中間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。

同中間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。

- ・ 同中間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。
- ・ 同中間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中間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中間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。

(1口当たり情報)

2022年 9月21日現在		2023年 3月21日現在	
1口当たり純資産額	2.8898円	1口当たり純資産額	2.5770円
(1万口当たり純資産額)	(28,898円)	(1万口当たり純資産額)	(25,770円)

日本リートインデックスJ - REITマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	744,794,630	250,661,935
投資証券	59,653,937,700	53,617,108,450
未収配当金	579,364,210	649,571,981
流動資産合計	60,978,096,540	54,517,342,366
資産合計	60,978,096,540	54,517,342,366
負債の部		
流動負債		
未払解約金	478,707,044	-
未払利息	1,013	56
流動負債合計	478,708,057	56
負債合計	478,708,057	56
純資産の部		
元本等		
元本	22,912,181,985	23,189,076,422
剰余金		
剰余金又は欠損金()	37,587,206,498	31,328,265,888

	2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
元本等合計	60,499,388,483	54,517,342,310
純資産合計	60,499,388,483	54,517,342,310
負債純資産合計	60,978,096,540	54,517,342,366

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
1.	期首	2021年 9月22日	2022年 9月22日
	期首元本額	29,585,033,053円	22,912,181,985円
	期首からの追加設定元本額	2,732,116,718円	5,812,788,740円
	期首からの一部解約元本額	9,404,967,786円	5,535,894,303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	2,379,159,052円	2,402,225,872円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	1,389,497,593円	1,448,495,931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)	146,780,410円	146,673,427円
	グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	18,690,339,580円	18,761,762,800円
	財産3分法(適格機関投資家専用)	306,405,350円	429,785,786円
	Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	-円	132,606円
	計	22,912,181,985円	23,189,076,422円
2.	受益権の総数	22,912,181,985口	23,189,076,422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)

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(1口当たり情報)

2022年 9月21日現在		2023年 3月21日現在	
1口当たり純資産額	2,6405円	1口当たり純資産額	2,3510円
(1万口当たり純資産額)	(26,405円)	(1万口当たり純資産額)	(23,510円)

マネー・オープン・マザーファンド

貸借対照表

(単位 : 円)

	2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	320,806,402	311,342,432
流動資産合計	320,806,402	311,342,432
資産合計	320,806,402	311,342,432
負債の部		
流動負債		
未払解約金	74,372	512,516
未払利息	436	69
流動負債合計	74,808	512,585
負債合計	74,808	512,585
純資産の部		
元本等		
元本	315,782,513	306,090,603

	2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
剰余金		
剰余金又は欠損金()	4,949,081	4,739,244
元本等合計	320,731,594	310,829,847
純資産合計	320,731,594	310,829,847
負債純資産合計	320,806,402	311,342,432

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

		2022年 9月21日現在	2023年 3月21日現在
1.	期首	2021年 9月22日	2022年 9月22日
	期首元本額	422,120,182円	315,782,513円
	期首からの追加設定元本額	25,985,278円	6,598,342円
	期首からの一部解約元本額	132,322,947円	16,290,252円
	元本の内訳		
	上場インデックスファンド中国A株(パンダ) E F u n d C S I 3 0 0	198,295円	198,295円
	上場インデックスファンド海外債券(F T S E W G B I) 毎月分配型	19,740円	19,740円
	高金利先進国債券オープン(毎月分配型)	6,753,467円	6,048,590円
	世界銀行債券ファンド(毎月分配型)	9,453,676円	9,000,074円
	高金利先進国債券オープン(資産成長型)	582,564円	542,865円
	資源ファンド(株式と通貨)ブラジルリアル・コース	7,904,694円	7,904,694円
	資源ファンド(株式と通貨)南アフリカランド・コース	2,653,229円	2,630,017円
	資源ファンド(株式と通貨)オーストラリアドル・コース	1,326,398円	1,169,588円
	グローバル3倍3分法ファンド(1年決算型)	161,056,339円	161,056,339円
	グローバル3倍3分法ファンド(隔月分配型)	78,638,884円	72,736,149円
	グローバル3倍3分法(適格機関投資家専用)	4,986,437円	5,692,365円
	グローバル3倍3分法オープン(適格機関投資家専用)	527,561円	460,487円
	日興・G S 世界ソブリン・ファンド(毎月分配型)	7,148,340円	6,428,510円
	日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分 配型(米ドルコース)	14,319,160円	13,388,064円
	日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分 配型(円ヘッジコース)	2,592,879円	2,390,398円
	日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド資産成 長型(米ドルコース)	1,258,120円	1,157,670円
	日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分 配型(ブラジルリアルコース)	2,342,442円	2,147,251円
	日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分 配型(南アフリカランドコース)	476,875円	404,908円

日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型（トルコリラコース）	11,397,645円	10,938,332円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型（メキシコペソコース）	581,495円	597,206円
日興・世界ソブリン・ファンド VA（適格機関投資家転売制限付）	522,182円	458,318円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型（インドネシアルピアコース）	234,936円	161,323円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型（インドルピーコース）	807,155円	559,420円
計	315,782,513円	306,090,603円
2. 受益権の総数	315,782,513口	306,090,603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）

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 9月21日現在	2023年 3月21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 該当事項はありません。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（1口当たり情報）

2022年 9月21日現在		2023年 3月21日現在	
1口当たり純資産額	1.0157円	1口当たり純資産額	1.0155円
(1万口当たり純資産額)	(10,157円)	(1万口当たり純資産額)	(10,155円)

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2023年 3月31日現在です。

【グローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）】

【純資産額計算書】

資産総額	157,875,376,254円
負債総額	239,192,971円
純資産総額（ - ）	157,636,183,283円
発行済口数	132,011,503,966口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1941円

（参考）

グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）

純資産額計算書

資産総額	237,045,691,884円
負債総額	428,362,752円
純資産総額（ - ）	236,617,329,132円
発行済口数	192,647,308,388口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2282円

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

純資産額計算書

資産総額	268,368,022,213円
負債総額	9,251,034円
純資産総額（ - ）	268,358,771,179円
発行済口数	61,729,705,691口
1口当たり純資産額（ / ）	4.3473円

海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	99,461,154,302円
負債総額	132,379,940円
純資産総額（ - ）	99,328,774,362円
発行済口数	44,903,465,704口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2121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	52,826,071,804円
負債総額	9,131,337円
純資産総額（ - ）	52,816,940,467円
発行済口数	20,015,543,062口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6388円

日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	57,621,207,938円
負債総額	134,934,514円
純資産総額（ - ）	57,486,273,424円
発行済口数	23,933,397,516口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4019円

マネー・オープン・マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	310,842,026円
負債総額	18,508円
純資産総額（ - ）	310,823,518円
発行済口数	306,085,112口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0155円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

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

いものとしてします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2023年3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（2023年3月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

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

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

・監査等委員会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（2023年3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、2023年3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	855	241,418
株式投資信託	799	206,870
単位型	313	9,635
追加型	486	197,234
公社債投資信託	56	34,548
単位型	43	1,080
追加型	13	33,467

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）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」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。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第64期中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第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	5,572
未払法人税等		1,090		2,354
未払消費税等	4	775	4	3,669
賞与引当金		3,034		3,958
役員賞与引当金		55		5
訴訟損失引当金		-		7,847
その他		643		1,330
流動負債合計		20,938		35,083
固定負債				
退職給付引当金		1,456		1,395
賞与引当金		156		423
その他		544		390
固定負債合計		2,157		2,209
負債合計		23,095		37,292
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		61,956		68,901
利益剰余金合計		61,956		68,901
自己株式		2,067		2,067
株主資本合計		82,472		89,417
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		1,461		2,350

繰延ヘッジ損益	115	731
評価・換算差額等合計	1,577	1,618
純資産合計	84,049	91,035
負債純資産合計	107,145	128,328

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

	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)
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 (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)	
	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						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計		
				繰越利益 剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	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	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)					
	1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 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。</p> <table style="margin-left: 20px;"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>		建物	3年～15年	器具備品	3年～20年
建物	3年～15年					
器具備品	3年～20年					
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 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。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <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</p> <p>当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」）に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドのAUMに固定料率を乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問業務</p> <p>当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドのAUMに投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。</p> <p>(3) 成功報酬</p> <p>当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。</p>
5 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法</p> <p>繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象</p> <p>ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針</p> <p>ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法</p> <p>ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
6 その他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</p> <p>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)</p> <p>「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下、「収益認識会計基準」という。)等を当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。</p> <p>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)</p> <p>「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)等を当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。</p> <p>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、記載してありません。</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おります。
 - (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いません。

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 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

デリバティブ取引計	(642)	(642)	-
-----------	-------	-------	---

- (1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。
(2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

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

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

(単位:百万円)

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

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います。

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いますが、一部が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する、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

- レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

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

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

- (1) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、で示しております。
- (2) 株式関連のデリバティブ取引のうち 262百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。
- (3) 通貨関連のデリバティブ取引の 1,066百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。
- (4) 時価算定適用指針に従い、経過措置を適用した投資信託は上記に含めておりません。貸借対照表における当該投資信託の金額は有価証券に170百万円、投資有価証券に23,952百万円となります。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

デリバティブ取引
株式関連

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

通貨関連

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額
非上場株式	16
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

3 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	42,427			
未収委託者報酬	25,193			
未収収益	1,048			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	170	345	8,874	19
合計	68,839	345	8,874	19

(有価証券関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	23,094
関連会社株式	2,892

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格のない株式等であるため、時価を記載しておりません。

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	20,934	17,366	3,568
	小計	20,934	17,366	3,568
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	3,188	3,369	180
	小計	3,188	3,369	180
合計		24,123	20,735	3,387

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	3,079	253	132
合計	3,079	253	132

(デリバティブ取引関係)

第62期(2021年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,713	-	112	112
合計		1,713	-	112	112

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第63期(2022年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建 米ドル	4,708	-	293	293
合計		4,708	-	293	293

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 3,010	(1) 関連会社に対する投資の金額 5,312
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 12,258	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 15,942
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,751	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,964

(退職給付関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,363
勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	6
退職給付の支払額	86
退職給付債務の期末残高	1,429

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

退職給付債務	1,429
未積立退職給付債務	1,429
未認識数理計算上の差異	27
貸借対照表に計上された負債の額	1,456
退職給付引当金	1,456

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	2
確定給付制度に係る退職給付費用	147

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎 割引率	0.2%
--------------------------------	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、240百万円でありました。

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)	
退職給付債務の期首残高	1,429
勤務費用	143
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	12
退職給付の支払額	211
退職給付債務の期末残高	1,352

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

退職給付債務	1,352
未積立退職給付債務	1,352
未認識数理計算上の差異	43
貸借対照表に計上された負債の額	1,395
退職給付引当金	1,395
貸借対照表に計上された負債の額	1,395

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	143
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用	150

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎 割引率	0.3%
--------------------------------	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、244百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1 ストックオプション(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	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tockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
 当事業年度末における本源的価値の合計額 1,222百万円
 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的主要原因別の 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的主要原因別の 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
繰延税金負債	評価性引当金(注) 52
繰延ヘッジ利益 51	繰延税金資産合計 5,719
その他有価証券評価差額金 645	繰延税金負債
繰延税金負債合計 696	その他有価証券評価差額金 1,092
繰延税金資産の純額 1,845	その他 948
	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 (調整)	法定実効税率 (調整)
30.6%	30.6%
交際費等永久に損金に算入されない項目	交際費等永久に損金に算入されない項目
0.3%	0.1%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	受取配当金等永久に益金に算入されない項目
5.7%	10.9%
その他	評価性引当金の減少
1.0%	10.3%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	その他
26.2%	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(米国ドル貸建)(注1)	-	関係会社短期貸付金	2,019 (USD 16,500千)
							貸付金利息(米国ドル貸建)(注1)	44 (USD 397千)	未収収益	10 (USD 86千)
							資金の返済(円貸建)(注1)	577	関係会社短期貸付金	-
							貸付金利息(円貸建)(注1)	3	未収収益	-
							資金の貸付(シンガポールドル貸建)(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(シンガポールドル貸建)(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場合、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場合、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場合、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場合、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おりません。

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第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 (2021年3月31日)	第63期 (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。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第64期中間会計期間 (2022年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		33,164
有価証券		481
未収委託者報酬		16,607
未収収益		1,063
関係会社短期貸付金		3,335
その他	2	3,967
流動資産合計		58,620
固定資産		
有形固定資産	1	404
無形固定資産		353
投資その他の資産		
投資有価証券		23,904
関係会社株式		22,366
長期差入保証金		416
繰延税金資産		4,029
投資その他の資産合計		50,718
固定資産合計		51,476
資産合計		110,097

(単位:百万円)

第64期中間会計期間
(2022年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	7,815
未払費用	3,556
未払法人税等	3,271
未払消費税等	3
賞与引当金	1,924
役員賞与引当金	110
その他	1,258
流動負債合計	18,282
固定負債	
退職給付引当金	1,445
賞与引当金	321
役員賞与引当金	16
その他	119
固定負債合計	1,903
負債合計	20,186
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	68,572
利益剰余金合計	68,572
自己株式	2,067
株主資本合計	89,088
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	2,064
繰延ヘッジ損益	1,242
評価・換算差額等合計	822
純資産合計	89,911
負債純資産合計	110,097

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第64期中間会計期間
(自 2022年4月1日
至 2022年9月30日)

営業収益	
委託者報酬	38,118
その他営業収益	1,728
営業収益合計	39,846

営業費用及び一般管理費	1	34,563
営業利益		5,283
営業外収益	2	1,046
営業外費用	3	516
経常利益		5,813
特別利益	4	4,602
特別損失	5	137
税引前中間純利益		10,277
法人税等	6	3,185
中間純利益		7,091

(3) 中間株主資本等変動計算書

第64期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30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	68,901	68,901	2,067	89,417
当中間期変動額							
剰余金の配当				7,420	7,420		7,420
中間純利益				7,091	7,091		7,091
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)							
当中間期変動額合計	-	-	-	328	328	-	328
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	68,572	68,572	2,067	89,088

	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	2,350	731	1,618	91,035
当中間期変動額				
剰余金の配当				7,420
中間純利益				7,091
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)	285	510	795	795
当中間期変動額合計	285	510	795	1,124
当中間期末残高	2,064	1,242	822	89,911

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
----	---

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

5 ヘッジ会計の方法	<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> <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 ヘッジ取引細則等に基づき、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 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 資産に係る控除対象外消費税等の会計処理 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は当中間会計期間の費用として処理しております。</p> <p>(2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。</p>

(会計方針の変更)

<p>第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)</p>
<p>(時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用) 「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。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。なお、当中間財務諸表に与える影響は軽微であります。</p>

(表示方法の変更)

<p>第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)</p>
<p>(損益計算書) その他有価証券の為替リスクヘッジに係るヘッジ損益について、ヘッジ対象の損益認識時に繰延ヘッジ損益を純損益に計上するに当たり、前中間会計期間において、「営業外費用」に含めていましたが、金額的重要性が高まったことから、ヘッジの効果をより明瞭に表示するため当中間会計期間よりヘッジ対象の損益区分と同一区分である特別利益あるいは特別損失として表示することとしております。</p>

(中間貸借対照表関係)

<p>第64期中間会計期間 (2022年9月30日)</p>	
1	<p>有形固定資産の減価償却累計額 2,264百万円</p>
2	<p>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。</p>

3 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

4 保証債務

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470百万円（5百万豪ドル）を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。

（中間損益計算書関係）

第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	50百万円
無形固定資産	37百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	40百万円
受取配当金	131百万円
デリバティブ収益	685百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	156百万円
為替差損	351百万円
4 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	120百万円
訴訟損失引当金戻入額	4,481百万円
5 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	137百万円
6 中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。	

（中間株主資本等変動計算書関係）

第64期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会 計期間末 残高 (百万円)
		当事業 年度期首	当中間 会計期間 増加	当中間 会計期間 減少	当中間 会計期間末	

2016年度 ストックオプション（1）	普通株式	88,000	-	88,000	-	-
2016年度 ストックオプション（2）	普通株式	816,000	-	599,000	217,000	-
2017年度 ストックオプション（1）	普通株式	1,536,000	-	667,000	869,000	-
合計		2,440,000	-	1,354,000	1,086,000	-

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

2 2016年度ストックオプション(2)217,000株及び2017年度ストックオプション(1)869,000株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

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
2022年5月27日 取締役会	普通株式	7,420	38.22	2022年3月31日	2022年6月27日

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

(リース取引関係)

第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	910百万円
1年超	3,870百万円
合計	4,780百万円

(金融商品関係)

第64期中間会計期間(2022年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

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

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

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

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

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

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計

有価証券 その他有価証券 投資信託	4,796	19,572	-	24,369
資産計	4,796	19,572	-	24,369
デリバティブ取引(1、2)				
株式関連	666	-	-	666
通貨関連	-	626	-	626
デリバティブ取引計	666	626	-	39

- (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666百万円は、中間貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。また通貨関連のデリバティブ取引のうち626百万円は、流動負債のその他に含まれております。

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

資 産

有価証券

上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買取請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限が無い場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株式関連

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

通貨関連

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

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

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
非上場株式	16
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

(有価証券関係)

第64期中間会計期間(2022年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額

中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えるもの	投資信託	17,633	13,768	3,865
	小計	17,633	13,768	3,865
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えないもの	投資信託	6,735	7,625	889
	小計	6,735	7,625	889
合計		24,369	21,393	2,976

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

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

(デリバティブ取引関係)

第64期中間会計期間(2022年9月30日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	7,428	-	666	666
合計		7,428	-	666	666

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

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 シンガポール ドル	3,222	-	98	98
合計		3,222	-	98	98

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

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引 通貨関連

ヘッジ会計 の方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		6,241	-	357
	豪ドル		193	-	0
	ユーロ		319	-	8
	香港ドル		976	-	68
	人民元		6,254	-	94
合計			13,984	-	528

（持分法損益等）

第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	5,327百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	17,684百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,341百万円

（収益認識関係）

第64期中間会計期間(2022年9月30日)

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

（ストックオプション等関係）

第64期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

第64期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

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

〔関連情報〕

第64期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

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

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第64期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
第64期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
第64期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
1株当たり純資産額	463円09銭
1株当たり中間純利益金額	36円52銭

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第64期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
中間純利益(百万円)	7,091
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	7,091
普通株式の期中平均株式数(千株)	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2016年度ストックオプション(2)217,000株、 2017年度ストックオプション(1)869,000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64期中間会計期間 (2022年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	89,911
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額(百万円)	89,911
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数(千株)	194,152

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

- (3) 通常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
野村信託銀行株式会社	50,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2022年3月末現在)	事業の内容
アイザワ証券株式会社	3,000百万円	
あかつき証券株式会社	3,067百万円	
今村証券株式会社	857百万円	
岩井コスモ証券株式会社	13,500百万円	
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
F F G 証券株式会社	3,000百万円	
O K B 証券株式会社	1,500百万円	
岡三証券株式会社	5,000百万円	
九州 F G 証券株式会社	3,000百万円	
四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	
静銀ディーエム証券株式会社	3,000百万円	
七十七証券株式会社	3,000百万円	

株式会社証券ジャパン	3,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
第四北越証券株式会社	600百万円	
ちばぎん証券株式会社	4,374百万円	
中銀証券株式会社	2,000百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
とうほう証券株式会社	3,000百万円	
野村證券株式会社 1	10,000百万円	
八十二証券株式会社	3,000百万円	
浜銀T T証券株式会社	3,307百万円	
PWM日本証券株式会社	3,000百万円	
百五証券株式会社	3,000百万円	
ひろぎん証券株式会社	5,000百万円	
フィデリティ証券株式会社	11,757百万円	
ほくほくT T証券株式会社	1,250百万円	
北洋証券株式会社	3,000百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
丸八証券株式会社	3,751百万円	
水戸証券株式会社	12,272百万円	
楽天証券株式会社	17,495百万円	
ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
株式会社愛知銀行	18,000百万円	
株式会社秋田銀行	14,100百万円	
株式会社足利銀行	135,000百万円	
株式会社イオン銀行	51,250百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	
株式会社岩手銀行	12,089百万円	
株式会社愛媛銀行	21,367百万円	
株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	
株式会社沖縄銀行	22,725百万円	
株式会社香川銀行	12,014百万円	
株式会社北九州銀行	10,000百万円	
株式会社紀陽銀行	80,096百万円	
株式会社佐賀銀行	16,062百万円	
株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	
株式会社三十三銀行	37,461百万円	
株式会社滋賀銀行	33,076百万円	
株式会社七十七銀行	24,658百万円	
株式会社清水銀行	10,816百万円	
株式会社十六銀行	36,839百万円	
株式会社荘内銀行	8,500百万円	
株式会社常陽銀行	85,113百万円	

スルガ銀行株式会社	30,043百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
ソニー銀行株式会社	38,500百万円	
株式会社但馬銀行	5,481百万円	
株式会社筑邦銀行	8,000百万円	
株式会社千葉銀行	145,069百万円	
株式会社千葉興業銀行	62,120百万円	
株式会社中京銀行	31,879百万円	
株式会社中国銀行	15,149百万円	
株式会社東京スター銀行	26,000百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	
株式会社栃木銀行	27,408百万円	
株式会社トマト銀行	17,810百万円	
株式会社富山銀行	6,730百万円	
株式会社長崎銀行	7,621百万円	
株式会社長野銀行	13,017百万円	
株式会社名古屋銀行	25,090百万円	
株式会社南都銀行	37,924百万円	
株式会社西日本シティ銀行	85,745百万円	
株式会社百五銀行	20,000百万円	
株式会社広島銀行	54,573百万円	
株式会社福井銀行	17,965百万円	
PayPay銀行株式会社	37,250百万円	
株式会社豊和銀行	12,495百万円	
株式会社北都銀行	12,500百万円	
株式会社北洋銀行	121,101百万円	
株式会社北陸銀行	140,409百万円	
株式会社宮崎銀行	14,697百万円	
株式会社宮崎太陽銀行	15,252百万円	
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	
株式会社もみじ銀行	10,000百万円	
株式会社山形銀行	12,008百万円	
株式会社山口銀行	10,005百万円	
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
おかやま信用金庫	1,777百万円 (出資の総額)	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。
全国信用協同組合連合会	111,875百万円 (出資の総額)	協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

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。
------------------	-----------	---

1 募集の取扱いを行ないません。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

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

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

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日

ファンドの基本的性格など

委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

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

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

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

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

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

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

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

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

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

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

(4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記

載することがあります。

- (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

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

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

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

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

独立監査人の監査報告書

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12月7日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中PwCあらた有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 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」に掲げられているグローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）の2021年9月22日から2022年9月21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、グローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）の2022年9月21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、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

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

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、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、継続企業を前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年12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

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第64期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2022年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記の中間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 データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年5月2日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）の2022年9月22日から2023年3月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、グローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）の2023年3月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年9月22日から2023年3月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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. 上記の中間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 データは中間監査の対象には含まれていません。