

## 【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7月26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】	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）
【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】

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）（以下「ファンド」といいます。）

・愛称として「DC Aナビ40」という名称を用いることがあります。

### （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1.1%（税抜1%）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。ただし、確定拠出年金制度上の取得申込みを行なう場合は、1円以上1円単位とします。

### （７）【申込期間】

2023年7月27日から2024年1月26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/](http://www.nikkoam.com/)

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

( 9 ) 【払込期日】

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

( 1 0 ) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

( 1 1 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

( 1 2 ) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

##### 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

##### 2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 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 北米		
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)	欧州 アジア オセアニア	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)
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 (投資信託証券(資産 複合 資産配分 固定型(株式、債 券)))	その他 ( )	アフリカ 中近東 (中東) エマージング		
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券）））

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

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

年1回

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

グローバル（含む日本）

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジあり（部分ヘッジ）

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

# 1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

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

# 2. インデックスファンドで構成しています。

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

## <国内株式>

### 「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

※日本株式インデックスTOPIXマザーファンドのベンチマークを「TOPIX(東証株価指数)配当込み」に変更いたしました。運用の基本方針などに影響はありません。

## <海外株式>

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

主として日本を除く世界各国の株式(DR(預託証券)およびカントリーファンドなどを含まます。)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めざして運用を行ないます。

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

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

※海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンドのベンチマークを「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、海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンドのベンチマークを「MSCI-KOKUSAIインデックス(税引後配当込み、円ヘッジあり・円ベース)」にそれぞれ変更いたしました。運用の基本方針などに影響はありません。

## <国内債券>

### 「日本債券インデックスマザーファンド」

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

## <海外債券>

### 「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

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

### 「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」

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

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

※MSCI-KOKUSAIインデックス・同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

※FTSE世界国債インデックス(除く日本)・同指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。



### 3. 株式に40%、債券などに60%投資します。

資産の標準実質組入比率は、株式40%、債券など60%とします。

組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンドへの投資比率を調整することで行ないます。

各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

投資対象	基本投資比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	30%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	5%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	5%
日本債券インデックスマザーファンド	45%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	5%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	5%
短期金融資産	5%

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

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

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

#### ファンドの仕組み

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



#### 主な投資制限

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

#### 分配方針

- ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行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。

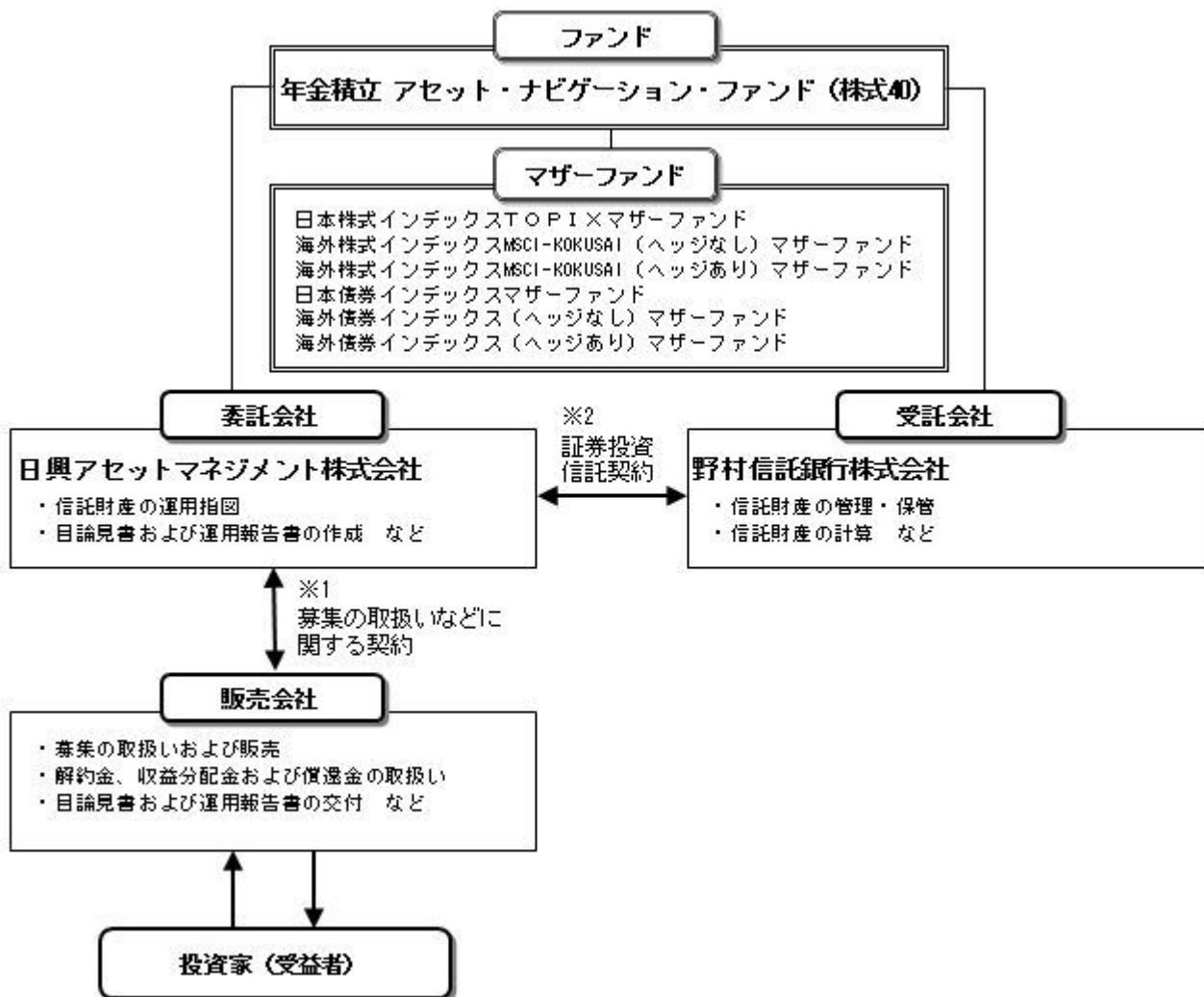
#### (2) 【ファンドの沿革】

2001年10月17日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

### （３）【ファンドの仕組み】

#### ファンドの仕組み



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

#### 委託会社の概況（2023年4月末現在）

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

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

## 2 【投資方針】

### （１）【投資方針】

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



致します。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

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

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」

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

株式の標準実質組入比率.....40%

公社債および短期金融資産の標準実質組入比率.....60%

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

## （２）【投資対象】

<年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）>

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

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

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

の

- 16) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。)
- 17) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)で18)に定めるもの以外のもの
- 18) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 19) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 20) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 21) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 22) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 23) 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。)
- 24) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 25) 外国の者に対する権利で24)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
  - 1) 預金
  - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
  - 3) コール・ローン
  - 4) 手形割引市場において売買される手形
  - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
    - 1) 信用取引
    - 2) 先物取引等
    - 3) スワップ取引
    - 4) 金利先渡取引
    - 5) 為替先渡取引
    - 6) 有価証券の貸付
    - 7) 公社債の空売
    - 8) 公社債の借入
    - 9) 外国為替予約取引
    - 10) 資金の借入

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券

- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
  - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  - 7) コマーシャル・ペーパー
  - 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
  - 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)～8)の証券の性質を有するもの
  - 10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
  - 11) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
  - 12) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  - 13) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  - 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの  
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
    - 1) 預金
    - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
    - 3) コール・ローン
    - 4) 手形割引市場において売買される手形
    - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの  
次の取引ができます。
      - 1) 信用取引
      - 2) 先物取引等
      - 3) スワップ取引
      - 4) 金利先渡取引
      - 5) 有価証券の貸付
      - 6) 公社債の空売
      - 7) 公社債の借入
- < 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド >  
日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。  
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
  - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。）
  - 3) 金銭債権
  - 4) 約束手形
  - 5) 為替手形
- 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
  - 2) 国債証券
  - 3) 地方債証券
  - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

- 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
  - 7) コマーシャル・ペーパー
  - 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。 )および新株予約権証券
  - 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2) ~ 7) の証券の性質を有するもの
  - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
  - 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。 )で12) に定めるもの以外のもの
  - 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。 )または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
  - 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  - 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限り。)
  - 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り。)
  - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - 19) 外国の者に対する権利で18) の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。 )により運用することができます。
    - 1) 預金
    - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
    - 3) コール・ローン
    - 4) 手形割引市場において売買される手形
    - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
    - 6) 外国の者に対する権利で5) の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
      - 1) 信用取引
      - 2) 先物取引等
      - 3) スワップ取引
      - 4) 金利先渡取引
      - 5) 為替先渡取引
      - 6) 有価証券の貸付
      - 7) 公社債の空売
      - 8) 公社債の借入
      - 9) 外国為替予約取引
- < 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI (ヘッジあり) マザーファンド >  
日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。  
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
  - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限り。)
  - 3) 金銭債権
  - 4) 約束手形
  - 5) 為替手形

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

- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証券
  - 2) 国債証券
  - 3) 地方債証券
  - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
  - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  - 7) コマーシャル・ペーパー
  - 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
  - 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)～7)の証券の性質を有するもの
  - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
  - 11) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12)に定めるもの以外のもの
  - 12) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
  - 13) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  - 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
  - 15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
    - 1) 預金
    - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
    - 3) コール・ローン
    - 4) 手形割引市場において売買される手形
    - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
    - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
      - 1) 信用取引
      - 2) 先物取引等
      - 3) スワップ取引
      - 4) 金利先渡取引
      - 5) 為替先渡取引
      - 6) 有価証券の貸付
      - 7) 公社債の空売
      - 8) 公社債の借入
      - 9) 外国為替予約取引
- <日本債券インデックスマザーファンド>  
わが国の公社債を主要投資対象とします。  
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
  - 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
  - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。）
  - 3) 金銭債権
  - 4) 約束手形

## 5) 為替手形

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

## 1) 国債証券

## 2) 地方債証券

## 3) 特別の法律により法人の発行する債券

## 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限りま。

## 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

## 6) コマーシャル・ペーパー

## 7) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの

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

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

## 10) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

## 1) 預金

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

## 3) コール・ローン

## 4) 手形割引市場において売買される手形

5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの  
次の取引ができます。

## 1) 先物取引等

## 2) スワップ取引

## 3) 金利先渡取引

## 4) 有価証券の貸付

## 5) 公社債の空売

## 6) 公社債の借入

## &lt; 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド &gt;

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

## 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）

## 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限りま。

## 3) 金銭債権

## 4) 約束手形

## 5) 為替手形

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

## 1) 国債証券



- 2) 地方債証券
  - 3) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 4) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)に限ります。)
  - 5) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
  - 6) コマーシャル・ペーパー
  - 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)~6)の証券の性質を有するもの
  - 8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
  - 9) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  - 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - 11) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
  - 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
    - 1) 預金
    - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
    - 3) コール・ローン
    - 4) 手形割引市場において売買される手形
    - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
    - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
      - 1) 先物取引等
      - 2) スワップ取引
      - 3) 金利先渡取引
      - 4) 為替先渡取引
      - 5) 有価証券の貸付
      - 6) 公社債の空売
      - 7) 公社債の借入
      - 8) 外国為替予約取引
- < 海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド >  
内外の公社債を主要投資対象とします。  
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
  - 1) 有価証券(株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。)
  - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。)
  - 3) 金銭債権
  - 4) 約束手形
  - 5) 為替手形主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券(短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。))を除きます。))には投資しません。
  - 1) 国債証券
  - 2) 地方債証券

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

#### 投資対象とするマザーファンドの概要

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数）配当込み <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主としてわが国の株式に投資し、T O P I X（東証株価指数）配当込みの動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。</li> <li>・投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
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。
<b>その他</b>	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1999年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

#### 運用の基本方針

基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAI インデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース） <sup>*</sup> に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカン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。</li> <li>投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引や外国為替予約取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<b>その他</b>	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2000年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

<sup>\*</sup> 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。

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

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、円ヘッジあり・円ベース） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>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などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額の合計額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。</li> <li>外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないます。</li> <li>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2000年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

\* MSCI-KOKUSAIインデックスは、MSCI Inc.が発表している、日本を除く世界の主要国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（円ヘッジあり・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数を対円でヘッジし、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。

### < 日本債券インデックスマザーファンド >

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

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

同指数の知的財産権は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なわれる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

### < 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

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

\* FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックス

のデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

#### < 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド >

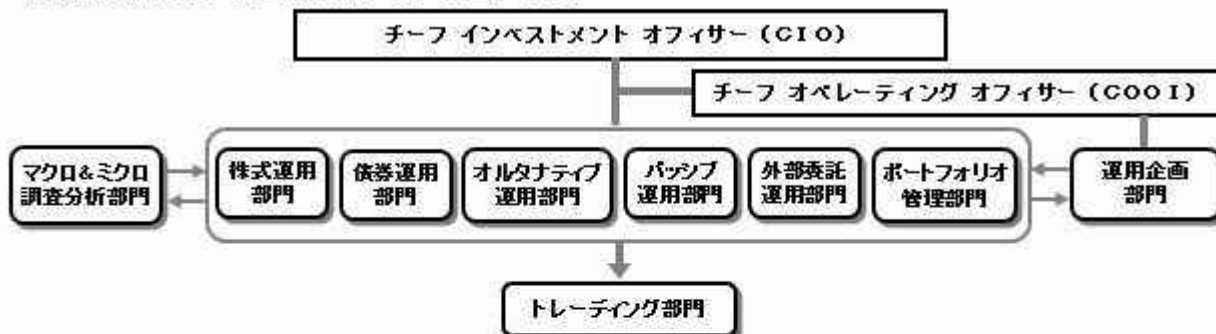
運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。</li> <li>外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないます。</li> <li>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への投資は行ないません。</li> <li>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入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（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

\* FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックス

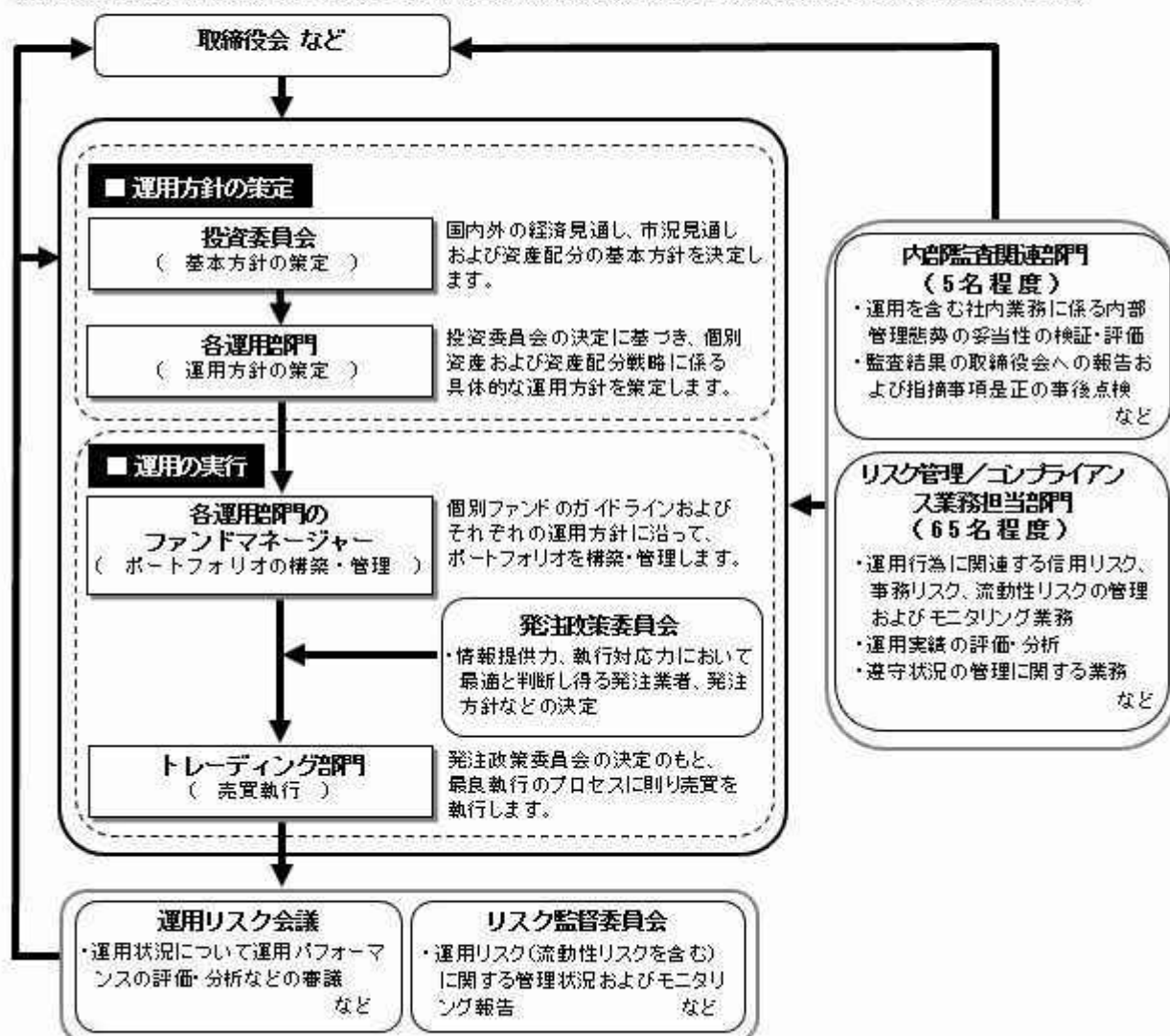
のデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

### （３）【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



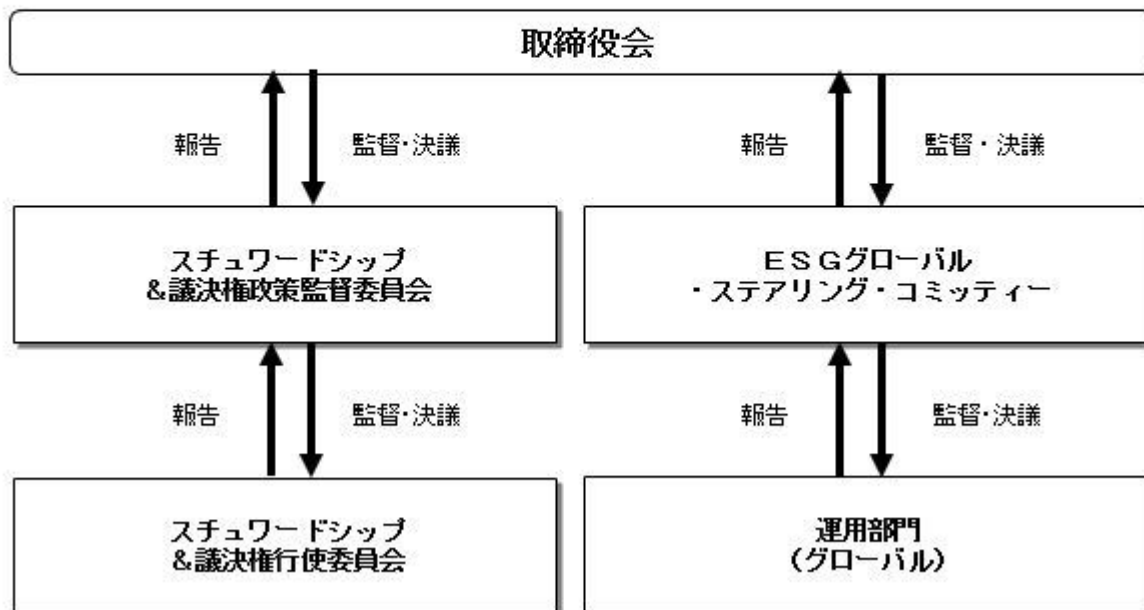
#### 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合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・デューティー

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4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いません。

## 収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

## (5) 【投資制限】

## 約款に定める投資制限

<年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）>

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

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

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

4) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。

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

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

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

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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



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

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

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

財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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

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

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

れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- 14) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 16) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

#### <日本債券インデックスマザーファンド>

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

#### <海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

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

< 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド >

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 3) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうこ

との指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

- ・ 投資者の皆様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、主に株式および債券を実質的な投資対象としますので、株式および債券の価格の下落

や、株式および債券の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 価格変動リスク

- ・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

#### 流動性リスク

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

#### 信用リスク

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

#### 為替変動リスク

- ・外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
- ・「海外株式インデックスMSCI-KOKUSA1（ヘッジあり）マザーファンド」および「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」は原則として為替ヘッジを行ないませんが、為替ヘッジを行なうにあたっては、円の金利が為替ヘッジを行なう通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替および金利の動向によっては、為替ヘッジに伴なうヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。

#### < 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

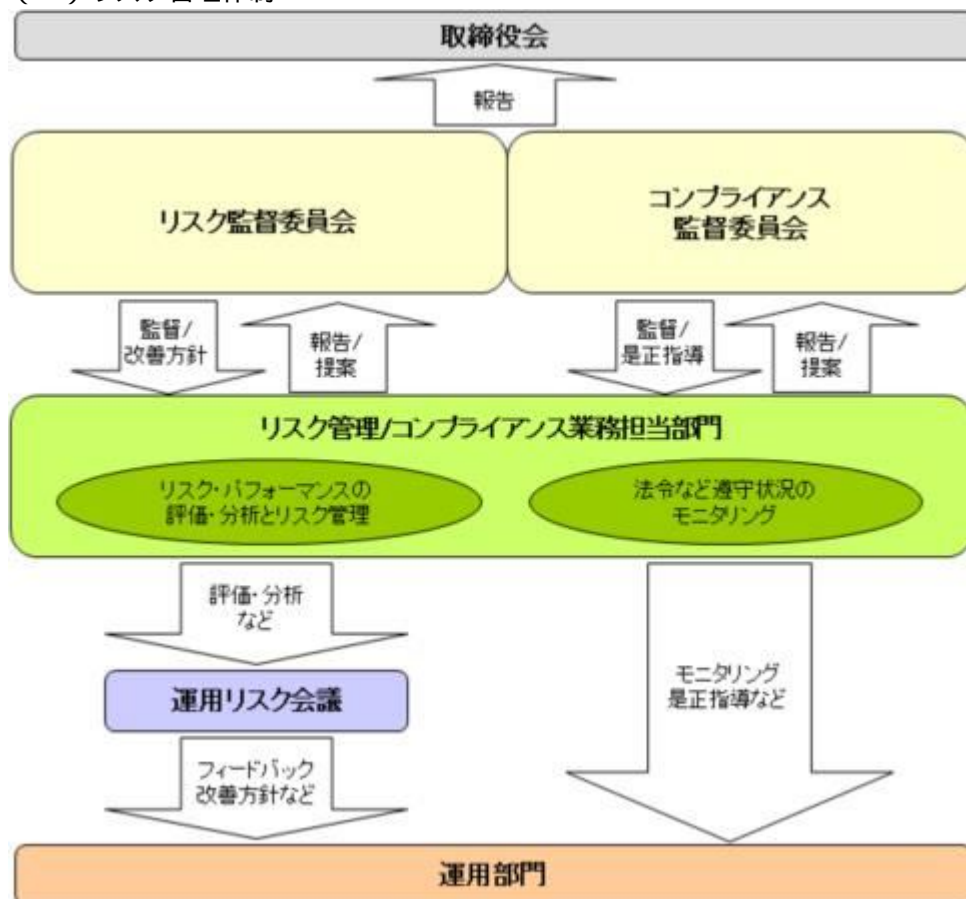
ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴なう資金流入などがあり、その結果、当該



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。

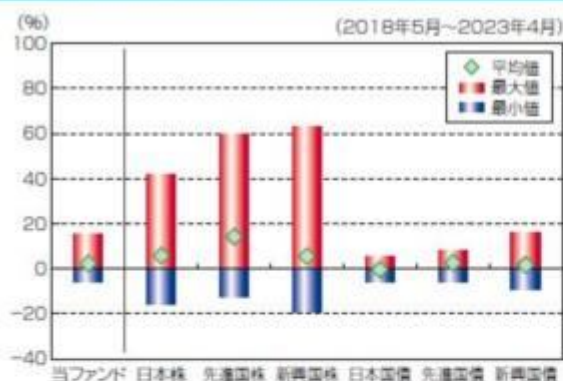
### 法令など遵守状況のモニタリング

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4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	2.3%	5.8%	14.2%	5.5%	-0.4%	2.7%	1.8%
最大値	15.3%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	7.9%	15.7%
最小値	-8.1%	-18.0%	-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。

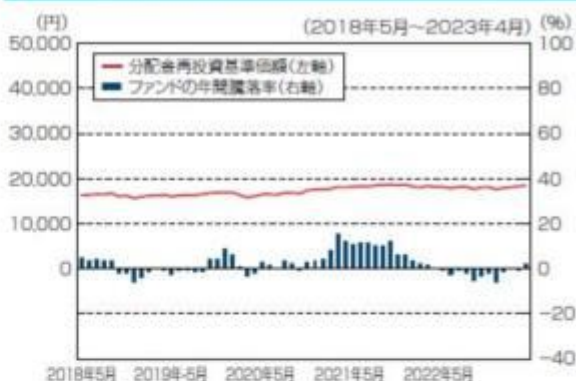
※上記は2018年5月から2023年4月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したもとして計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

#### <各資産クラスの指数>

日本株……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)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

### 当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2018年5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)を再投資したもとして計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

日本国債……NOMURA-BPI国債  
 先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)  
 新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバルディバースファイド(円ヘッジなし、円ベース)

## 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

### 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J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社に帰属します。

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

#### FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

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

当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権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1.1%（税抜1%）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。
  - ・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。
- 申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

#### （2）【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

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

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

#### （3）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.671%（税抜0.61%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.61%	0.17%	0.40%	0.04%

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

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

#### 支払時期

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

#### （４）【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

#### <投資対象とするマザーファンドに係る費用>

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

#### （５）【課税上の取扱い】

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

2024年1月1日以降、公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISAの適用対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 確定拠出年金の場合

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

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

#### 確定拠出年金でない場合

##### 個人受益者の場合

##### 1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

##### 2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）\*については譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%および

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せん。)を控除した利益

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

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

2024年1月1日以降、NISAをご利用の場合、一定の額を上限として、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無期限で非課税となります。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、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。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。

## &lt;分配金に関するイメージ図&gt;

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7月26日現在のもので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## 【年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）】

以下の運用状況は2023年 4月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	4,299,997,924	95.11
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		220,850,115	4.89
合計（純資産総額）		4,520,848,039	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
------	----	-----	--------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------

日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	1,471,276,253	1.3538	1,991,914,676	1.3747	2,022,563,464	44.74
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	662,630,580	1.9132	1,267,744,826	2.0812	1,379,066,763	30.50
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	51,057,370	4.4044	224,877,081	4.4667	228,057,954	5.04
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	96,600,465	2.1821	210,796,284	2.3283	224,914,862	4.98
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	87,089,325	2.6378	229,724,222	2.5735	224,124,377	4.96
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	163,819,134	1.3414	219,761,995	1.3507	221,270,504	4.89

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.11
合計	95.11

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (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12計算期間末 (2013年10月28日)	2,855	2,858	1.3161	1.3171
第13計算期間末 (2014年10月27日)	3,118	3,120	1.3794	1.3804
第14計算期間末 (2015年10月26日)	3,504	3,506	1.5181	1.5191
第15計算期間末 (2016年10月26日)	3,531	3,533	1.4905	1.4915
第16計算期間末 (2017年10月26日)	3,783	3,785	1.6356	1.6366
第17計算期間末 (2018年10月26日)	3,745	3,747	1.5921	1.5931
第18計算期間末 (2019年10月28日)	4,092	4,094	1.6670	1.6680
第19計算期間末 (2020年10月26日)	4,113	4,115	1.6837	1.6847
第20計算期間末 (2021年10月26日)	4,541	4,543	1.8625	1.8635
第21計算期間末 (2022年10月26日)	4,335	4,337	1.7869	1.7879
2022年 4月末日	4,389		1.8096	
5月末日	4,407		1.8099	
6月末日	4,368		1.7812	

7月末日	4,428		1.8171
8月末日	4,415		1.8156
9月末日	4,264		1.7597
10月末日	4,374		1.7998
11月末日	4,415		1.8088
12月末日	4,282		1.7583
2023年 1月末日	4,362		1.7880
2月末日	4,395		1.8024
3月末日	4,474		1.8250
4月末日	4,520		1.8454

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第12期	2012年10月27日～2013年10月28日	0.0010
第13期	2013年10月29日～2014年10月27日	0.0010
第14期	2014年10月28日～2015年10月26日	0.0010
第15期	2015年10月27日～2016年10月26日	0.0010
第16期	2016年10月27日～2017年10月26日	0.0010
第17期	2017年10月27日～2018年10月26日	0.0010
第18期	2018年10月27日～2019年10月28日	0.0010
第19期	2019年10月29日～2020年10月26日	0.0010
第20期	2020年10月27日～2021年10月26日	0.0010
第21期	2021年10月27日～2022年10月26日	0.0010
当中間期	2022年10月27日～2023年 4月26日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第12期	2012年10月27日～2013年10月28日	22.84
第13期	2013年10月29日～2014年10月27日	4.89
第14期	2014年10月28日～2015年10月26日	10.13
第15期	2015年10月27日～2016年10月26日	1.75
第16期	2016年10月27日～2017年10月26日	9.80
第17期	2017年10月27日～2018年10月26日	2.60
第18期	2018年10月27日～2019年10月28日	4.77
第19期	2019年10月29日～2020年10月26日	1.06
第20期	2020年10月27日～2021年10月26日	10.68
第21期	2021年10月27日～2022年10月26日	4.01
当中間期	2022年10月27日～2023年 4月26日	2.40

(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12期	2012年10月27日～2013年10月28日	341,443,254	281,539,572
第13期	2013年10月29日～2014年10月27日	263,538,060	172,992,670
第14期	2014年10月28日～2015年10月26日	247,412,143	199,495,601
第15期	2015年10月27日～2016年10月26日	233,869,947	173,144,761
第16期	2016年10月27日～2017年10月26日	230,481,180	286,599,979
第17期	2017年10月27日～2018年10月26日	282,357,045	242,784,664
第18期	2018年10月27日～2019年10月28日	293,438,215	191,187,785
第19期	2019年10月29日～2020年10月26日	307,946,853	319,803,689
第20期	2020年10月27日～2021年10月26日	299,470,215	304,209,193
第21期	2021年10月27日～2022年10月26日	300,139,209	312,155,330
当中間期	2022年10月27日～2023年 4月26日	118,164,895	95,993,051

（参考）

#### 日本株式インデックストップIXマザーファンド

以下の運用状況は2023年 4月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	46,781,562,480	98.63
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		650,887,473	1.37
合計（純資産総額）		47,432,449,953	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	658,560,000	1.39

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

#### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	872,900	2,015.15	1,759,031,098	1,857.00	1,620,975,300	3.42
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	112,400	9,917.74	1,114,754,104	12,830.00	1,442,092,000	3.04
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,900	51,374.00	816,846,714	61,100.00	971,490,000	2.05
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	204,300	4,098.22	837,266,860	4,149.00	847,640,700	1.79
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	980,500	713.85	699,937,640	852.90	836,268,450	1.76
日本	株式	第一三共	医薬品	138,900	4,542.92	631,012,064	4,647.00	645,468,300	1.36
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	141,100	3,837.02	541,403,615	4,512.00	636,643,200	1.34
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	114,400	4,246.04	485,747,207	5,549.00	634,805,600	1.34
日本	株式	日立製作所	電気機器	78,100	6,555.22	511,962,816	7,485.00	584,578,500	1.23
日本	株式	任天堂	その他製品	100,400	6,054.07	607,829,124	5,721.00	574,388,400	1.21
日本	株式	KDDI	情報・通信業	123,200	4,395.19	541,487,592	4,248.00	523,353,600	1.10
日本	株式	三菱商事	卸売業	104,100	4,105.62	427,395,042	5,018.00	522,373,800	1.10
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	33,600	13,110.24	440,504,379	15,495.00	520,632,000	1.10
日本	株式	信越化学工業	化学	132,400	3,101.04	410,578,912	3,863.00	511,461,200	1.08
日本	株式	三井物産	卸売業	119,400	3,316.71	396,015,174	4,229.00	504,942,600	1.06
日本	株式	HOYA	精密機器	34,000	14,663.37	498,554,788	14,210.00	483,140,000	1.02
日本	株式	ダイキン工業	機械	19,200	21,880.80	420,111,500	24,620.00	472,704,000	1.00
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	129,200	3,356.85	433,705,234	3,588.00	463,569,600	0.98
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	121,000	4,602.06	556,849,752	3,824.00	462,704,000	0.98
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	101,400	3,915.08	396,989,500	4,492.00	455,488,800	0.96
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	226,400	1,633.43	369,809,582	1,965.00	444,876,000	0.94
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	154,700	2,660.39	411,562,333	2,720.00	420,784,000	0.89
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	86,500	3,844.20	332,523,978	4,799.00	415,113,500	0.88
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	78,700	6,019.93	473,768,491	5,094.00	400,897,800	0.85
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	256,200	1,472.43	377,238,420	1,531.50	392,370,300	0.83
日本	株式	村田製作所	電気機器	48,200	7,173.48	345,762,153	7,880.00	379,816,000	0.80
日本	株式	ファナック	電気機器	78,000	4,104.03	320,114,718	4,589.00	357,942,000	0.75
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	58,000	5,599.38	324,764,251	6,145.00	356,410,000	0.75
日本	株式	S M C	機械	5,200	58,451.15	303,946,000	67,750.00	352,300,000	0.74
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	150,600	2,040.22	307,257,132	2,048.00	308,428,800	0.65

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.30
		建設業	2.03
		食料品	3.61



繊維製品	0.47
パルプ・紙	0.17
化学	6.11
医薬品	5.52
石油・石炭製品	0.45
ゴム製品	0.76
ガラス・土石製品	0.71
鉄鋼	0.86
非鉄金属	0.71
金属製品	0.55
機械	5.30
電気機器	17.48
輸送用機器	7.23
精密機器	2.52
その他製品	2.34
電気・ガス業	1.25
陸運業	3.06
海運業	0.59
空運業	0.48
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	8.42
卸売業	6.14
小売業	4.55
銀行業	5.90
証券、商品先物取引業	0.70
保険業	2.15
その他金融業	1.11
不動産業	1.88
サービス業	5.04
合 計	98.63

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2023年06月	買建	32	日本円	633,174,700	658,560,000	1.39

(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 4月28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	182,491,033,452	67.03
	カナダ	9,751,604,462	3.58
	ドイツ	7,235,243,136	2.66
	イタリア	1,553,288,599	0.57
	フランス	9,769,415,034	3.59
	オランダ	5,171,057,350	1.90
	スペイン	2,190,471,273	0.80
	ベルギー	675,386,551	0.25
	オーストリア	151,316,469	0.06
	ルクセンブルク	165,070,068	0.06
	フィンランド	998,677,586	0.37
	アイルランド	5,163,066,001	1.90
	ポルトガル	162,171,475	0.06
	イギリス	11,854,867,092	4.35
	スイス	9,226,639,770	3.39
	スウェーデン	2,630,630,050	0.97
	ノルウェー	539,553,087	0.20
	デンマーク	2,563,286,121	0.94
	ケイマン	509,724,646	0.19
	オーストラリア	5,676,003,924	2.08
	バミューダ	175,296,644	0.06
	ニュージーランド	222,760,248	0.08
	香港	1,784,460,436	0.66
	シンガポール	921,685,681	0.34
	イスラエル	614,303,739	0.23
	ジャージー	850,345,350	0.31
アラブ首長国連邦	0	0.00	
マン島	59,703,434	0.02	
小計		263,107,061,678	96.64
投資証券	アメリカ	4,978,144,264	1.83
	カナダ	13,598,322	0.00
	フランス	106,490,148	0.04
	ベルギー	30,302,367	0.01
	イギリス	110,466,667	0.04

	オーストラリア	336,824,759	0.12
	香港	90,731,692	0.03
	シンガポール	126,057,505	0.05
	小計	5,792,615,724	2.13
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		3,355,602,127	1.23
合計（純資産総額）		272,255,279,529	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,924,998,059	1.07
	買建	ドイツ	624,099,630	0.23

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		2,445,906,795	0.90
	売建		70,881,781	0.03

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	630,154	20,397.14	12,853,345,094	22,588.83	14,234,443,659	5.23
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	280,594	33,612.97	9,431,599,949	40,886.84	11,472,604,200	4.21
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	363,810	15,948.05	5,802,062,618	14,730.15	5,358,978,273	1.97
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	97,410	18,206.80	1,773,524,992	36,518.23	3,557,241,154	1.31
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	236,860	13,950.86	3,304,401,007	14,431.04	3,418,137,721	1.26
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	216,810	14,019.26	3,039,517,409	14,535.66	3,151,478,201	1.16
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	89,120	18,481.77	1,647,095,584	31,998.05	2,851,666,466	1.05
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	162,981	14,231.19	2,319,414,066	15,670.40	2,553,978,750	0.94
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	36,975	72,186.08	2,669,080,434	65,786.74	2,432,464,752	0.89

アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	106,345	29,366.42	3,122,972,168	21,486.28	2,284,958,946	0.84
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	103,451	22,883.91	2,367,364,336	21,863.19	2,261,768,869	0.83
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	51,525	39,003.66	2,009,663,721	43,757.22	2,254,591,271	0.83
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	116,140	16,542.25	1,921,217,252	18,382.51	2,134,945,466	0.78
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	64,442	26,251.92	1,691,726,460	30,717.11	1,979,472,086	0.73
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	93,749	17,647.48	1,654,433,987	20,987.32	1,967,540,366	0.72
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	108,980	16,247.66	1,770,670,074	17,064.09	1,859,645,182	0.68
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	33,980	42,106.08	1,430,764,924	50,120.35	1,703,089,734	0.63
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	31,984	47,137.30	1,507,639,592	52,357.64	1,674,606,934	0.62
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	72,631	23,470.06	1,704,654,465	22,393.00	1,626,426,237	0.60
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	40,410	39,064.02	1,578,577,097	39,424.83	1,593,157,417	0.59
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	100,373	13,190.34	1,323,954,418	15,446.41	1,550,402,591	0.57
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	65,675	16,167.62	1,061,809,021	22,179.64	1,456,648,382	0.54
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	耐久消費財・アパレル	10,984	98,260.06	1,079,288,605	129,845.88	1,426,227,190	0.52
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	70,036	20,144.98	1,410,874,149	19,967.93	1,398,474,163	0.51
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	162,652	7,925.74	1,289,137,739	8,541.39	1,389,275,533	0.51
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	54,551	23,924.76	1,305,120,025	25,443.11	1,387,947,623	0.51
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	16,490	63,057.19	1,039,813,155	82,947.33	1,367,801,526	0.50
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	15,957	74,128.06	1,182,861,600	83,524.16	1,332,795,149	0.49
イギリス	株式	ASTRAZENECA PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	61,412	16,498.43	1,013,201,983	19,775.99	1,214,483,344	0.45
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	59,012	18,829.16	1,111,146,945	20,304.59	1,198,215,020	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	5.25
		素材	4.25
		資本財	6.61
		商業・専門サービス	1.53
		運輸	1.79
		自動車・自動車部品	1.69
		耐久消費財・アパレル	1.83
		消費者サービス	2.15
		メディア・娯楽	5.45
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.16
		生活必需品流通・小売り	1.84
		食品・飲料・タバコ	4.33
		家庭用品・パーソナル用品	1.90
		ヘルスケア機器・サービス	4.80
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.88
		銀行	5.46
		金融サービス	6.52
		保険	3.20
		ソフトウェア・サービス	8.71
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.59
電気通信サービス	1.44		
公益事業	3.13		
半導体・半導体製造装置	4.84		
不動産管理・開発	0.31		
投資証券		2.13	
合計		98.77	

### 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	105	米ドル	21,077,937.5	2,827,183,756	21,807,187.5	2,924,998,059	1.07
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2306	買建	105	ユーロ	4,020,140	595,141,526	4,215,750	624,099,630	0.23

(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	15,000,000.00	1,979,715,890	1,996,559,950	0.73
	ユーロ	買建	3,050,000.00	438,840,165	449,346,845	0.17
	英ポンド	売建	81,000.00	13,493,385	13,572,667	0.00
	スイスフラン	売建	234,000.00	35,100,234	35,113,174	0.01
	香港ドル	売建	1,300,000.00	22,133,800	22,195,940	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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

以下の運用状況は2023年 4月28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	12,868,470,815	64.39
	カナダ	691,085,712	3.46
	ドイツ	505,317,230	2.53
	イタリア	110,606,893	0.55
	フランス	695,017,886	3.48
	オランダ	365,019,436	1.83
	スペイン	150,572,859	0.75
	ベルギー	50,636,172	0.25
	オーストリア	10,495,237	0.05
	ルクセンブルク	12,839,919	0.06
	フィンランド	71,524,441	0.36
	アイルランド	358,164,999	1.79
	ポルトガル	10,242,147	0.05
	イギリス	835,373,571	4.18
	スイス	645,963,386	3.23
	スウェーデン	181,839,464	0.91
	ノルウェー	37,606,208	0.19
	デンマーク	184,718,979	0.92
	ケイマン	39,822,115	0.20
	オーストラリア	401,175,055	2.01
	バミューダ	9,463,596	0.05
ニュージーランド	12,926,181	0.06	
香港	121,578,681	0.61	
シンガポール	60,149,473	0.30	
イスラエル	42,763,210	0.21	

	ジャージー	60,985,139	0.31
	マン島	3,979,428	0.02
	小計	18,538,338,232	92.76
投資証券	アメリカ	357,511,836	1.79
	フランス	2,495,217	0.01
	イギリス	8,481,470	0.04
	オーストラリア	22,883,683	0.11
	香港	5,818,814	0.03
	シンガポール	6,379,944	0.03
	小計	403,570,964	2.02
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,043,959,364	5.22
合計（純資産総額）		19,985,868,560	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	919,285,104	4.60
	買建	ドイツ	196,145,598	0.98

(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	売建		19,164,492,382	95.89

(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	44,390	20,174.49	895,545,757	22,588.83	1,002,718,310	5.02
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	19,760	33,413.12	660,243,337	40,886.84	807,924,115	4.04
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	25,650	15,608.70	400,363,363	14,730.15	377,828,517	1.89
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	6,850	18,281.91	125,231,146	36,518.23	250,149,902	1.25
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	16,660	13,799.29	229,896,245	14,431.04	240,421,238	1.20
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	15,370	13,881.11	213,352,718	14,535.66	223,413,219	1.12

アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	6,290	18,107.54	113,896,489	31,998.05	201,267,752	1.01
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	11,440	14,275.45	163,311,215	15,670.40	179,269,466	0.90
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サービス	2,600	72,065.36	187,369,953	65,786.74	171,045,527	0.86
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	7,490	28,514.69	213,575,078	21,486.28	160,932,272	0.81
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	7,270	23,016.70	167,331,467	21,863.18	158,945,391	0.80
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	金融サービス	3,610	39,293.38	141,849,115	43,757.22	157,963,600	0.79
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	8,150	16,721.98	136,284,194	18,382.51	149,817,509	0.75
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	4,530	26,396.78	119,577,431	30,717.11	139,148,514	0.70
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	6,570	17,851.36	117,283,447	20,987.32	137,886,700	0.69
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	7,620	16,267.17	123,955,844	17,064.09	130,028,411	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	2,390	42,509.82	101,598,471	50,120.35	119,787,653	0.60
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	2,250	47,351.91	106,541,806	52,357.64	117,804,702	0.59
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	5,100	23,553.22	120,121,463	22,393.00	114,204,318	0.57
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	2,840	39,467.75	112,088,417	39,424.83	111,966,520	0.56
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	7,060	13,298.98	93,890,866	15,446.41	109,051,660	0.55
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	4,630	16,305.45	75,494,266	22,179.64	102,691,770	0.51
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	耐久消費財・アパレル	770	98,969.18	76,206,270	129,845.88	99,981,331	0.50
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	4,930	20,269.72	99,929,747	19,967.93	98,441,910	0.49
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	11,360	7,968.66	90,524,015	8,541.39	97,030,286	0.49
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	3,810	23,947.57	91,240,242	25,443.11	96,938,286	0.49
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	1,160	63,310.33	73,439,987	82,947.33	96,218,907	0.48
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	1,120	74,817.93	83,796,088	83,524.16	93,547,068	0.47
イギリス	株式	ASTRAZENECA PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,340	16,758.29	72,730,996	19,775.99	85,827,814	0.43
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	4,140	18,864.04	78,097,139	20,304.59	84,061,042	0.42



## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	5.03
		素材	4.09
		資本財	6.33
		商業・専門サービス	1.49
		運輸	1.73
		自動車・自動車部品	1.64
		耐久消費財・アパレル	1.76
		消費者サービス	2.07
		メディア・娯楽	5.22
		一般消費財・サービス流通・小売り	3.99
		生活必需品流通・小売り	1.76
		食品・飲料・タバコ	4.14
		家庭用品・パーソナル用品	1.84
		ヘルスケア機器・サービス	4.63
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.51
		銀行	5.26
		金融サービス	6.22
		保険	3.08
		ソフトウェア・サービス	8.38
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.35
電気通信サービス	1.33		
公益事業	2.99		
半導体・半導体製造装置	4.64		
不動産管理・開発	0.29		
投資証券			2.02
合計			94.78

## 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	33	米ドル	6,520,925	874,651,670	6,853,687.5	919,285,104	4.60
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2306	買建	33	ユーロ	1,254,920	185,778,357	1,324,950	196,145,598	0.98

(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	売建	103,785,000.00	13,653,708,479	13,796,186,800	69.03
	加ドル	売建	6,948,000.00	682,318,558	679,199,786	3.40
	ユーロ	売建	14,253,000.00	2,057,190,399	2,097,221,774	10.49
	英ポンド	売建	5,307,000.00	864,457,744	881,969,193	4.41
	スイスフラン	売建	4,007,000.00	592,537,429	599,672,478	3.00
	スウェーデンクローナ	売建	15,238,000.00	194,756,890	197,317,941	0.99
	ノルウェークローネ	売建	3,064,000.00	39,031,683	38,481,738	0.19
	デンマーククローネ	売建	9,458,000.00	183,567,727	186,863,904	0.93
	豪ドル	売建	4,946,000.00	442,132,827	436,896,476	2.19
	ニュージーランドドル	売建	103,000.00	8,434,797	8,388,667	0.04
	香港ドル	売建	8,954,000.00	151,215,608	151,881,963	0.76
	シンガポールドル	売建	674,000.00	66,918,209	67,286,965	0.34
	イスラエルシケル	売建	631,000.00	23,124,609	23,124,697	0.12

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2023年 4月28日現在です。

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

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	43,078,574,640	86.60
地方債証券	日本	3,145,325,796	6.32
特殊債券	日本	3,223,517,010	6.48
社債券	日本	201,247,000	0.40
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		93,712,258	0.19
合計（純資産総額）		49,742,376,704	100.00

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （%）	償還期限	投資 比率 （%）
------	----	-----	--------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------	------	-----------------

日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	700,000,000	100.99	706,944,000	100.91	706,377,000	0.300	2025/12/20	1.42
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	700,000,000	100.30	702,136,000	100.40	702,842,000	0.100	2026/9/20	1.41
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	680,000,000	100.14	681,005,400	100.30	682,101,200	0.100	2027/6/20	1.37
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	660,000,000	100.23	661,547,700	100.40	662,640,000	0.100	2026/12/20	1.33
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	660,000,000	100.17	661,122,000	100.36	662,428,800	0.100	2027/3/20	1.33
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	645,000,000	100.33	647,173,700	100.40	647,631,600	0.100	2026/6/20	1.30
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	630,000,000	100.36	632,294,900	100.40	632,545,200	0.100	2026/3/20	1.27
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	620,000,000	101.21	627,551,600	101.07	626,671,200	0.400	2025/9/20	1.26
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	590,000,000	99.94	589,646,000	100.13	590,814,200	0.100	2027/12/20	1.19
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	590,000,000	98.91	583,569,000	99.35	586,188,600	0.100	2030/3/20	1.18
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	570,000,000	101.11	576,338,400	100.97	575,546,100	0.400	2025/6/20	1.16
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	580,000,000	98.53	571,485,600	99.01	574,310,200	0.100	2030/9/20	1.15
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	560,000,000	99.12	555,072,000	99.47	557,060,000	0.100	2029/12/20	1.12
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	540,000,000	99.83	539,082,000	100.02	540,129,600	0.100	2028/3/20	1.09
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	535,000,000	99.74	533,646,450	99.97	534,860,900	0.100	2028/6/20	1.08
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	520,000,000	99.64	518,128,000	99.91	519,578,800	0.100	2028/9/20	1.04
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	500,000,000	100.04	500,240,000	100.21	501,090,000	0.100	2027/9/20	1.01
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	490,000,000	101.00	494,929,400	100.81	493,983,700	0.500	2024/9/20	0.99
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	500,000,000	97.74	488,735,500	98.48	492,445,000	0.100	2031/6/20	0.99
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	500,000,000	97.55	487,764,000	98.36	491,815,000	0.100	2031/9/20	0.99
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	460,000,000	97.91	450,395,500	98.83	454,654,800	0.100	2030/12/20	0.91
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	420,000,000	98.68	414,493,800	99.22	416,749,200	0.100	2030/6/20	0.84
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	400,000,000	99.54	398,172,000	99.86	399,440,000	0.100	2028/12/20	0.80
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	400,000,000	100.00	400,000,000	98.96	395,852,000	0.200	2032/3/20	0.80
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	400,000,000	98.36	393,448,000	98.64	394,596,000	0.100	2031/3/20	0.79
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	390,000,000	101.01	393,970,200	100.86	393,385,200	0.400	2025/3/20	0.79
日本	国債証券	第117回利付国債(20年)	343,000,000	113.55	389,493,650	113.01	387,651,740	2.100	2030/3/20	0.78
日本	国債証券	第144回利付国債(20年)	330,000,000	110.86	365,838,000	110.61	365,036,100	1.500	2033/3/20	0.73
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	318,000,000	112.91	359,053,800	112.37	357,349,320	1.700	2032/9/20	0.72
日本	国債証券	第145回利付国債(20年)	315,000,000	112.87	355,543,650	112.66	354,891,600	1.700	2033/6/20	0.71

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	86.60
地方債証券	6.32
特殊債券	6.48
社債券	0.40
合 計	99.81

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2023年 4月28日現在です。

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

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	73,597,903,287	49.04
	カナダ	3,050,225,689	2.03
	メキシコ	1,321,411,336	0.88
	ドイツ	9,813,210,594	6.54
	イタリア	11,315,612,106	7.54
	フランス	12,396,188,388	8.26
	オランダ	2,308,202,139	1.54
	スペイン	7,584,324,959	5.05
	ベルギー	2,805,973,734	1.87
	オーストリア	1,829,951,018	1.22
	フィンランド	787,488,139	0.52
	アイルランド	902,553,259	0.60
	イギリス	7,172,938,444	4.78
	スウェーデン	310,206,341	0.21
	ノルウェー	242,576,374	0.16
	デンマーク	478,857,019	0.32
	ポーランド	719,932,443	0.48
	オーストラリア	2,337,771,665	1.56
	ニュージーランド	352,110,351	0.23
シンガポール	668,780,158	0.45	

	マレーシア	820,835,267	0.55
	中国	7,415,274,494	4.94
	イスラエル	437,155,692	0.29
	小計	148,669,482,896	99.05
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,420,976,736	0.95
合計（純資産総額）		150,090,459,632	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		40,215,000	0.03

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,100,000	11,397.46	923,194,421	11,718.03	949,160,987	0.500	2027/8/31	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,190,000	11,780.48	847,017,206	12,048.64	866,297,675	1.750	2029/11/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	13,863.63	847,068,063	14,048.02	858,334,085	4.125	2032/11/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	11,187.28	783,109,622	11,681.62	817,713,591	0.375	2027/7/31	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,930,000	11,042.92	765,274,557	11,669.83	808,719,489	1.625	2031/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,130,000	10,609.68	756,470,398	11,256.96	802,621,604	1.250	2031/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,830,000	10,657.57	727,912,137	11,315.12	772,822,898	1.375	2031/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	12,416.45	744,987,357	12,681.04	760,862,906	0.375	2024/9/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,240,000	11,107.30	693,095,851	11,761.52	733,919,121	1.875	2032/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,740,000	12,609.57	723,789,758	12,687.59	728,268,109	1.125	2025/2/28	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	10,512.43	642,310,007	11,109.21	678,772,883	0.875	2030/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,190,000	12,875.90	668,259,266	12,990.69	674,217,329	2.250	2024/10/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,580,000	11,441.28	638,423,926	11,977.65	668,352,970	1.500	2028/11/30	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,828.80	641,440,047	13,182.72	659,136,301	3.250	2027/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,911.84	645,592,317	13,115.92	655,796,149	3.000	2025/7/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,886.95	644,347,945	13,087.36	654,368,402	2.875	2025/6/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,980,000	12,667.38	630,836,021	13,138.45	654,294,942	3.250	2029/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	12,092.77	616,731,574	12,592.50	642,217,580	2.750	2032/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,449.46	622,473,226	12,709.60	635,480,168	0.375	2024/8/15	0.42
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	1,969.55	630,259,151	1,966.63	629,323,991	3.020	2025/10/22	0.42
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	1,960.59	627,390,529	1,955.61	625,797,620	2.940	2024/10/17	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	12,132.30	582,350,419	12,738.68	611,456,751	2.875	2032/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	12,195.87	590,280,350	12,577.04	608,728,989	1.625	2026/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,730,000	12,544.82	593,370,111	12,827.75	606,752,721	2.000	2025/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,650,000	12,830.89	596,636,697	12,982.57	603,689,922	2.250	2024/11/15	0.40

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,620,000	12,905.82	596,248,927	13,045.71	602,712,003	2.375	2024/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	11,999.90	577,195,614	12,516.00	602,019,871	2.375	2029/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,640,000	12,778.50	592,922,501	12,949.30	600,847,911	1.750	2024/7/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	12,503.43	587,661,254	12,764.87	599,949,345	0.250	2024/6/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,530,000	12,688.38	574,783,776	12,896.38	584,206,466	2.000	2025/2/15	0.39

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.05
合計	99.05

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	300,000.00	40,218,000	40,215,000	0.03

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド

以下の運用状況は2023年 4月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	10,742,291,862	49.45
	カナダ	434,450,569	2.00
	メキシコ	175,877,995	0.81
	ドイツ	1,419,820,329	6.54
	イタリア	1,628,793,469	7.50
	フランス	1,779,637,039	8.19
	オランダ	329,361,352	1.52
	スペイン	1,082,885,853	4.98
	ベルギー	412,428,463	1.90
	オーストリア	277,478,778	1.28
	フィンランド	102,204,348	0.47
	アイルランド	139,072,061	0.64
	イギリス	1,017,464,114	4.68

	スウェーデン	54,522,224	0.25
	ノルウェー	39,868,052	0.18
	デンマーク	65,490,966	0.30
	ポーランド	119,544,711	0.55
	オーストラリア	343,123,257	1.58
	ニュージーランド	34,137,598	0.16
	シンガポール	87,583,108	0.40
	マレーシア	250,351,540	1.15
	中国	1,054,721,749	4.86
	イスラエル	92,686,470	0.43
	小計	21,683,795,907	99.81
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		40,516,719	0.19
合計（純資産総額）		21,724,312,626	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		21,844,584,827	100.55

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（％）	償還期限	投資比率（％）
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	12,241.19	489,647,853	12,635.72	505,429,084	2.000	2026/11/15	2.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,800,000	12,830.89	487,574,074	12,982.57	493,338,000	2.250	2024/11/15	2.27
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	12,685.17	405,925,600	12,869.66	411,829,399	2.250	2025/11/15	1.90
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,830,000	12,905.82	365,234,732	13,045.71	369,193,716	2.375	2024/8/15	1.70
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,650,000	12,688.38	336,242,165	12,896.38	341,754,334	2.000	2025/2/15	1.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,800,000	11,451.08	320,630,295	11,709.39	327,862,970	0.625	2027/11/30	1.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,300,000	12,544.82	288,530,921	12,827.75	295,038,321	2.000	2025/8/15	1.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	11,232.11	269,570,785	11,760.47	282,251,437	1.500	2030/2/15	1.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,950,000	13,907.85	271,203,241	14,048.02	273,936,410	4.125	2032/11/15	1.26
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,100,000	12,195.87	256,113,375	12,577.04	264,117,949	1.625	2026/5/15	1.22
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,100,000	10,605.03	222,705,798	10,988.18	230,751,803	0.625	2030/5/15	1.06
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	12,858.14	218,588,411	13,009.03	221,153,647	2.000	2024/6/30	1.02
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	12,259.27	196,148,359	12,623.41	201,974,629	1.625	2026/2/15	0.93
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,750,000	10,656.62	186,490,999	11,315.12	198,014,652	1.375	2031/11/15	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	12,454.18	186,812,700	12,930.44	193,956,696	2.875	2028/8/15	0.89
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	12,342.05	185,130,836	12,753.09	191,296,363	2.375	2027/5/15	0.88
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	12,235.43	183,531,493	12,662.44	189,936,725	2.250	2027/8/15	0.87
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	11,844.83	177,672,476	12,254.55	183,818,353	0.375	2025/11/30	0.85

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,350,000	6,795.02	159,683,107	7,683.65	180,565,962	1.250	2050/5/15	0.83
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	12,655.16	164,517,151	12,891.15	167,584,955	2.125	2025/5/15	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,400,000	11,245.96	157,443,471	11,791.91	165,086,783	1.125	2028/8/31	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	12,988.60	155,863,252	13,102.44	157,229,303	2.500	2024/5/15	0.72
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	12,622.30	151,467,644	12,823.56	153,882,738	1.750	2025/3/15	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,270,000	11,084.10	140,768,187	11,300.45	143,515,746	2.875	2052/5/15	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	12,907.59	141,983,580	13,027.63	143,304,020	2.000	2024/5/31	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	9,951.10	129,364,362	11,008.09	143,105,182	2.750	2047/8/15	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,800,000	7,031.86	126,573,659	7,928.86	142,719,558	1.375	2050/8/15	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	12,208.35	134,291,860	12,738.68	140,125,504	2.875	2032/5/15	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	12,320.57	135,526,313	12,722.70	139,949,722	2.250	2027/2/15	0.64
ドイツ	国債証券	BUNDESREP. DEUTSCHLAND	1,000,000	14,345.84	143,458,459	13,934.20	139,342,058	1.700	2032/8/15	0.64

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.81
合計	99.81

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	80,693,000.00	10,590,969,428	10,755,599,025	49.51
	加ドル	売建	4,451,000.00	438,613,384	436,069,303	2.01
	メキシコペソ	売建	24,371,000.00	175,220,879	176,567,604	0.81
	ユーロ	売建	49,164,000.00	7,080,704,831	7,249,680,047	33.37
	英ポンド	売建	6,133,000.00	990,806,954	1,022,692,971	4.71
	スウェーデンクローナ	売建	4,275,000.00	54,998,239	55,520,576	0.26
	ノルウェークローネ	売建	3,190,000.00	41,091,436	40,130,585	0.18
	デンマーククローネ	売建	3,356,000.00	65,205,722	66,280,293	0.31
	ポーランドズロチ	売建	3,745,000.00	112,313,694	120,125,095	0.55
	豪ドル	売建	3,912,000.00	351,155,101	345,656,112	1.59
	ニュージーランドドル	売建	434,000.00	35,816,119	35,666,262	0.16
	シンガポールドドル	売建	886,000.00	88,432,354	88,437,976	0.41
	マレーシアリングット	売建	9,996,000.00	301,299,432	299,255,250	1.38
	中国元	売建	54,847,000.00	1,062,101,084	1,058,403,566	4.87
	イスラエルシェケル	売建	2,566,000.00	95,706,416	94,500,162	0.43

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

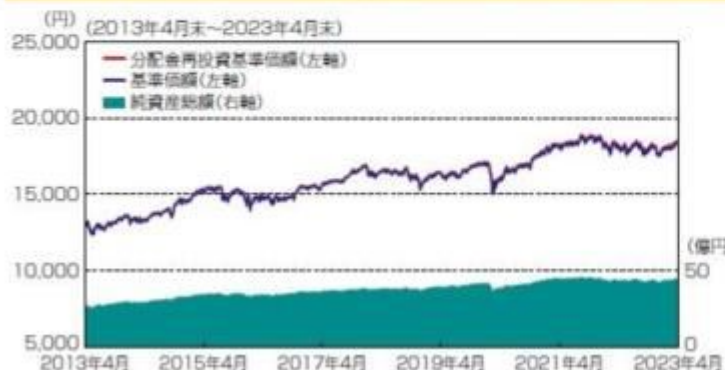


## 参考情報

## 運用実績

2023年4月28日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 18,454円

純資産総額……………45.20億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2013年4月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

## 分配の推移(税引前、1万口当たり)

2018年10月	2019年10月	2020年10月	2021年10月	2022年10月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	180円

## 主要な資産の状況

## &lt;資産構成比率&gt;

組入資産	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	30.50%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	5.04%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	4.98%
日本債券インデックスマザーファンド	44.74%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	4.96%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	4.89%
現金その他	4.89%

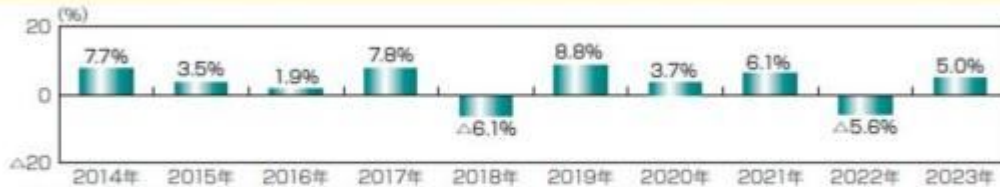
※当ファンドの対純資産総額比です。

## &lt;組入上位銘柄&gt;

組入資産	銘柄	業種・種類	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.42%
	2 ソニーグループ	電気機器	3.04%
	3 キーエンス	電気機器	2.05%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.23%
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.21%
	3 AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	1.97%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.02%
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.04%
	3 AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	1.89%
日本債券インデックスマザーファンド	1 第341回利付国債(10年)	国債証券	1.42%
	2 第344回利付国債(10年)	国債証券	1.41%
	3 第347回利付国債(10年)	国債証券	1.37%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン0.500%)	国債証券	0.63%
	2 US TREASURY N/B(クーポン1.750%)	国債証券	0.58%
	3 US TREASURY N/B(クーポン4.125%)	国債証券	0.57%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン2.000%)	国債証券	2.33%
	2 US TREASURY N/B(クーポン2.250%)	国債証券	2.27%
	3 US TREASURY N/B(クーポン2.250%)	国債証券	1.90%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

## 年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2023年は、2023年4月末までの騰落率です。

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### (1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。なお、確定拠出年金制度上の取得申込みを行なう場合は、当該規定に従うものとします。

#### (2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

#### (3) 取扱時間

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

#### (4) 申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、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。

#### (5) 申込単位

販売会社の照会先にお問い合わせください。ただし、確定拠出年金制度上の取得申込みを行なう場合は、1円以上1円単位とします。

#### (6) 申込代金の支払い

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

#### (7) 受付の中止および取消

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

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

### 2【換金（解約）手続等】

#### <解約請求による換金>

#### (1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

#### (2) 取扱時間

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

#### (3) 解約制限

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

#### (4) 解約価額

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

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

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

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関でない場合、解約価額から解約に係る所定の税金が差し引かれます。

税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、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。

(6) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。

(7) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(8) 受付の中止および取消

- ・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
- ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

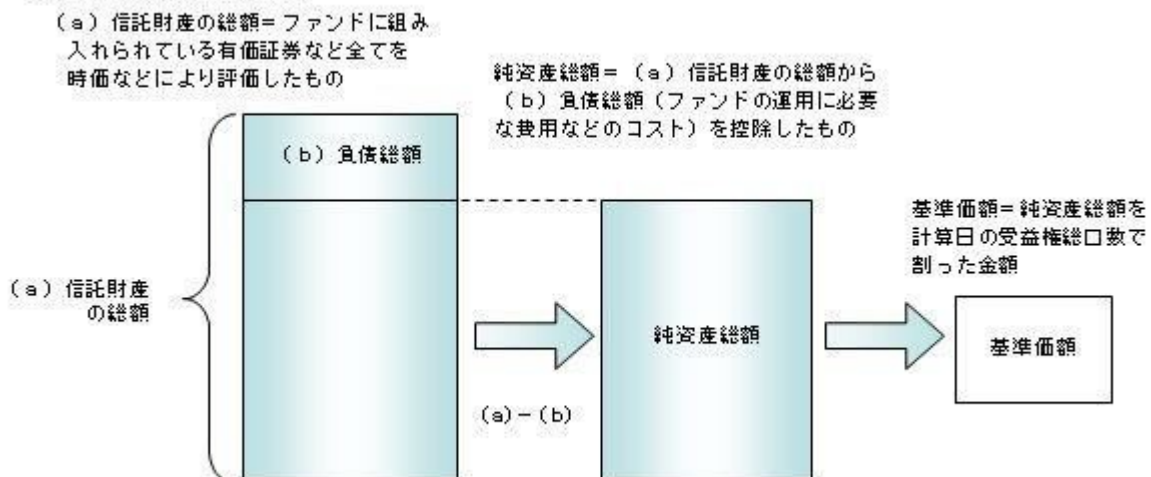
### 3【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

##### 基準価額の算出

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

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

公社債（国内・外国）

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

・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）

・価格情報会社の提供する価額

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

\*外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

・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/](http://www.nikkoam.com/)

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします（2001年10月17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10月27日から翌年10月26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、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。

2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。

3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べるすることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）

4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。

イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合



ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）

二) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

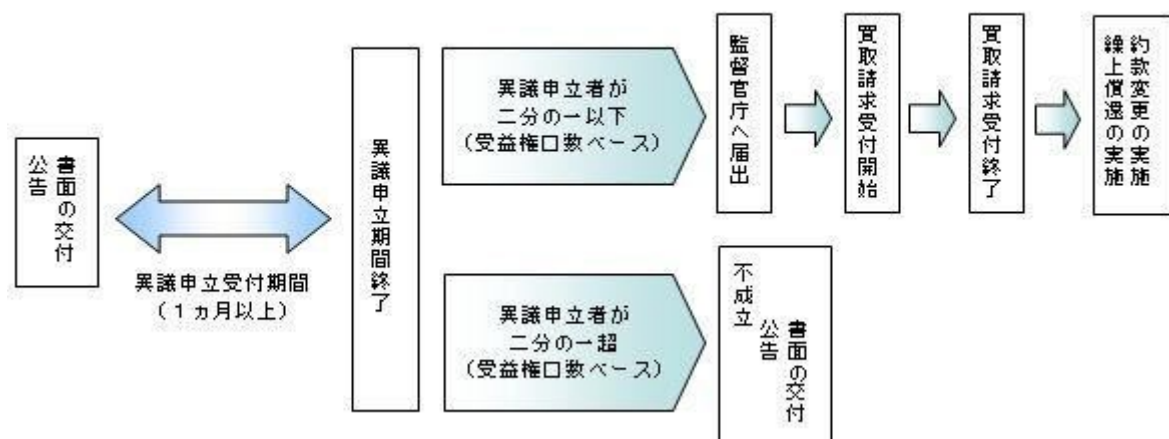
信託約款の変更

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

異議の申立て

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

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

- ・ 委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・ 交付運用報告書は、原則として知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/](http://www.nikkoam.com/)

関係法人との契約について

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

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

##### (1) 収益分配金・償還金受領権

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

##### (2) 解約請求権

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

##### (3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第21期計算期間（2021年10月27日から2022年10月26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】

## 【年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第20期 2021年10月26日現在	第21期 2022年10月26日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	240,963,691	228,483,648
親投資信託受益証券	4,318,650,635	4,124,158,899
未収入金	610,084	-
流動資産合計	4,560,224,410	4,352,642,547
<b>資産合計</b>	4,560,224,410	4,352,642,547
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,438,244	2,426,228
未払解約金	1,292,812	60,224
未払受託者報酬	996,927	964,597
未払委託者報酬	14,207,138	13,746,457
未払利息	96	371
その他未払費用	99,640	96,401
流動負債合計	19,034,857	17,294,278
<b>負債合計</b>	19,034,857	17,294,278
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,438,244,210	2,426,228,089
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,102,945,343	1,909,120,180
(分配準備積立金)	1,090,516,684	996,424,761
元本等合計	4,541,189,553	4,335,348,269
<b>純資産合計</b>	4,541,189,553	4,335,348,269
<b>負債純資産合計</b>	4,560,224,410	4,352,642,547



## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第20期		第21期	
	自	2020年10月27日 至 2021年10月26日	自	2021年10月27日 至 2022年10月26日
営業収益				
有価証券売買等損益		472,333,573		151,945,535
営業収益合計		472,333,573		151,945,535
営業費用				
支払利息		29,051		38,698
受託者報酬		1,956,406		1,940,384
委託者報酬		27,880,573		27,652,234
その他費用		195,532		193,928
営業費用合計		30,061,562		29,825,244
営業利益又は営業損失 ( )		442,272,011		181,770,779
経常利益又は経常損失 ( )		442,272,011		181,770,779
当期純利益又は当期純損失 ( )		442,272,011		181,770,779
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 ( )		37,135,339		13,340,751
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		1,670,225,726		2,102,945,343
剰余金増加額又は欠損金減少額		239,214,940		244,576,755
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		239,214,940		244,576,755
剰余金減少額又は欠損金増加額		209,193,751		267,545,662
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		209,193,751		267,545,662
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		2,438,244		2,426,228
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		2,102,945,343		1,909,120,180

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

		第20期 2021年10月26日現在	第21期 2022年10月26日現在
1.	期首元本額	2,442,983,188円	2,438,244,210円
	期中追加設定元本額	299,470,215円	300,139,209円
	期中一部解約元本額	304,209,193円	312,155,330円
2.	受益権の総数	2,438,244,210口	2,426,228,089口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第20期 自 2020年10月27日 至 2021年10月26日		第21期 自 2021年10月27日 至 2022年10月26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	57,631,654円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 38,875,817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	347,102,898円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	1,255,251,203円	C 信託約款に定める収益調整金 1,375,832,518円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	688,220,376円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 959,975,172円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	2,348,206,131円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 2,374,683,507円
F	分配対象収益(1万口当たり)	9,630円	F 分配対象収益(1万口当たり) 9,787円
G	分配金額	2,438,244円	G 分配金額 2,426,228円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり) 10円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	第20期 自 2020年10月27日 至 2021年10月26日	第21期 自 2021年10月27日 至 2022年10月26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20期 2021年10月26日現在	第21期 2022年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、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つた場合、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20期(2021年10月26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	403,097,249
合計	403,097,249

第21期(2022年10月26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	143,549,469
合計	143,549,469

(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20期 2021年10月26日現在		第21期 2022年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.8625円	1口当たり純資産額	1.7869円
(1万口当たり純資産額)	(18,625円)	(1万口当たり純資産額)	(17,869円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	51,457,152	227,291,386	
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI (ヘッジあり)マザーファンド	103,003,896	224,579,394	

日本債券インデックスマザーファンド	1,423,718,543	1,927,572,535	
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	82,606,618	218,477,983	
海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	160,237,873	214,911,035	
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	685,625,100	1,311,326,566	
合計	2,506,649,182	4,124,158,899	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

（参考）

## 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	2021年10月26日現在	2022年10月26日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	386,683,019	148,573,517
株式	41,021,026,450	43,156,227,610
派生商品評価勘定	1,881,150	21,683,500
未収配当金	338,895,356	453,000,178
前払金	16,455,000	-
流動資産合計	41,764,940,975	43,779,484,805
資産合計	41,764,940,975	43,779,484,805
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,546,500	-

前受金	-	18,700,000
未払解約金	3,366,714	9,624,321
未払利息	154	241
流動負債合計	12,913,368	28,324,562
負債合計	12,913,368	28,324,562
純資産の部		
元本等		
元本	21,309,131,563	22,875,362,128
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	20,442,896,044	20,875,798,115
元本等合計	41,752,027,607	43,751,160,243
純資産合計	41,752,027,607	43,751,160,243
負債純資産合計	41,764,940,975	43,779,484,805

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2021年10月26日現在	2022年10月26日現在
1.	期首	2020年10月27日	2021年10月27日
	期首元本額	22,017,538,384円	21,309,131,563円
	期首からの追加設定元本額	2,456,144,995円	3,195,854,871円
	期首からの一部解約元本額	3,164,551,816円	1,629,624,306円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	700,290,293円	812,653,264円
	DCインデックスバランス（株式40）	1,832,450,915円	2,151,421,241円
	DCインデックスバランス（株式60）	3,596,095,059円	4,264,520,991円
	DCインデックスバランス（株式80）	3,970,867,945円	4,651,930,057円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,406,433,104円	1,697,661,452円

世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	3,083,752,587円	3,238,040,982円
インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	636,617,068円	600,774,622円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	43,960,093円	-円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	38,865,552円	-円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	46,430,665円	-円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	40,636,155円	-円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	2,907,194,622円	2,446,891,512円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	243,584,625円	245,697,725円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	691,194,107円	685,625,100円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,045,621,245円	1,049,367,499円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,025,137,528円	1,030,777,683円
計	21,309,131,563円	22,875,362,128円
2. 受益権の総数	21,309,131,563口	22,875,362,128口
3. 担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	630,570,000円	530,690,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2020年10月27日 至 2021年10月26日	自 2021年10月27日 至 2022年10月26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10月26日現在	2022年10月26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10月26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	7,556,941,566
合計	7,556,941,566

(2022年10月26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	1,858,734,739
合計	1,858,734,739

(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10月26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	755,415,000	-	747,770,000	7,645,000
	合計	755,415,000	-	747,770,000	7,645,000

(2022年10月26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	553,850,000	-	575,550,000	21,700,000
	合計	553,850,000	-	575,550,000	21,700,000

(注) 1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2021年10月26日現在		2022年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.9593円	1口当たり純資産額	1.9126円
(1万口当たり純資産額)	(19,593円)	(1万口当たり純資産額)	(19,126円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	800	3,630.00	2,904,000	
日本水産	22,100	538.00	11,889,800	
マルハニチロ	3,200	2,346.00	7,507,200	
雪国まいたけ	1,700	1,058.00	1,798,600	
カネコ種苗	700	1,423.00	996,100	
サカタのタネ	2,600	4,755.00	12,363,000	
ホクト	1,800	1,902.00	3,423,600	
ホクリヨウ	300	635.00	190,500	
住石ホールディングス	4,500	215.00	967,500	
日鉄鉱業	900	2,971.00	2,673,900	
三井松島ホールディングス	1,000	3,145.00	3,145,000	
I N P E X	75,800	1,490.00	112,942,000	
石油資源開発	2,800	3,895.00	10,906,000	
K & O エナジーグループ	900	2,031.00	1,827,900	
ショーボンドホールディングス	2,800	6,360.00	17,808,000	
ミライト・ワン	7,700	1,446.00	11,134,200	
サンヨーホームズ	400	711.00	284,400	
日本アクア	1,000	706.00	706,000	
ファーストコーポレーション	700	718.00	502,600	
ベステラ	600	939.00	563,400	
キャンディル	500	506.00	253,000	
ダイセキ環境ソリューション	500	814.00	407,000	
第一カッター興業	600	1,216.00	729,600	
安藤・間	10,900	855.00	9,319,500	
東急建設	6,500	629.00	4,088,500	
コムシスホールディングス	7,700	2,452.00	18,880,400	

ビーアールホールディングス	3,100	343.00	1,063,300	
高松コンストラクショングループ	1,600	1,940.00	3,104,000	
東建コーポレーション	700	7,900.00	5,530,000	
ソネック	300	955.00	286,500	
ヤマウラ	1,100	974.00	1,071,400	
オリエンタル白石	8,300	267.00	2,216,100	
大成建設	15,400	4,010.00	61,754,000	
大林組	51,300	953.00	48,888,900	
清水建設	47,500	740.00	35,150,000	
飛島建設	1,600	1,061.00	1,697,600	
長谷工コーポレーション	14,800	1,537.00	22,747,600	
松井建設	1,900	563.00	1,069,700	
銭高組	200	2,761.00	552,200	
鹿島建設	37,600	1,393.00	52,376,800	
不動テトラ	1,200	1,495.00	1,794,000	
大末建設	600	1,217.00	730,200	
鉄建建設	1,100	1,785.00	1,963,500	
西松建設	3,400	3,745.00	12,733,000	
三井住友建設	12,500	440.00	5,500,000	
大豊建設	800	4,185.00	3,348,000	
ナカノフドー建設	1,500	307.00	460,500	
奥村組	2,800	2,841.00	7,954,800	
東鉄工業	2,200	2,450.00	5,390,000	
イチケン	400	1,805.00	722,000	
富士ピー・エス	900	440.00	396,000	
浅沼組	1,300	2,762.00	3,590,600	
戸田建設	21,200	755.00	16,006,000	
熊谷組	2,800	2,527.00	7,075,600	
北野建設	400	2,406.00	962,400	
植木組	500	1,293.00	646,500	
矢作建設工業	2,300	754.00	1,734,200	
ピーエス三菱	1,900	614.00	1,166,600	
日本ハウスホールディングス	3,000	451.00	1,353,000	
新日本建設	2,500	743.00	1,857,500	
東亜道路工業	300	6,010.00	1,803,000	
日本道路	500	6,110.00	3,055,000	
東亜建設工業	1,300	2,430.00	3,159,000	
日本国土開発	4,400	574.00	2,525,600	
若築建設	900	2,457.00	2,211,300	
東洋建設	6,200	910.00	5,642,000	
五洋建設	20,400	733.00	14,953,200	
福田組	600	4,855.00	2,913,000	

住友林業	11,000	2,315.00	25,465,000
日本基礎技術	1,500	425.00	637,500
巴コーポレーション	2,100	361.00	758,100
大和ハウス工業	43,700	3,035.00	132,629,500
ライト工業	3,100	2,029.00	6,289,900
積水ハウス	52,400	2,478.00	129,847,200
日特建設	1,200	883.00	1,059,600
北陸電気工事	1,100	696.00	765,600
ユアテック	3,300	715.00	2,359,500
日本リーテック	1,100	789.00	867,900
四電工	600	1,840.00	1,104,000
中電工	2,200	2,093.00	4,604,600
関電工	9,100	832.00	7,571,200
きんでん	11,200	1,505.00	16,856,000
東京エネシス	1,700	948.00	1,611,600
トーエネック	600	3,520.00	2,112,000
住友電設	1,400	2,586.00	3,620,400
日本電設工業	2,400	1,694.00	4,065,600
エクシオグループ	7,700	2,201.00	16,947,700
新日本空調	1,200	1,860.00	2,232,000
九電工	3,500	2,896.00	10,136,000
三機工業	3,500	1,620.00	5,670,000
日揮ホールディングス	15,600	1,787.00	27,877,200
中外炉工業	500	1,638.00	819,000
ヤマト	1,400	704.00	985,600
太平電業	1,000	3,280.00	3,280,000
高砂熱学工業	4,300	1,845.00	7,933,500
三晃金属工業	300	2,630.00	789,000
朝日工業社	700	2,017.00	1,411,900
明星工業	2,900	711.00	2,061,900
大気社	2,300	3,595.00	8,268,500
ダイダン	1,100	2,148.00	2,362,800
日比谷総合設備	1,500	1,903.00	2,854,500
フィル・カンパニー	300	1,018.00	305,400
テスホールディングス	1,600	993.00	1,588,800
インフロニア・ホールディングス	19,300	1,023.00	19,743,900
東洋エンジニアリング	2,400	586.00	1,406,400
レイズネクスト	2,400	1,246.00	2,990,400
ニッポン	4,300	1,567.00	6,738,100
日清製粉グループ本社	16,600	1,609.00	26,709,400
日東富士製粉	300	4,465.00	1,339,500
昭和産業	1,400	2,519.00	3,526,600

鳥越製粉	1,300	623.00	809,900
中部飼料	1,800	1,034.00	1,861,200
フィード・ワン	2,100	687.00	1,442,700
東洋精糖	300	866.00	259,800
日本甜菜製糖	900	1,645.00	1,480,500
D M三井製糖ホールディングス	1,400	1,881.00	2,633,400
塩水港精糖	2,200	200.00	440,000
日新製糖	800	1,699.00	1,359,200
森永製菓	3,600	3,880.00	13,968,000
中村屋	400	3,110.00	1,244,000
江崎グリコ	4,100	3,400.00	13,940,000
名糖産業	600	1,629.00	977,400
井村屋グループ	900	2,229.00	2,006,100
不二家	1,000	2,550.00	2,550,000
山崎製パン	9,600	1,486.00	14,265,600
第一屋製パン	300	401.00	120,300
モロゾフ	500	3,775.00	1,887,500
亀田製菓	900	4,570.00	4,113,000
寿スピリッツ	1,500	7,490.00	11,235,000
カルビー	8,000	3,030.00	24,240,000
森永乳業	2,900	4,280.00	12,412,000
六甲バター	1,100	1,396.00	1,535,600
ヤクルト本社	11,200	8,240.00	92,288,000
明治ホールディングス	9,700	6,170.00	59,849,000
雪印メグミルク	3,900	1,640.00	6,396,000
プリマハム	2,200	2,027.00	4,459,400
日本ハム	6,200	3,620.00	22,444,000
林兼産業	600	447.00	268,200
丸大食品	1,600	1,403.00	2,244,800
S Foods	1,600	2,677.00	4,283,200
柿安本店	600	2,249.00	1,349,400
伊藤ハム米久ホールディングス	11,300	670.00	7,571,000
サッポロホールディングス	4,700	3,275.00	15,392,500
アサヒグループホールディングス	33,300	4,329.00	144,155,700
キリンホールディングス	65,000	2,193.00	142,545,000
宝ホールディングス	9,800	1,055.00	10,339,000
オエノンホールディングス	4,300	284.00	1,221,200
養命酒製造	500	1,818.00	909,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,300	1,345.00	15,198,500
サントリー食品インターナショナル	10,100	5,070.00	51,207,000
ダイトーグループホールディングス	900	4,600.00	4,140,000
伊藤園	5,400	5,170.00	27,918,000

キーコーヒー	1,600	2,065.00	3,304,000
ユニカフェ	500	934.00	467,000
ジャパンフーズ	300	1,064.00	319,200
日清オイリオグループ	2,000	3,215.00	6,430,000
不二製油グループ本社	3,800	2,335.00	8,873,000
J・オイルミルズ	1,700	1,570.00	2,669,000
キッコーマン	10,600	8,170.00	86,602,000
味の素	35,200	4,069.00	143,228,800
ブルドックソース	600	1,737.00	1,042,200
キューピー	7,700	2,378.00	18,310,600
ハウス食品グループ本社	5,500	2,795.00	15,372,500
カゴメ	6,700	2,977.00	19,945,900
焼津水産化学工業	800	817.00	653,600
アリアケジャパン	1,600	5,140.00	8,224,000
ピエトロ	200	1,793.00	358,600
エバラ食品工業	400	3,195.00	1,278,000
やまみ	200	1,331.00	266,200
ニチレイ	6,600	2,289.00	15,107,400
東洋水産	7,900	5,860.00	46,294,000
イトアンドホールディングス	700	2,180.00	1,526,000
大冷	200	1,870.00	374,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	900	465.00	418,500
日清食品ホールディングス	5,700	9,710.00	55,347,000
永谷園ホールディングス	800	2,025.00	1,620,000
一正蒲鉾	800	743.00	594,400
フジッコ	1,700	1,909.00	3,245,300
ロック・フィールド	1,800	1,441.00	2,593,800
日本たばこ産業	94,700	2,457.50	232,725,250
ケンコーマヨネーズ	900	1,676.00	1,508,400
わらべや日洋ホールディングス	1,100	1,795.00	1,974,500
なとり	1,000	2,071.00	2,071,000
イフジ産業	300	919.00	275,700
ファーマフーズ	2,200	1,270.00	2,794,000
ユーグレナ	9,300	878.00	8,165,400
紀文食品	1,400	883.00	1,236,200
ピックルスホールディングス	800	1,010.00	808,000
ミヨシ油脂	600	998.00	598,800
理研ビタミン	1,300	1,857.00	2,414,100
片倉工業	1,400	2,070.00	2,898,000
ゲンゼ	1,000	3,805.00	3,805,000
東洋紡	6,900	1,036.00	7,148,400
ユニチカ	4,700	271.00	1,273,700

富士紡ホールディングス	700	3,400.00	2,380,000
倉敷紡績	1,200	2,130.00	2,556,000
シキボウ	900	848.00	763,200
日本毛織	4,200	993.00	4,170,600
ダイトウボウ	3,100	86.00	266,600
トーア紡コーポレーション	700	354.00	247,800
ダイドーリミテッド	2,500	166.00	415,000
帝国繊維	1,600	1,608.00	2,572,800
帝人	15,100	1,366.00	20,626,600
東レ	106,900	728.90	77,919,410
住江織物	300	1,767.00	530,100
日本フェルト	1,000	404.00	404,000
イチカワ	200	1,329.00	265,800
日東製網	200	1,336.00	267,200
アツギ	1,200	376.00	451,200
ダイニック	600	594.00	356,400
セーレン	3,200	2,383.00	7,625,600
ソトー	600	811.00	486,600
東海染工	200	1,139.00	227,800
小松マテーレ	2,600	774.00	2,012,400
ワコールホールディングス	3,500	2,407.00	8,424,500
ホギメディカル	2,200	3,295.00	7,249,000
クラウディアホールディングス	400	295.00	118,000
T S Iホールディングス	5,200	455.00	2,366,000
マツオカコーポレーション	500	935.00	467,500
ワールド	2,300	1,381.00	3,176,300
三陽商会	700	1,146.00	802,200
ナイガイ	700	263.00	184,100
オンワードホールディングス	9,500	311.00	2,954,500
ルックホールディングス	500	2,018.00	1,009,000
ゴールドウイン	2,900	7,810.00	22,649,000
デサント	2,900	3,770.00	10,933,000
キング	800	468.00	374,400
ヤマトインターナショナル	1,300	242.00	314,600
特種東海製紙	900	2,916.00	2,624,400
王子ホールディングス	66,400	524.00	34,793,600
日本製紙	7,000	877.00	6,139,000
三菱製紙	2,300	280.00	644,000
北越コーポレーション	10,300	788.00	8,116,400
中越パルプ工業	700	942.00	659,400
巴川製紙所	500	784.00	392,000
大王製紙	7,400	1,120.00	8,288,000

阿波製紙	400	299.00	119,600
レンゴー	13,300	835.00	11,105,500
トーモク	800	1,441.00	1,152,800
ザ・パック	1,100	2,387.00	2,625,700
北の達人コーポレーション	6,300	287.00	1,808,100
クラレ	23,300	1,026.00	23,905,800
旭化成	106,700	963.10	102,762,770
共和レザー	1,000	525.00	525,000
昭和電工	14,100	2,171.00	30,611,100
住友化学	117,600	510.00	59,976,000
住友精化	700	3,005.00	2,103,500
日産化学	7,700	6,780.00	52,206,000
ラサ工業	600	2,177.00	1,306,200
クレハ	1,300	9,370.00	12,181,000
多木化学	600	5,210.00	3,126,000
テイカ	1,000	1,291.00	1,291,000
石原産業	3,100	1,035.00	3,208,500
片倉コープアグリ	400	1,201.00	480,400
日本曹達	1,900	4,565.00	8,673,500
東ソー	21,300	1,648.00	35,102,400
トクヤマ	5,100	1,758.00	8,965,800
セントラル硝子	2,600	3,350.00	8,710,000
東亜合成	7,500	1,153.00	8,647,500
大阪ソーダ	1,300	3,685.00	4,790,500
関東電化工業	3,200	928.00	2,969,600
デンカ	5,800	3,425.00	19,865,000
信越化学工業	27,300	15,455.00	421,921,500
日本カーバイド工業	600	1,256.00	753,600
堺化学工業	1,100	1,959.00	2,154,900
第一稀元素化学工業	1,500	1,291.00	1,936,500
エア・ウォーター	13,800	1,658.00	22,880,400
日本酸素ホールディングス	14,200	2,366.00	33,597,200
日本化学工業	500	1,870.00	935,000
東邦アセチレン	400	1,080.00	432,000
日本パーカライズニング	7,300	959.00	7,000,700
高圧ガス工業	2,500	628.00	1,570,000
四国化成工業	2,000	1,277.00	2,554,000
戸田工業	400	2,916.00	1,166,400
ステラ ケミファ	900	2,670.00	2,403,000
保土谷化学工業	500	2,915.00	1,457,500
日本触媒	2,400	5,260.00	12,624,000
大日精化工業	1,200	1,761.00	2,113,200



カネカ	3,700	3,715.00	13,745,500
三菱瓦斯化学	13,400	1,905.00	25,527,000
三井化学	13,400	2,794.00	37,439,600
J S R	14,800	2,834.00	41,943,200
東京応化工業	2,600	6,250.00	16,250,000
大阪有機化学工業	1,100	1,971.00	2,168,100
三菱ケミカルグループ	107,000	675.00	72,225,000
K Hネオケム	2,500	2,707.00	6,767,500
ダイセル	23,200	847.00	19,650,400
住友ベークライト	2,400	4,010.00	9,624,000
積水化学工業	32,900	1,798.00	59,154,200
日本ゼオン	12,500	1,326.00	16,575,000
アイカ工業	4,100	3,185.00	13,058,500
U B E	8,100	1,947.00	15,770,700
積水樹脂	2,400	1,704.00	4,089,600
タキロンシーアイ	3,800	522.00	1,983,600
旭有機材	1,000	2,358.00	2,358,000
ニチバン	900	1,680.00	1,512,000
リケンテクノス	3,500	515.00	1,802,500
大倉工業	700	1,859.00	1,301,300
積水化成成品工業	2,100	381.00	800,100
群栄化学工業	300	2,399.00	719,700
タイガースポリマー	900	399.00	359,100
ミライアル	600	1,560.00	936,000
ダイキアクシス	600	679.00	407,400
ダイキョーニシカワ	3,700	602.00	2,227,400
竹本容器	600	739.00	443,400
森六ホールディングス	800	1,725.00	1,380,000
恵和	500	3,615.00	1,807,500
日本化薬	12,100	1,175.00	14,217,500
カーリットホールディングス	1,400	682.00	954,800
日本精化	1,100	2,050.00	2,255,000
扶桑化学工業	1,400	3,310.00	4,634,000
トリケミカル研究所	1,800	2,146.00	3,862,800
A D E K A	6,800	2,218.00	15,082,400
日油	5,000	5,190.00	25,950,000
新日本理化	2,500	281.00	702,500
ハリマ化成グループ	1,100	893.00	982,300
花王	36,400	5,619.00	204,531,600
第一工業製薬	600	1,932.00	1,159,200
石原ケミカル	800	1,264.00	1,011,200
日華化学	700	864.00	604,800

ニイタカ	300	2,069.00	620,700
三洋化成工業	1,000	4,215.00	4,215,000
有機合成薬品工業	1,200	316.00	379,200
大日本塗料	2,000	726.00	1,452,000
日本ペイントホールディングス	64,700	955.00	61,788,500
関西ペイント	14,900	1,996.00	29,740,400
神東塗料	1,500	144.00	216,000
中国塗料	3,800	925.00	3,515,000
日本特殊塗料	1,000	860.00	860,000
藤倉化成	2,100	403.00	846,300
太陽ホールディングス	2,600	2,550.00	6,630,000
D I C	5,700	2,476.00	14,113,200
サカタインクス	3,300	1,052.00	3,471,600
東洋インキS Cホールディングス	2,900	1,910.00	5,539,000
T & K T O K A	1,400	957.00	1,339,800
富士フィルムホールディングス	30,900	6,911.00	213,549,900
資生堂	30,600	5,142.00	157,345,200
ライオン	17,600	1,516.00	26,681,600
高砂香料工業	1,000	2,844.00	2,844,000
マンダム	3,400	1,475.00	5,015,000
ミルボン	2,200	5,950.00	13,090,000
ファンケル	7,100	2,806.00	19,922,600
コーセー	3,000	14,290.00	42,870,000
コタ	1,200	1,568.00	1,881,600
ポーラ・オルビスホールディングス	7,500	1,652.00	12,390,000
ノエビアホールディングス	1,300	5,460.00	7,098,000
アジュバンホールディングス	400	917.00	366,800
新日本製薬	800	1,518.00	1,214,400
エステー	1,100	1,516.00	1,667,600
アグロ カネショウ	600	1,302.00	781,200
コニシ	2,700	1,731.00	4,673,700
長谷川香料	3,000	3,160.00	9,480,000
星光P M C	900	524.00	471,600
小林製薬	4,500	7,890.00	35,505,000
荒川化学工業	1,200	1,006.00	1,207,200
メック	1,200	2,405.00	2,886,000
日本高純度化学	400	2,477.00	990,800
タカラバイオ	4,600	1,770.00	8,142,000
J C U	1,800	2,801.00	5,041,800
新田ゼラチン	1,000	994.00	994,000
O A T アグリオ	700	1,721.00	1,204,700
デクセリアルズ	4,600	3,335.00	15,341,000

アース製薬	1,300	5,140.00	6,682,000	
北興化学工業	1,500	960.00	1,440,000	
大成ラミック	500	3,015.00	1,507,500	
クミアイ化学工業	5,800	980.00	5,684,000	
日本農薬	3,200	917.00	2,934,400	
アキレス	1,100	1,362.00	1,498,200	
有沢製作所	2,400	1,250.00	3,000,000	
日東電工	10,600	8,070.00	85,542,000	
レック	2,100	848.00	1,780,800	
三光合成	2,000	457.00	914,000	
きもと	2,800	237.00	663,600	
藤森工業	1,400	3,095.00	4,333,000	
前澤化成工業	1,000	1,343.00	1,343,000	
未来工業	600	1,475.00	885,000	
ウェーブロックホールディングス	700	587.00	410,900	
J S P	1,000	1,466.00	1,466,000	
エフピコ	3,200	3,615.00	11,568,000	
天馬	1,400	2,083.00	2,916,200	
信越ポリマー	3,200	1,333.00	4,265,600	
東リ	4,000	206.00	824,000	
ニフコ	5,900	3,200.00	18,880,000	
バルカー	1,400	2,631.00	3,683,400	
ユニ・チャーム	30,500	4,562.00	139,141,000	
ショーエイコーポレーション	500	578.00	289,000	
協和キリン	17,700	3,455.00	61,153,500	
武田薬品工業	138,400	3,825.00	529,380,000	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	150,600	2,042.50	307,600,500	
住友ファーマ	10,900	1,039.00	11,325,100	
塩野義製薬	20,500	6,917.00	141,798,500	
わかもと製薬	1,900	229.00	435,100	
日本新薬	3,800	7,610.00	28,918,000	
中外製薬	45,900	3,465.00	159,043,500	
科研製薬	2,500	3,785.00	9,462,500	
エーザイ	19,500	8,692.00	169,494,000	
ロート製薬	8,400	4,600.00	38,640,000	
小野薬品工業	34,000	3,487.00	118,558,000	
久光製薬	3,700	3,685.00	13,634,500	
持田製薬	2,000	3,425.00	6,850,000	
参天製薬	30,700	1,009.00	30,976,300	
扶桑薬品工業	600	2,004.00	1,202,400	
日本ケミファ	200	1,737.00	347,400	
ツムラ	5,100	3,150.00	16,065,000	

キッセイ薬品工業	2,600	2,625.00	6,825,000
生化学工業	3,200	902.00	2,886,400
栄研化学	2,700	1,840.00	4,968,000
鳥居薬品	800	3,000.00	2,400,000
JCRファーマ	5,000	2,047.00	10,235,000
東和薬品	2,600	2,236.00	5,813,600
富士製薬工業	1,000	1,044.00	1,044,000
ゼリア新薬工業	2,600	2,178.00	5,662,800
第一三共	127,700	4,541.00	579,885,700
キョーリン製薬ホールディングス	3,200	1,804.00	5,772,800
大幸薬品	2,800	544.00	1,523,200
ダイト	1,100	2,508.00	2,758,800
大塚ホールディングス	33,600	4,685.00	157,416,000
大正製薬ホールディングス	3,300	5,260.00	17,358,000
ペプチドリーム	7,100	1,629.00	11,565,900
あすか製薬ホールディングス	1,700	1,154.00	1,961,800
サワイグループホールディングス	3,400	4,210.00	14,314,000
日本コークス工業	15,100	86.00	1,298,600
ニチレキ	1,900	1,330.00	2,527,000
ユシロ化学工業	800	848.00	678,400
ビーピー・カストロール	600	987.00	592,200
富士石油	3,900	308.00	1,201,200
MORESCO	600	1,044.00	626,400
出光興産	17,900	3,265.00	58,443,500
ENEOSホールディングス	264,900	490.30	129,880,470
コスモエネルギーホールディングス	7,000	3,820.00	26,740,000
横浜ゴム	8,300	2,331.00	19,347,300
TOYO TIRE	8,400	1,709.00	14,355,600
ブリヂストン	46,800	5,252.00	245,793,600
住友ゴム工業	14,400	1,252.00	18,028,800
藤倉コンポジット	1,400	858.00	1,201,200
オカモト	800	3,635.00	2,908,000
フコク	800	1,010.00	808,000
ニッタ	1,600	2,890.00	4,624,000
住友理工	3,400	573.00	1,948,200
三ツ星ベルト	2,200	3,055.00	6,721,000
バンドー化学	2,800	1,055.00	2,954,000
日東紡績	2,200	2,198.00	4,835,600
AGC	14,900	4,625.00	68,912,500
日本板硝子	8,000	539.00	4,312,000
石塚硝子	300	1,514.00	454,200
日本山村硝子	600	591.00	354,600

日本電気硝子	6,000	2,551.00	15,306,000
オハラ	700	1,226.00	858,200
住友大阪セメント	2,600	3,250.00	8,450,000
太平洋セメント	10,000	2,037.00	20,370,000
日本ヒューム	1,500	642.00	963,000
日本コンクリート工業	3,200	251.00	803,200
三谷セキサン	700	3,740.00	2,618,000
アジアパイルホールディングス	2,500	509.00	1,272,500
東海カーボン	12,300	967.00	11,894,100
日本カーボン	900	4,150.00	3,735,000
東洋炭素	900	3,575.00	3,217,500
ノリタケカンパニーリミテド	900	4,100.00	3,690,000
TOTO	10,600	4,525.00	47,965,000
日本碍子	17,300	1,870.00	32,351,000
日本特殊陶業	12,300	2,734.00	33,628,200
ダントーホールディングス	1,200	237.00	284,400
MARUWA	600	16,560.00	9,936,000
品川リフラクトリーズ	400	3,905.00	1,562,000
黒崎播磨	300	4,650.00	1,395,000
ヨータイ	1,100	1,402.00	1,542,200
東京窯業	1,800	255.00	459,000
ニッカトー	700	421.00	294,700
フジインコーポレーテッド	1,300	6,230.00	8,099,000
クニミネ工業	600	735.00	441,000
エーアンドエーマテリアル	300	855.00	256,500
ニチアス	3,700	2,274.00	8,413,800
ニチハ	2,300	2,758.00	6,343,400
日本製鉄	72,700	2,065.00	150,125,500
神戸製鋼所	30,400	609.00	18,513,600
合同製鐵	900	1,702.00	1,531,800
JFEホールディングス	40,300	1,378.00	55,533,400
東京製鐵	5,200	1,255.00	6,526,000
共英製鋼	1,800	1,447.00	2,604,600
大和工業	2,800	4,330.00	12,124,000
東京鐵鋼	700	1,338.00	936,600
大阪製鐵	1,000	1,072.00	1,072,000
淀川製鋼所	1,900	2,442.00	4,639,800
丸一鋼管	5,100	2,869.00	14,631,900
モリ工業	400	2,628.00	1,051,200
大同特殊鋼	2,400	3,645.00	8,748,000
日本高周波鋼業	800	314.00	251,200
日本冶金工業	1,200	2,771.00	3,325,200

山陽特殊製鋼	1,500	1,890.00	2,835,000
愛知製鋼	1,000	2,066.00	2,066,000
日立金属	18,800	2,178.00	40,946,400
日本金属	500	951.00	475,500
大太平洋金属	1,100	2,018.00	2,219,800
新日本電工	9,800	339.00	3,322,200
栗本鐵工所	700	1,630.00	1,141,000
虹技	300	918.00	275,400
日本鑄鉄管	200	946.00	189,200
三菱製鋼	1,200	919.00	1,102,800
日亜鋼業	2,200	226.00	497,200
日本精線	300	4,625.00	1,387,500
エンビプロ・ホールディングス	1,200	771.00	925,200
シンニッタン	2,400	215.00	516,000
新家工業	400	1,939.00	775,600
大紀アルミニウム工業所	2,200	1,284.00	2,824,800
日本軽金属ホールディングス	4,400	1,468.00	6,459,200
三井金属鉱業	4,700	3,005.00	14,123,500
東邦亜鉛	900	2,120.00	1,908,000
三菱マテリアル	10,100	1,960.00	19,796,000
住友金属鉱山	19,100	4,209.00	80,391,900
D O W Aホールディングス	4,100	4,820.00	19,762,000
古河機械金属	2,700	1,286.00	3,472,200
エス・サイエンス	8,400	26.00	218,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,000	3,400.00	6,800,000
東邦チタニウム	3,100	2,167.00	6,717,700
U A C J	2,400	2,125.00	5,100,000
C Kサンエツ	300	4,235.00	1,270,500
古河電気工業	5,000	2,262.00	11,310,000
住友電気工業	60,800	1,543.00	93,814,400
フジクラ	19,400	868.00	16,839,200
昭和電線ホールディングス	1,500	1,754.00	2,631,000
タツタ電線	3,100	447.00	1,385,700
カナレ電気	300	1,394.00	418,200
平河ヒューテック	1,000	1,082.00	1,082,000
リョービ	1,600	1,293.00	2,068,800
アーレスティ	1,900	367.00	697,300
アサヒホールディングス	7,000	1,921.00	13,447,000
稲葉製作所	900	1,377.00	1,239,300
宮地エンジニアリンググループ	500	3,255.00	1,627,500
トーカロ	4,500	1,173.00	5,278,500
アルファC o	600	949.00	569,400

SUMCO	28,700	1,872.00	53,726,400
川田テクノロジーズ	300	3,725.00	1,117,500
RS Technologies	500	6,490.00	3,245,000
ジェイテックコーポレーション	200	1,538.00	307,600
信和	1,100	795.00	874,500
東洋製罐グループホールディングス	8,900	1,711.00	15,227,900
ホッカンホールディングス	800	1,302.00	1,041,600
コロナ	800	845.00	676,000
横河ブリッジホールディングス	2,500	1,975.00	4,937,500
駒井ハルテック	300	1,586.00	475,800
高田機工	200	2,385.00	477,000
三和ホールディングス	16,400	1,265.00	20,746,000
文化シャッター	5,100	1,069.00	5,451,900
三協立山	2,100	535.00	1,123,500
アルインコ	1,100	971.00	1,068,100
東洋シャッター	400	508.00	203,200
LIXIL	25,100	2,241.00	56,249,100
日本フィルコン	1,100	451.00	496,100
ノーリツ	2,200	1,526.00	3,357,200
長府製作所	1,500	2,038.00	3,057,000
リンナイ	3,000	10,150.00	30,450,000
ダイニチ工業	900	678.00	610,200
日東精工	2,200	532.00	1,170,400
三洋工業	200	1,651.00	330,200
岡部	2,500	653.00	1,632,500
ジーテクト	1,900	1,314.00	2,496,600
東プレ	2,700	1,157.00	3,123,900
高周波熱錬	2,700	676.00	1,825,200
東京製綱	1,100	885.00	973,500
サンコール	1,500	670.00	1,005,000
モリテック スチール	1,400	329.00	460,600
パイオラックス	2,300	1,834.00	4,218,200
エイチワン	1,500	594.00	891,000
日本発條	14,600	829.00	12,103,400
中央発條	900	678.00	610,200
アドバネクス	200	1,147.00	229,400
立川ブラインド工業	700	1,029.00	720,300
三益半導体工業	1,400	2,254.00	3,155,600
日本ドライケミカル	400	1,426.00	570,400
日本製鋼所	4,500	3,095.00	13,927,500
三浦工業	6,800	3,020.00	20,536,000
タクマ	5,000	1,249.00	6,245,000

ツガミ	3,600	1,106.00	3,981,600
オークマ	1,700	5,010.00	8,517,000
芝浦機械	2,000	2,853.00	5,706,000
アマダ	27,400	1,047.00	28,687,800
アイダエンジニアリング	3,800	861.00	3,271,800
TAKISAWA	500	1,070.00	535,000
FUJII	6,900	1,969.00	13,586,100
牧野フライス製作所	1,800	4,515.00	8,127,000
オーエスジー	7,000	1,869.00	13,083,000
ダイジェット工業	200	816.00	163,200
旭ダイヤモンド工業	4,200	727.00	3,053,400
DMG森精機	8,900	1,730.00	15,397,000
ソディック	4,100	769.00	3,152,900
ディスコ	2,600	34,300.00	89,180,000
日東工器	800	1,567.00	1,253,600
日進工具	1,400	1,177.00	1,647,800
パンチ工業	1,500	411.00	616,500
富士ダイス	900	565.00	508,500
豊和工業	900	863.00	776,700
ニデックオーケーケー	600	870.00	522,000
東洋機械金属	1,200	557.00	668,400
島精機製作所	2,500	2,146.00	5,365,000
オプトラン	2,200	2,105.00	4,631,000
NCホールディングス	500	1,870.00	935,000
イワキポンプ	1,100	1,447.00	1,591,700
フリー	1,500	1,168.00	1,752,000
ヤマシンフィルタ	2,600	406.00	1,055,600
日阪製作所	1,800	839.00	1,510,200
やまびこ	2,400	1,133.00	2,719,200
野村マイクロ・サイエンス	500	3,815.00	1,907,500
平田機工	800	4,355.00	3,484,000
ペガサスミシン製造	1,800	896.00	1,612,800
マルマエ	700	1,688.00	1,181,600
タツモ	800	1,456.00	1,164,800
ナプテスコ	9,200	3,110.00	28,612,000
三井海洋開発	1,800	1,541.00	2,773,800
レオン自動機	1,800	1,154.00	2,077,200
S M C	5,200	58,380.00	303,576,000
ホソカワミクロン	1,100	2,661.00	2,927,100
ユニオンツール	600	3,515.00	2,109,000
オイレス工業	2,300	1,491.00	3,429,300
日精エー・エス・ビー機械	700	3,815.00	2,670,500



サトーホールディングス	2,300	1,846.00	4,245,800
技研製作所	1,500	3,185.00	4,777,500
日本エアータック	700	1,120.00	784,000
カワタ	500	848.00	424,000
日精樹脂工業	1,100	954.00	1,049,400
オカダアイヨン	500	1,440.00	720,000
ワイエイシイホールディングス	700	1,267.00	886,900
小松製作所	79,800	2,762.00	220,407,600
住友重機械工業	9,400	2,811.00	26,423,400
日立建機	7,000	2,741.00	19,187,000
日工	2,100	612.00	1,285,200
巴工業	600	2,430.00	1,458,000
井関農機	1,400	1,216.00	1,702,400
TOWA	1,500	1,792.00	2,688,000
丸山製作所	300	1,431.00	429,300
北川鉄工所	700	1,263.00	884,100
ローツェ	900	7,300.00	6,570,000
タカキタ	600	472.00	283,200
クボタ	78,700	2,046.50	161,059,550
荏原実業	700	2,209.00	1,546,300
三菱化工機	500	2,123.00	1,061,500
月島機械	2,700	980.00	2,646,000
帝国電機製作所	1,100	1,966.00	2,162,600
新東工業	3,300	699.00	2,306,700
澁谷工業	1,400	2,519.00	3,526,600
アイチ コーポレーション	2,500	774.00	1,935,000
小森コーポレーション	4,000	759.00	3,036,000
鶴見製作所	1,200	2,279.00	2,734,800
住友精密工業	300	2,498.00	749,400
酒井重工業	300	2,983.00	894,900
荏原製作所	6,000	4,785.00	28,710,000
石井鐵工所	200	2,467.00	493,400
西島製作所	1,400	1,303.00	1,824,200
北越工業	1,500	1,070.00	1,605,000
ダイキン工業	19,200	21,885.00	420,192,000
オルガノ	2,000	2,525.00	5,050,000
トーヨーカネツ	600	2,482.00	1,489,200
栗田工業	8,900	5,370.00	47,793,000
椿本チエイン	2,300	3,170.00	7,291,000
大同工業	700	735.00	514,500
木村化工機	1,300	729.00	947,700
アネスト岩田	2,700	914.00	2,467,800

ダイフク	8,300	6,750.00	56,025,000
サムコ	500	3,190.00	1,595,000
加藤製作所	800	715.00	572,000
油研工業	300	1,790.00	537,000
タダノ	8,500	911.00	7,743,500
フジテック	5,400	2,984.00	16,113,600
C K D	4,500	1,772.00	7,974,000
キトー	1,400	2,719.00	3,806,600
平和	4,900	2,366.00	11,593,400
理想科学工業	1,500	2,439.00	3,658,500
S A N K Y O	3,600	4,950.00	17,820,000
日本金銭機械	1,700	715.00	1,215,500
マースグループホールディングス	1,100	1,780.00	1,958,000
フクシマガリレイ	1,100	4,080.00	4,488,000
オーイズミ	700	418.00	292,600
ダイコク電機	800	1,424.00	1,139,200
竹内製作所	2,700	2,974.00	8,029,800
アマノ	4,600	2,546.00	11,711,600
J U K I	2,300	727.00	1,672,100
サンデン	2,500	210.00	525,000
ジャノメ	1,400	631.00	883,400
マックス	2,100	2,126.00	4,464,600
グローリー	4,200	2,264.00	9,508,800
新晃工業	1,600	1,564.00	2,502,400
大和冷機工業	2,200	1,220.00	2,684,000
セガサミーホールディングス	15,800	1,897.00	29,972,600
日本ピストンリング	600	1,187.00	712,200
リケン	600	2,310.00	1,386,000
T P R	1,900	1,237.00	2,350,300
ツバキ・ナカシマ	3,600	1,192.00	4,291,200
ホシザキ	9,500	4,230.00	40,185,000
大豊工業	1,400	708.00	991,200
日本精工	30,100	747.00	22,484,700
N T N	31,900	253.00	8,070,700
ジェイテクト	15,000	961.00	14,415,000
不二越	1,100	3,800.00	4,180,000
日本トムソン	4,000	523.00	2,092,000
T H K	8,500	2,512.00	21,352,000
ユーシン精機	1,300	708.00	920,400
前澤給装工業	1,100	930.00	1,023,000
イーグル工業	1,900	1,105.00	2,099,500
前澤工業	1,000	608.00	608,000

日本ピラー工業	1,500	2,451.00	3,676,500
キット	5,400	860.00	4,644,000
マキタ	19,900	2,814.50	56,008,550
三井E & Sホールディングス	6,600	405.00	2,673,000
日立造船	13,900	847.00	11,773,300
三菱重工業	25,800	4,992.00	128,793,600
I H I	11,000	3,320.00	36,520,000
サノヤスホールディングス	2,100	125.00	262,500
スター精密	2,800	1,666.00	4,664,800
日清紡ホールディングス	12,000	1,031.00	12,372,000
イビデン	8,500	4,370.00	37,145,000
コニカミノルタ	35,600	454.00	16,162,400
ブラザー工業	20,000	2,584.00	51,680,000
ミネベアミツミ	28,000	2,179.00	61,012,000
日立製作所	84,700	6,544.00	554,276,800
東芝	30,800	5,207.00	160,375,600
三菱電機	164,300	1,395.00	229,198,500
富士電機	9,800	5,520.00	54,096,000
東洋電機製造	600	850.00	510,000
安川電機	17,500	4,070.00	71,225,000
シンフォニアテクノロジー	1,800	1,364.00	2,455,200
明電舎	2,500	1,967.00	4,917,500
オリジン	400	1,280.00	512,000
山洋電気	600	4,960.00	2,976,000
デンヨー	1,200	1,439.00	1,726,800
P H C ホールディングス	2,700	1,514.00	4,087,800
東芝テック	1,900	3,925.00	7,457,500
芝浦メカトロニクス	300	9,610.00	2,883,000
マブチモーター	3,700	4,000.00	14,800,000
日本電産	39,100	8,231.00	321,832,100
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	700	518.00	362,600
トレックス・セミコンダクター	800	2,812.00	2,249,600
東光高岳	1,000	1,880.00	1,880,000
ダブル・スコープ	4,800	1,848.00	8,870,400
ダイヘン	1,600	3,755.00	6,008,000
ヤーマン	2,900	1,111.00	3,221,900
J V C ケンウッド	14,300	210.00	3,003,000
ミマキエンジニアリング	1,600	701.00	1,121,600
I - P E X	800	1,268.00	1,014,400
日新電機	4,100	1,365.00	5,596,500
大崎電気工業	3,000	524.00	1,572,000
オムロン	14,700	7,014.00	103,105,800

日東工業	2,200	2,449.00	5,387,800	
I D E C	2,200	3,090.00	6,798,000	
正興電機製作所	700	1,001.00	700,700	
不二電機工業	300	1,087.00	326,100	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,300	2,235.00	11,845,500	
サクサホールディングス	400	1,206.00	482,400	
メルコホールディングス	500	3,060.00	1,530,000	
テクノメディカ	400	1,651.00	660,400	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	500	1,174.00	587,000	
日本電気	20,900	4,955.00	103,559,500	
富士通	15,800	16,900.00	267,020,000	
沖電気工業	6,600	730.00	4,818,000	
岩崎通信機	800	762.00	609,600	
電気興業	800	2,371.00	1,896,800	
サンケン電気	1,500	4,745.00	7,117,500	
ナカヨ	300	1,095.00	328,500	
アイホン	800	2,023.00	1,618,400	
ルネサスエレクトロニクス	96,200	1,235.00	118,807,000	
セイコーエプソン	19,600	2,088.00	40,924,800	
ワコム	13,500	633.00	8,545,500	
アルバック	3,500	5,680.00	19,880,000	
アクセル	700	1,177.00	823,900	
E I Z O	1,200	3,750.00	4,500,000	
日本信号	3,800	1,011.00	3,841,800	
京三製作所	3,400	404.00	1,373,600	
能美防災	2,000	1,616.00	3,232,000	
ホーチキ	1,100	1,474.00	1,621,400	
星和電機	700	428.00	299,600	
エレコム	4,000	1,379.00	5,516,000	
パナソニック ホールディングス	187,800	1,071.00	201,133,800	
シャープ	16,700	889.00	14,846,300	
アンリツ	11,100	1,632.00	18,115,200	
富士通ゼネラル	4,800	3,000.00	14,400,000	
ソニーグループ	110,300	9,884.00	1,090,205,200	代用有価証券 35,000株
T D K	25,500	4,635.00	118,192,500	
帝国通信工業	800	1,471.00	1,176,800	
タムラ製作所	6,300	717.00	4,517,100	
アルプスアルパイン	14,400	1,118.00	16,099,200	
池上通信機	600	543.00	325,800	
日本電波工業	1,800	1,528.00	2,750,400	
鈴木	900	869.00	782,100	

メイコー	1,900	2,587.00	4,915,300
日本トリム	300	2,340.00	702,000
ローランド ディー・ジー	800	3,100.00	2,480,000
フォスター電機	1,600	776.00	1,241,600
S M K	400	2,743.00	1,097,200
ヨコオ	1,200	1,994.00	2,392,800
ホシデン	3,900	1,536.00	5,990,400
ヒロセ電機	2,400	19,200.00	46,080,000
日本航空電子工業	3,600	2,050.00	7,380,000
T O A	1,900	793.00	1,506,700
マクセル	3,200	1,336.00	4,275,200
古野電気	2,100	1,049.00	2,202,900
ユニデンホールディングス	200	4,090.00	818,000
スミダコーポレーション	1,300	929.00	1,207,700
アイコム	600	2,538.00	1,522,800
リオン	600	2,053.00	1,231,800
横河電機	16,100	2,370.00	38,157,000
新電元工業	600	3,640.00	2,184,000
アズビル	10,200	4,040.00	41,208,000
東亜ディーケーケー	900	854.00	768,600
日本光電工業	6,700	3,390.00	22,713,000
チノー	500	1,725.00	862,500
共和電業	1,700	333.00	566,100
日本電子材料	800	1,453.00	1,162,400
堀場製作所	3,300	5,970.00	19,701,000
アドバンテスト	13,100	7,410.00	97,071,000
小野測器	700	383.00	268,100
エスペック	1,300	1,827.00	2,375,100
キーエンス	16,000	51,220.00	819,520,000
日置電機	800	6,790.00	5,432,000
シスメックス	12,600	8,022.00	101,077,200
日本マイクロニクス	2,400	1,365.00	3,276,000
メガチップス	1,600	2,531.00	4,049,600
O B A R A G R O U P	700	3,420.00	2,394,000
澤藤電機	200	1,181.00	236,200
原田工業	800	792.00	633,600
コーセル	2,000	838.00	1,676,000
イリソ電子工業	1,500	4,095.00	6,142,500
オブテックスグループ	2,700	1,990.00	5,373,000
千代田インテグレ	600	2,312.00	1,387,200
レーザーテック	7,200	20,025.00	144,180,000
スタンレー電気	11,300	2,490.00	28,137,000

岩崎電気	600	2,623.00	1,573,800	
ウシオ電機	8,300	1,528.00	12,682,400	
岡谷電機産業	1,400	261.00	365,400	
ハリオス テクノ ホールディング	1,500	472.00	708,000	
エノモト	500	1,758.00	879,000	
日本セラミック	1,500	2,574.00	3,861,000	
遠藤照明	900	739.00	665,100	
古河電池	1,300	1,067.00	1,387,100	
双信電機	800	410.00	328,000	
山一電機	1,100	2,035.00	2,238,500	
図研	1,200	3,285.00	3,942,000	
日本電子	3,400	5,350.00	18,190,000	
カシオ計算機	10,900	1,303.00	14,202,700	
ファナック	15,500	20,485.00	317,517,500	
日本シイエムケイ	3,100	503.00	1,559,300	
エンプラス	400	4,125.00	1,650,000	
大真空	2,200	913.00	2,008,600	
ローム	7,300	10,350.00	75,555,000	
浜松ホトニクス	11,700	6,620.00	77,454,000	
三井ハイテック	1,500	7,610.00	11,415,000	
新光電気工業	5,200	3,325.00	17,290,000	
京セラ	24,800	7,391.00	183,296,800	
太陽誘電	7,800	3,980.00	31,044,000	
村田製作所	48,000	7,171.00	344,208,000	
双葉電子工業	3,000	609.00	1,827,000	
北陸電気工業	700	1,046.00	732,200	
ニチコン	4,700	1,364.00	6,410,800	
日本ケミコン	1,700	1,781.00	3,027,700	
K O A	2,400	2,118.00	5,083,200	
市光工業	2,100	393.00	825,300	
小糸製作所	17,600	2,108.00	37,100,800	
ミツバ	2,700	392.00	1,058,400	
S C R E E Nホールディングス	2,800	8,140.00	22,792,000	
キャノン電子	1,600	1,583.00	2,532,800	
キャノン	80,200	3,344.00	268,188,800	代用有価証券 10,000株
リコー	41,800	1,109.00	46,356,200	
象印マホービン	4,400	1,506.00	6,626,400	
M U T O Hホールディングス	200	1,883.00	376,600	
東京エレクトロン	11,200	39,180.00	438,816,000	
イノテック	1,000	1,251.00	1,251,000	
トヨタ紡織	6,100	1,888.00	11,516,800	
芦森工業	300	1,043.00	312,900	

ユニプレス	2,900	854.00	2,476,600
豊田自動織機	12,500	7,430.00	92,875,000
モリタホールディングス	2,800	1,296.00	3,628,800
三櫻工業	2,500	669.00	1,672,500
デンソー	34,500	7,300.00	251,850,000
東海理化電機製作所	4,700	1,497.00	7,035,900
川崎重工業	11,900	2,446.00	29,107,400
名村造船所	4,500	562.00	2,529,000
日本車輛製造	600	2,012.00	1,207,200
三菱ロジスネクスト	2,300	733.00	1,685,900
近畿車輛	300	996.00	298,800
日産自動車	207,600	467.70	97,094,520
いすゞ自動車	51,000	1,715.00	87,465,000
トヨタ自動車	802,500	2,020.00	1,621,050,000
日野自動車	21,900	597.00	13,074,300
三菱自動車工業	65,100	497.00	32,354,700
エフテック	1,200	524.00	628,800
レシップホールディングス	700	488.00	341,600
G M B	300	728.00	218,400
ファルテック	300	609.00	182,700
武蔵精密工業	4,000	1,676.00	6,704,000
日産車体	2,600	825.00	2,145,000
新明和工業	4,600	1,019.00	4,687,400
極東開発工業	2,800	1,387.00	3,883,600
トピー工業	1,300	1,575.00	2,047,500
ティラド	500	2,717.00	1,358,500
タチエス	2,900	1,111.00	3,221,900
N O K	6,700	1,206.00	8,080,200
フタバ産業	3,900	330.00	1,287,000
K Y B	1,500	3,125.00	4,687,500
大同メタル工業	3,400	508.00	1,727,200
プレス工業	7,900	407.00	3,215,300
ミクニ	2,100	317.00	665,700
太平洋工業	3,400	1,059.00	3,600,600
河西工業	2,200	191.00	420,200
アイシン	12,900	3,925.00	50,632,500
マツダ	51,800	995.00	51,541,000
今仙電機製作所	1,200	575.00	690,000
本田技研工業	128,700	3,361.00	432,560,700
スズキ	34,900	4,817.00	168,113,300
S U B A R U	46,300	2,320.00	107,416,000
安永	700	620.00	434,000

ヤマハ発動機	23,000	3,010.00	69,230,000
T B K	1,900	284.00	539,600
エクセディ	2,600	1,730.00	4,498,000
豊田合成	5,000	2,298.00	11,490,000
愛三工業	2,800	697.00	1,951,600
盟和産業	300	978.00	293,400
日本プラスト	1,400	426.00	596,400
ヨロズ	1,400	864.00	1,209,600
エフ・シー・シー	2,900	1,420.00	4,118,000
シマノ	6,000	22,690.00	136,140,000
テイ・エス テック	7,400	1,539.00	11,388,600
ジャムコ	1,000	1,604.00	1,604,000
テルモ	49,800	4,525.00	225,345,000
クリエートメディック	500	883.00	441,500
日機装	3,700	990.00	3,663,000
日本エム・ディ・エム	1,000	1,246.00	1,246,000
島津製作所	21,000	3,895.00	81,795,000
J M S	1,300	528.00	686,400
長野計器	1,100	1,083.00	1,191,300
ブイ・テクノロジー	800	2,772.00	2,217,600
東京計器	1,100	1,260.00	1,386,000
愛知時計電機	600	1,334.00	800,400
インターアクション	900	1,439.00	1,295,100
オーバル	1,600	497.00	795,200
東京精密	2,700	4,390.00	11,853,000
マニー	6,400	2,110.00	13,504,000
ニコン	24,800	1,437.00	35,637,600
トプコン	8,300	1,599.00	13,271,700
オリンパス	84,300	3,069.00	258,716,700
理研計器	1,200	4,125.00	4,950,000
タムロン	1,100	3,220.00	3,542,000
H O Y A	33,600	14,700.00	493,920,000
シード	800	500.00	400,000
ノーリツ鋼機	1,400	2,632.00	3,684,800
A & D ホロンホールディングス	2,000	917.00	1,834,000
朝日インテック	19,300	2,508.00	48,404,400
シチズン時計	16,100	624.00	10,046,400
リズム	500	1,647.00	823,500
大研医器	1,400	454.00	635,600
メニコン	5,400	2,900.00	15,660,000
シンシア	200	506.00	101,200
松風	600	2,484.00	1,490,400



セイコーグループ	2,500	3,280.00	8,200,000
ニプロ	12,200	1,117.00	13,627,400
KYORITSU	2,600	117.00	304,200
中本パックス	500	1,503.00	751,500
スノーピーク	2,500	1,991.00	4,977,500
パラマウントベッドホールディングス	3,400	2,653.00	9,020,200
トランザクション	1,100	1,051.00	1,156,100
粧美堂	400	368.00	147,200
ニホンフラッシュ	1,400	976.00	1,366,400
前田工織	1,600	2,963.00	4,740,800
永大産業	1,900	223.00	423,700
アートネイチャー	1,500	743.00	1,114,500
バンダイナムコホールディングス	14,600	9,867.00	144,058,200
アイフィスジャパン	500	620.00	310,000
SHOEI	1,500	5,430.00	8,145,000
フランスベッドホールディングス	2,200	928.00	2,041,600
パイロットコーポレーション	2,300	5,740.00	13,202,000
萩原工業	900	1,064.00	957,600
フジシールインターナショナル	3,600	1,765.00	6,354,000
タカラトミー	7,200	1,257.00	9,050,400
広済堂ホールディングス	1,100	1,556.00	1,711,600
エステールホールディングス	400	617.00	246,800
タカノ	600	675.00	405,000
プロネクサス	1,300	963.00	1,251,900
ホクシン	1,200	149.00	178,800
ウッドワン	500	951.00	475,500
大建工業	900	1,885.00	1,696,500
凸版印刷	22,900	2,242.00	51,341,800
大日本印刷	19,100	3,015.00	57,586,500
共同印刷	400	2,606.00	1,042,400
NISSHA	2,800	1,714.00	4,799,200
光村印刷	100	1,195.00	119,500
TAKARA & COMPANY	1,000	2,160.00	2,160,000
アシックス	13,500	2,309.00	31,171,500
ツツミ	400	1,979.00	791,600
ローランド	1,100	4,110.00	4,521,000
小松ウオール工業	500	1,869.00	934,500
ヤマハ	10,200	5,620.00	57,324,000
河合楽器製作所	400	2,744.00	1,097,600
クリナップ	1,600	596.00	953,600
ピジョン	9,300	1,958.00	18,209,400
兼松サステック	100	1,592.00	159,200

キングジム	1,300	920.00	1,196,000	
リンテック	3,400	2,240.00	7,616,000	
イトーキ	3,000	423.00	1,269,000	
任天堂	99,400	6,072.00	603,556,800	
三菱鉛筆	2,100	1,440.00	3,024,000	
タカスタンダード	2,800	1,297.00	3,631,600	
コクヨ	7,000	1,844.00	12,908,000	
ナカバヤシ	1,400	530.00	742,000	
グローブライド	1,300	2,280.00	2,964,000	
オカムラ	5,000	1,357.00	6,785,000	
美津濃	1,500	2,516.00	3,774,000	
東京電力ホールディングス	131,600	472.00	62,115,200	
中部電力	49,700	1,219.00	60,584,300	
関西電力	61,500	1,125.00	69,187,500	
中国電力	25,300	675.00	17,077,500	
北陸電力	15,000	469.00	7,035,000	
東北電力	38,400	605.00	23,232,000	
四国電力	14,600	672.00	9,811,200	
九州電力	33,700	719.00	24,230,300	
北海道電力	15,400	434.00	6,683,600	
沖縄電力	3,800	1,004.00	3,815,200	
電源開発	13,000	2,092.00	27,196,000	
エフオン	1,100	631.00	694,100	
イーレックス	2,300	2,483.00	5,710,900	
レノバ	3,400	3,365.00	11,441,000	
東京瓦斯	30,900	2,531.00	78,207,900	
大阪瓦斯	29,600	2,182.00	64,587,200	
東邦瓦斯	6,900	2,875.00	19,837,500	
北海道瓦斯	900	1,671.00	1,503,900	
広島ガス	3,000	342.00	1,026,000	
西部ガスホールディングス	1,700	1,715.00	2,915,500	
静岡ガス	3,300	1,068.00	3,524,400	
メタウォーター	1,800	1,914.00	3,445,200	
SBSホールディングス	1,300	2,865.00	3,724,500	
東武鉄道	16,000	3,380.00	54,080,000	
相鉄ホールディングス	5,200	2,259.00	11,746,800	
東急	41,000	1,672.00	68,552,000	
京浜急行電鉄	19,600	1,492.00	29,243,200	
小田急電鉄	22,100	1,799.00	39,757,900	
京王電鉄	7,700	5,120.00	39,424,000	
京成電鉄	10,700	3,840.00	41,088,000	
富士急行	1,800	4,495.00	8,091,000	

東日本旅客鉄道	26,900	7,911.00	212,805,900
西日本旅客鉄道	18,700	5,704.00	106,664,800
東海旅客鉄道	12,400	16,885.00	209,374,000
西武ホールディングス	21,200	1,313.00	27,835,600
鴻池運輸	2,500	1,546.00	3,865,000
西日本鉄道	4,200	2,873.00	12,066,600
ハマキョウレックス	1,200	3,275.00	3,930,000
サカイ引越センター	800	4,660.00	3,728,000
近鉄グループホールディングス	15,600	4,905.00	76,518,000
阪急阪神ホールディングス	19,500	4,320.00	84,240,000
南海電気鉄道	7,000	2,860.00	20,020,000
京阪ホールディングス	6,500	3,755.00	24,407,500
神戸電鉄	400	3,240.00	1,296,000
名古屋鉄道	16,100	2,237.00	36,015,700
山陽電気鉄道	1,200	2,259.00	2,710,800
アルプス物流	1,200	1,069.00	1,282,800
ヤマトホールディングス	22,800	2,183.00	49,772,400
山九	4,000	4,340.00	17,360,000
丸運	1,000	215.00	215,000
丸全昭和運輸	1,100	3,075.00	3,382,500
センコーグループホールディングス	7,800	981.00	7,651,800
トナミホールディングス	300	3,585.00	1,075,500
ニッコンホールディングス	5,000	2,305.00	11,525,000
日本石油輸送	200	2,239.00	447,800
福山通運	2,200	3,250.00	7,150,000
セイノーホールディングス	9,100	1,138.00	10,355,800
エスライン	500	807.00	403,500
神奈川中央交通	400	3,335.00	1,334,000
日立物流	3,200	8,700.00	27,840,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	2,900	1,425.00	4,132,500
C & F ロジホールディングス	1,400	1,216.00	1,702,400
九州旅客鉄道	11,200	3,065.00	34,328,000
S Gホールディングス	28,000	2,032.00	56,896,000
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	5,400	7,330.00	39,582,000
日本郵船	41,900	2,783.00	116,607,700
商船三井	25,800	3,010.00	77,658,000
川崎汽船	15,500	2,384.00	36,952,000
N S ユナイテッド海運	800	3,905.00	3,124,000
飯野海運	6,900	764.00	5,271,600
乾汽船	1,200	1,913.00	2,295,600
日本航空	35,800	2,777.00	99,416,600
A N Aホールディングス	39,700	2,891.50	114,792,550

パスコ	300	1,298.00	389,400
トランコム	500	7,410.00	3,705,000
日新	1,200	1,919.00	2,302,800
三菱倉庫	4,000	3,420.00	13,680,000
三井倉庫ホールディングス	1,600	3,220.00	5,152,000
住友倉庫	4,900	2,054.00	10,064,600
澁澤倉庫	800	2,056.00	1,644,800
東陽倉庫	2,500	248.00	620,000
日本トランスシティ	2,900	490.00	1,421,000
ケイヒン	300	1,415.00	424,500
中央倉庫	900	920.00	828,000
川西倉庫	300	996.00	298,800
安田倉庫	1,100	935.00	1,028,500
ファイズホールディングス	400	859.00	343,600
東洋埠頭	500	1,144.00	572,000
上組	7,900	2,831.00	22,364,900
サンリツ	400	673.00	269,200
キムラユニティー	900	758.00	682,200
キューソー流通システム	900	1,072.00	964,800
東海運	1,000	280.00	280,000
エーアイティー	1,000	1,524.00	1,524,000
内外トランスライン	500	2,004.00	1,002,000
日本コンセプト	500	1,747.00	873,500
NEC ネットズエスアイ	5,700	1,652.00	9,416,400
クロスキャット	900	1,463.00	1,316,700
システナ	24,700	425.00	10,497,500
デジタルアーツ	900	6,390.00	5,751,000
日鉄ソリューションズ	3,000	3,585.00	10,755,000
キューブシステム	900	990.00	891,000
コア	700	1,457.00	1,019,900
手間いらず	300	5,730.00	1,719,000
ラクーンホールディングス	1,500	1,171.00	1,756,500
ソリトンシステムズ	700	1,054.00	737,800
ソフトクリエイトホールディングス	800	3,450.00	2,760,000
T I S	15,100	4,050.00	61,155,000
J N S ホールディングス	900	363.00	326,700
グリー	7,900	844.00	6,667,600
G M O ペパボ	200	2,000.00	400,000
コーエーテクモホールディングス	11,000	2,222.00	24,442,000
三菱総合研究所	700	5,110.00	3,577,000
ボルテージ	500	348.00	174,000
電算	200	1,616.00	323,200

A G S	700	607.00	424,900
ファインデックス	1,200	612.00	734,400
ブレインパッド	1,500	915.00	1,372,500
K L a b	2,700	460.00	1,242,000
ポールトゥウィンホールディングス	2,500	944.00	2,360,000
ネクソン	37,900	2,492.00	94,446,800
アイスタイル	4,500	496.00	2,232,000
エムアップホールディングス	2,000	1,579.00	3,158,000
エイチーム	1,100	750.00	825,000
エニグモ	1,800	527.00	948,600
テクノスジャパン	1,400	453.00	634,200
e n i s h	1,300	434.00	564,200
コロプラ	5,700	713.00	4,064,100
ブロードリーフ	8,600	527.00	4,532,200
クロス・マーケティンググループ	700	881.00	616,700
デジタルハーツホールディングス	800	2,012.00	1,609,600
システム情報	1,300	993.00	1,290,900
メディアドゥ	600	2,158.00	1,294,800
じげん	4,900	363.00	1,778,700
ブイキューブ	1,800	1,020.00	1,836,000
エンカレッジ・テクノロジー	400	515.00	206,000
サイバーリンクス	600	1,384.00	830,400
フィックスターズ	1,700	1,155.00	1,963,500
C A R T A H O L D I N G S	700	1,758.00	1,230,600
オブティム	1,200	895.00	1,074,000
セレス	600	903.00	541,800
S H I F T	1,100	22,060.00	24,266,000
ティーガイア	1,500	1,655.00	2,482,500
セック	300	2,241.00	672,300
テクマトリックス	2,900	1,797.00	5,211,300
プロシップ	600	1,556.00	933,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,500	2,155.00	9,697,500
G M O ペイメントゲートウェイ	3,300	10,910.00	36,003,000
ザッパラス	600	365.00	219,000
システムリサーチ	500	2,001.00	1,000,500
インターネットイニシアティブ	9,200	2,391.00	21,997,200
さくらインターネット	1,800	556.00	1,000,800
ヴィンクス	500	1,529.00	764,500
G M O グローバルサイン・ホールディングス	500	4,665.00	2,332,500
S R A ホールディングス	800	3,220.00	2,576,000
システムインテグレータ	600	470.00	282,000
朝日ネット	1,600	598.00	956,800

e B A S E	2,100	556.00	1,167,600
アバントグループ	1,900	1,454.00	2,762,600
アドソル日進	600	1,518.00	910,800
ODKソリューションズ	400	607.00	242,800
フリービット	900	1,045.00	940,500
コムチュア	1,900	2,439.00	4,634,100
サイバーコム	300	1,434.00	430,200
アステリア	1,200	841.00	1,009,200
アイル	800	1,825.00	1,460,000
マークラインズ	800	2,440.00	1,952,000
メディカル・データ・ビジョン	2,200	1,112.00	2,446,400
g u m i	2,400	944.00	2,265,600
ショーケース	400	402.00	160,800
モバイルファクトリー	400	962.00	384,800
テラスカイ	600	2,404.00	1,442,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	800	1,731.00	1,384,800
P C Iホールディングス	700	1,010.00	707,000
アイビーシー	300	474.00	142,200
ネオジャパン	500	1,001.00	500,500
P R T I M E S	400	2,306.00	922,400
ラクス	7,900	1,649.00	13,027,100
ランドコンピュータ	400	838.00	335,200
ダブルスタンダード	500	2,555.00	1,277,500
オープンドア	1,000	1,800.00	1,800,000
マイネット	600	469.00	281,400
アカツキ	800	2,140.00	1,712,000
ベネフィットジャパン	100	1,570.00	157,000
U b i c o mホールディングス	400	2,297.00	918,800
カナミックネットワーク	2,100	608.00	1,276,800
ノムラシステムコーポレーション	1,600	125.00	200,000
チェンジ	3,600	2,028.00	7,300,800
シンクロ・フード	900	514.00	462,600
オークネット	800	2,259.00	1,807,200
キャピタル・アセット・プランニング	300	577.00	173,100
エイトレッド	200	1,568.00	313,600
マクロミル	3,400	1,112.00	3,780,800
ビーグリー	300	1,340.00	402,000
オロ	400	1,562.00	624,800
ユーザーローカル	500	1,581.00	790,500
テモナ	300	275.00	82,500
マネーフォワード	3,500	4,075.00	14,262,500
サインポスト	600	749.00	449,400

電算システムホールディングス	700	2,336.00	1,635,200
ソルクシーズ	1,300	366.00	475,800
フェイス	500	554.00	277,000
プロトコーポレーション	1,800	1,136.00	2,044,800
ハイマックス	500	1,492.00	746,000
野村総合研究所	30,000	3,660.00	109,800,000
サイバネットシステム	1,200	1,000.00	1,200,000
C Eホールディングス	800	480.00	384,000
日本システム技術	600	1,400.00	840,000
インテージホールディングス	2,000	1,670.00	3,340,000
東邦システムサイエンス	500	976.00	488,000
ソースネクスト	7,500	293.00	2,197,500
インフォコム	1,900	2,056.00	3,906,400
シンプレクス・ホールディングス	2,700	2,024.00	5,464,800
HEROZ	500	1,066.00	533,000
ラクスル	2,100	2,913.00	6,117,300
メルカリ	6,600	2,351.00	15,516,600
I P S	500	3,000.00	1,500,000
F I G	1,900	403.00	765,700
システムサポート	600	1,354.00	812,400
イーソル	1,000	572.00	572,000
アルテリア・ネットワークス	1,700	1,195.00	2,031,500
東海ソフト	300	915.00	274,500
ウイングアーク1st	1,300	2,331.00	3,030,300
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,655.00	662,000
サーバーワークス	300	2,449.00	734,700
東名	100	1,486.00	148,600
ヴィッツ	200	959.00	191,800
トピラシステムズ	400	915.00	366,000
S a n s a n	5,500	1,465.00	8,057,500
L i n k - U	300	816.00	244,800
ギフティ	1,600	2,195.00	3,512,000
ベース	500	4,060.00	2,030,000
J M D C	2,300	5,220.00	12,006,000
フォーカスシステムズ	1,100	1,010.00	1,111,000
クレスコ	1,200	1,774.00	2,128,800
フジ・メディア・ホールディングス	15,300	1,051.00	16,080,300
オービック	5,400	22,570.00	121,878,000
ジャストシステム	2,500	3,100.00	7,750,000
T D C ソフト	1,400	1,300.00	1,820,000
Zホールディングス	249,200	393.50	98,060,200
トレンドマイクロ	8,500	7,620.00	64,770,000

I Dホールディングス	1,100	927.00	1,019,700
日本オラクル	2,800	8,240.00	23,072,000
アルファシステムズ	500	4,305.00	2,152,500
フューチャー	3,600	1,675.00	6,030,000
C A C Holdings	900	1,535.00	1,381,500
S Bテクノロジー	800	2,269.00	1,815,200
トーセ	500	810.00	405,000
オービックビジネスコンサルタント	1,700	4,515.00	7,675,500
伊藤忠テクノソリューションズ	7,900	3,570.00	28,203,000
アイティフォー	2,100	785.00	1,648,500
東計電算	200	6,030.00	1,206,000
エクスネット	300	1,005.00	301,500
大塚商会	8,300	4,785.00	39,715,500
サイボウズ	2,000	1,884.00	3,768,000
電通国際情報サービス	1,800	4,600.00	8,280,000
A C C E S S	2,000	787.00	1,574,000
デジタルガレージ	2,900	3,555.00	10,309,500
E Mシステムズ	2,500	928.00	2,320,000
ウェザーニューズ	500	7,560.00	3,780,000
C I J	1,300	799.00	1,038,700
ビジネスエンジニアリング	400	2,128.00	851,200
日本エンタープライズ	1,900	140.00	266,000
WOWOW	700	1,279.00	895,300
スカラ	1,400	740.00	1,036,000
インテリジェント ウェイブ	900	828.00	745,200
WOW WORLD GROUP	300	978.00	293,400
I M A G I C A GROUP	1,200	910.00	1,092,000
ネットワンシステムズ	6,400	3,055.00	19,552,000
システムソフト	5,500	100.00	550,000
アルゴグラフィックス	1,300	3,890.00	5,057,000
マーベラス	2,700	680.00	1,836,000
エイベックス	3,000	1,698.00	5,094,000
B I P R O G Y	5,400	3,260.00	17,604,000
兼松エレクトロニクス	900	4,215.00	3,793,500
都築電気	800	1,274.00	1,019,200
T B Sホールディングス	8,400	1,577.00	13,246,800
日本テレビホールディングス	14,400	1,142.00	16,444,800
朝日放送グループホールディングス	1,400	620.00	868,000
テレビ朝日ホールディングス	4,100	1,409.00	5,776,900
スカパーJ S A Tホールディングス	14,700	524.00	7,702,800
テレビ東京ホールディングス	1,100	1,925.00	2,117,500
日本BS放送	600	909.00	545,400



ビジョン	1,900	1,238.00	2,352,200
スマートバリュー	400	472.00	188,800
USEN-NEXT HOLDINGS	1,300	2,248.00	2,922,400
コネクシオ	1,200	1,142.00	1,370,400
日本通信	14,400	223.00	3,211,200
クロップス	300	1,021.00	306,300
日本電信電話	193,600	4,106.00	794,921,600
KDDI	125,900	4,406.00	554,715,400
ソフトバンク	261,700	1,471.50	385,091,550
光通信	2,000	18,020.00	36,040,000
エムティーアイ	1,300	506.00	657,800
GMOインターネットグループ	5,400	2,596.00	14,018,400
ファイバークエスト	700	885.00	619,500
アйдママーケティングコミュニケーション	400	283.00	113,200
KADOKAWA	9,300	2,721.00	25,305,300
学研ホールディングス	2,500	957.00	2,392,500
ゼンリン	2,800	895.00	2,506,000
昭文社ホールディングス	700	303.00	212,100
インプレスホールディングス	1,600	209.00	334,400
アイネット	800	1,377.00	1,101,600
松竹	1,000	11,750.00	11,750,000
東宝	10,200	5,230.00	53,346,000
東映	500	18,690.00	9,345,000
エヌ・ティ・ティ・データ	46,000	2,147.00	98,762,000
ピー・シー・エー	1,000	1,111.00	1,111,000
ビジネスブレイン太田昭和	600	1,500.00	900,000
DTS	3,200	3,530.00	11,296,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,000	6,520.00	52,160,000
シーイーシー	1,900	1,545.00	2,935,500
カブコン	16,000	3,805.00	60,880,000
アイ・エス・ビー	700	1,277.00	893,900
ジャステック	900	1,300.00	1,170,000
SCSK	12,000	2,244.00	26,928,000
NSW	700	2,175.00	1,522,500
アイネス	1,500	1,507.00	2,260,500
TKC	2,600	3,780.00	9,828,000
富士ソフト	1,700	8,140.00	13,838,000
NSD	5,400	2,526.00	13,640,400
コナミグループ	6,300	6,500.00	40,950,000
福井コンピュータホールディングス	800	3,485.00	2,788,000
JBCホールディングス	1,200	1,962.00	2,354,400
ミロク情報サービス	1,500	1,459.00	2,188,500

ソフトバンクグループ	103,600	6,031.00	624,811,600
高千穂交易	600	2,053.00	1,231,800
オルパヘルスケアホールディングス	300	1,484.00	445,200
伊藤忠食品	400	4,890.00	1,956,000
エレマテック	1,400	1,327.00	1,857,800
あらた	1,300	4,060.00	5,278,000
トーメンデバイス	300	5,430.00	1,629,000
東京エレクトロン デバイス	500	5,960.00	2,980,000
円谷フィールズホールディングス	1,600	2,010.00	3,216,000
双日	17,800	2,222.00	39,551,600
アルフレッサ ホールディングス	18,000	1,675.00	30,150,000
横浜冷凍	4,300	898.00	3,861,400
神栄	300	809.00	242,700
ラサ商事	800	1,004.00	803,200
アルコニックス	2,300	1,371.00	3,153,300
神戸物産	12,000	3,155.00	37,860,000
ハイパー	400	458.00	183,200
あい ホールディングス	2,500	2,164.00	5,410,000
ディーブイエックス	700	928.00	649,600
ダイワボウホールディングス	7,400	1,836.00	13,586,400
マクニカホールディングス	4,200	2,826.00	11,869,200
ラクト・ジャパン	600	2,185.00	1,311,000
グリムス	800	1,658.00	1,326,400
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,900	655.00	1,899,500
八洲電機	1,300	1,016.00	1,320,800
メディアスホールディングス	1,100	710.00	781,000
レスターホールディングス	1,700	2,034.00	3,457,800
ジューテックホールディングス	400	1,033.00	413,200
大光	900	684.00	615,600
OCHIホールディングス	400	1,209.00	483,600
TOKAIホールディングス	8,500	898.00	7,633,000
黒谷	600	560.00	336,000
Cominix	400	722.00	288,800
三洋貿易	1,700	1,036.00	1,761,200
ビューティガレージ	300	2,621.00	786,300
ウイン・パートナーズ	1,300	1,000.00	1,300,000
ミタチ産業	500	919.00	459,500
シップヘルスケアホールディングス	5,000	2,845.00	14,225,000
明治電機工業	600	1,047.00	628,200
デリカフーズホールディングス	800	505.00	404,000
スターティアホールディングス	500	1,118.00	559,000
コメダホールディングス	3,800	2,442.00	9,279,600

ピーバンドットコム	300	513.00	153,900
アセンテック	700	518.00	362,600
富士興産	500	1,183.00	591,500
協栄産業	200	1,506.00	301,200
フルサト・マルカホールディングス	1,500	3,695.00	5,542,500
ヤマエグループホールディングス	1,000	1,547.00	1,547,000
小野建	1,600	1,458.00	2,332,800
南陽	400	1,832.00	732,800
佐島電機	1,100	1,282.00	1,410,200
エコートレーディング	400	543.00	217,200
伯東	1,000	3,630.00	3,630,000
コンドーテック	1,300	1,013.00	1,316,900
中山福	1,200	320.00	384,000
ナガイレーベン	2,000	2,000.00	4,000,000
三菱食品	1,700	3,035.00	5,159,500
松田産業	1,200	2,193.00	2,631,600
第一興商	3,300	4,210.00	13,893,000
メディバルホールディングス	16,100	1,827.00	29,414,700
S P K	700	1,428.00	999,600
萩原電気ホールディングス	600	2,189.00	1,313,400
アズワン	2,500	6,420.00	16,050,000
スズデン	600	2,329.00	1,397,400
シモジマ	1,100	1,014.00	1,115,400
ドウシシャ	1,700	1,487.00	2,527,900
小津産業	400	1,501.00	600,400
高速	1,000	1,576.00	1,576,000
たけびし	600	1,522.00	913,200
リックス	400	2,150.00	860,000
丸文	1,400	828.00	1,159,200
ハビネット	1,400	2,067.00	2,893,800
橋本総業ホールディングス	600	974.00	584,400
日本ライフライン	5,000	1,021.00	5,105,000
タカショー	1,400	672.00	940,800
I D O M	5,300	747.00	3,959,100
進和	1,000	2,004.00	2,004,000
エスケイジャパン	500	490.00	245,000
ダイトロン	600	2,077.00	1,246,200
シークス	2,200	1,129.00	2,483,800
田中商事	700	541.00	378,700
オーハシテクニカ	900	1,427.00	1,284,300
白銅	600	2,424.00	1,454,400
ダイコー通産	200	1,099.00	219,800

伊藤忠商事	101,300	3,908.00	395,880,400
丸紅	150,300	1,314.50	197,569,350
高島	300	2,658.00	797,400
長瀬産業	8,000	2,029.00	16,232,000
蝶理	1,000	1,936.00	1,936,000
豊田通商	15,500	4,800.00	74,400,000
三共生興	2,300	475.00	1,092,500
兼松	6,000	1,465.00	8,790,000
ツカモトコーポレーション	400	1,230.00	492,000
三井物産	121,900	3,300.00	402,270,000
日本紙パルプ商事	800	4,575.00	3,660,000
カメイ	1,900	1,124.00	2,135,600
東都水産	100	4,790.00	479,000
OUGホールディングス	300	2,400.00	720,000
スターゼン	1,200	2,068.00	2,481,600
山善	6,300	925.00	5,827,500
椿本興業	300	3,970.00	1,191,000
住友商事	102,600	1,922.50	197,248,500
内田洋行	700	4,420.00	3,094,000
三菱商事	113,700	4,095.00	465,601,500
第一実業	700	4,025.00	2,817,500
キャノンマーケティングジャパン	3,600	3,050.00	10,980,000
西華産業	800	1,631.00	1,304,800
佐藤商事	1,200	1,177.00	1,412,400
菱洋エレクトロ	1,000	2,243.00	2,243,000
東京産業	1,500	796.00	1,194,000
ユアサ商事	1,400	3,700.00	5,180,000
神鋼商事	400	3,905.00	1,562,000
トルク	1,200	214.00	256,800
阪和興業	3,000	3,585.00	10,755,000
正栄食品工業	1,100	4,115.00	4,526,500
カナデン	1,500	1,102.00	1,653,000
菱電商事	1,400	1,610.00	2,254,000
岩谷産業	3,900	5,450.00	21,255,000
ナイス	600	1,380.00	828,000
ニチモウ	200	2,520.00	504,000
極東貿易	1,000	1,294.00	1,294,000
アステナホールディングス	2,800	413.00	1,156,400
三愛オブリ	3,900	1,237.00	4,824,300
稲畑産業	3,500	2,446.00	8,561,000
G S Iクレオス	900	1,449.00	1,304,100
明和産業	1,700	740.00	1,258,000

クワザワホールディングス	800	412.00	329,600
ワキタ	3,200	1,185.00	3,792,000
東邦ホールディングス	4,700	2,001.00	9,404,700
サンゲツ	4,300	1,581.00	6,798,300
ミツウロコグループホールディングス	2,100	1,014.00	2,129,400
シナネンホールディングス	600	4,080.00	2,448,000
伊藤忠エネクス	3,900	1,030.00	4,017,000
サンリオ	4,900	3,815.00	18,693,500
サンワテクノス	900	1,371.00	1,233,900
リョーサン	1,800	2,660.00	4,788,000
新光商事	2,400	957.00	2,296,800
トーホー	700	1,698.00	1,188,600
三信電気	700	1,886.00	1,320,200
東陽テクニカ	1,700	1,257.00	2,136,900
モスフードサービス	2,300	3,115.00	7,164,500
加賀電子	1,400	4,240.00	5,936,000
ソーダニッカ	1,500	570.00	855,000
立花エレテック	1,200	1,645.00	1,974,000
フォーバル	700	892.00	624,400
PALTAC	2,400	4,220.00	10,128,000
三谷産業	2,900	293.00	849,700
太平洋興発	700	684.00	478,800
西本Wismettacホールディングス	400	4,175.00	1,670,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,660.00	332,000
コア商事ホールディングス	1,200	613.00	735,600
KPPグループホールディングス	3,300	850.00	2,805,000
ヤマタネ	800	1,615.00	1,292,000
丸紅建材リース	200	1,789.00	357,800
日鉄物産	1,100	5,020.00	5,522,000
泉州電業	400	5,440.00	2,176,000
トラスコ中山	3,300	2,039.00	6,728,700
オートバックスセブン	5,500	1,404.00	7,722,000
モリト	1,200	742.00	890,400
加藤産業	1,900	3,435.00	6,526,500
北恵	500	778.00	389,000
イエローハット	2,700	1,792.00	4,838,400
JKホールディングス	1,300	1,058.00	1,375,400
日伝	1,200	1,743.00	2,091,600
北沢産業	1,200	195.00	234,000
杉本商事	800	1,938.00	1,550,400
因幡電機産業	4,300	2,755.00	11,846,500
東テク	500	3,435.00	1,717,500

ミスミグループ本社	21,800	3,220.00	70,196,000
アルテック	1,200	290.00	348,000
タキヒヨー	500	771.00	385,500
蔵王産業	400	1,679.00	671,600
スズケン	6,200	3,180.00	19,716,000
ジェコス	1,300	800.00	1,040,000
グローセル	2,000	417.00	834,000
ローソン	3,800	4,750.00	18,050,000
サンエー	1,200	4,380.00	5,256,000
カワチ薬品	1,400	2,069.00	2,896,600
エービーシー・マート	2,700	6,560.00	17,712,000
ハードオフコーポレーション	800	1,230.00	984,000
アスクル	3,700	1,507.00	5,575,900
ゲオホールディングス	2,100	1,945.00	4,084,500
アダストリア	1,900	1,937.00	3,680,300
ジーフット	1,100	295.00	324,500
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	400	407.00	162,800
くら寿司	1,800	3,275.00	5,895,000
キャンドウ	600	2,198.00	1,318,800
アイケイ	700	427.00	298,900
パルグループホールディングス	1,500	1,977.00	2,965,500
エディオン	8,000	1,205.00	9,640,000
サーラコーポレーション	3,300	808.00	2,666,400
ワッツ	900	646.00	581,400
ハローズ	800	3,010.00	2,408,000
フジオフードグループ本社	1,300	1,376.00	1,788,800
あみやき亭	400	2,918.00	1,167,200
ひらまつ	3,800	191.00	725,800
大黒天物産	600	4,280.00	2,568,000
ハニーズホールディングス	1,400	1,201.00	1,681,400
ファーマライズホールディングス	400	659.00	263,600
アルペン	1,300	2,019.00	2,624,700
ハブ	600	634.00	380,400
クオールホールディングス	2,200	1,195.00	2,629,000
ジinzホールディングス	900	4,375.00	3,937,500
ビックカメラ	10,300	1,174.00	12,092,200
D C Mホールディングス	10,300	1,150.00	11,845,000
ペッパーフードサービス	3,300	223.00	735,900
MonotaRO	21,900	2,283.00	49,997,700
東京一番フーズ	400	585.00	234,000
アーランドサービスホールディングス	1,300	2,174.00	2,826,200
J．フロント リテイリング	19,200	1,172.00	22,502,400

ドトール・日レスホールディングス	2,800	1,636.00	4,580,800
マツキヨココカラ&カンパニー	10,200	5,370.00	54,774,000
ブロンコピリー	800	2,457.00	1,965,600
Z O Z O	11,900	3,160.00	37,604,000
トレジャー・ファクトリー	500	2,229.00	1,114,500
物語コーポレーション	900	6,650.00	5,985,000
三越伊勢丹ホールディングス	26,000	1,299.00	33,774,000
H a m e e	700	850.00	595,000
マーケットエンタープライズ	200	1,088.00	217,600
ウエルシアホールディングス	9,200	3,065.00	28,198,000
クリエイティブSDホールディングス	2,600	3,145.00	8,177,000
丸善C H Iホールディングス	2,100	323.00	678,300
ミサワ	400	591.00	236,400
ティーライフ	300	1,252.00	375,600
シュッピン	1,400	1,471.00	2,059,400
オイシックス・ラ・大地	2,500	1,784.00	4,460,000
ネクステージ	3,500	2,700.00	9,450,000
ジョイフル本田	5,000	1,801.00	9,005,000
鳥貴族ホールディングス	600	2,084.00	1,250,400
ホットランド	1,200	1,390.00	1,668,000
すかいらーくホールディングス	21,100	1,567.00	33,063,700
S F Pホールディングス	900	1,648.00	1,483,200
綿半ホールディングス	1,200	1,401.00	1,681,200
ヨシックスホールディングス	400	2,112.00	844,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,100	1,043.00	5,319,300
ゴルフダイジェスト・オンライン	700	1,436.00	1,005,200
B E E N O S	900	2,693.00	2,423,700
あさひ	1,500	1,302.00	1,953,000
日本調剤	1,100	1,306.00	1,436,600
コスモス薬品	1,700	14,490.00	24,633,000
トーエル	800	784.00	627,200
セブン&アイ・ホールディングス	58,100	5,592.00	324,895,200
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	11,700	884.00	10,342,800
ツルハホールディングス	3,800	8,550.00	32,490,000
サンマルクホールディングス	1,400	1,610.00	2,254,000
フェリシモ	400	1,013.00	405,200
トリドールホールディングス	4,300	2,792.00	12,005,600
T O K Y O B A S E	1,800	327.00	588,600
ウイルプラスホールディングス	400	1,020.00	408,000
J Mホールディングス	1,300	1,673.00	2,174,900
サツドラホールディングス	900	684.00	615,600

アレンザホールディングス	1,200	923.00	1,107,600
串カツ田中ホールディングス	400	1,818.00	727,200
パロックジャパンリミテッド	1,200	785.00	942,000
クスリのアオキホールディングス	1,600	6,910.00	11,056,000
力の源ホールディングス	1,000	766.00	766,000
FOOD & LIFE COMPANIE	8,900	2,513.00	22,365,700
メディカルシステムネットワーク	1,600	408.00	652,800
一家ホールディングス	400	622.00	248,800
ジャパンクラフトホールディングス	600	628.00	376,800
はるやまホールディングス	900	434.00	390,600
ノジマ	5,700	1,232.00	7,022,400
カップ・クリエイト	2,500	1,394.00	3,485,000
ライトオン	1,300	616.00	800,800
良品計画	20,000	1,415.00	28,300,000
パリミキホールディングス	2,400	256.00	614,400
アドヴァングループ	1,500	873.00	1,309,500
アルビス	500	2,378.00	1,189,000
コナカ	2,000	334.00	668,000
ハウス オブ ローゼ	200	1,615.00	323,000
G-7ホールディングス	2,000	1,553.00	3,106,000
イオン北海道	2,300	1,165.00	2,679,500
コジマ	3,000	616.00	1,848,000
ヒマラヤ	600	914.00	548,400
コーナン商事	2,500	3,050.00	7,625,000
エコス	600	1,821.00	1,092,600
ワタミ	2,100	891.00	1,871,100
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	34,700	2,403.00	83,384,100
西松屋チェーン	3,400	1,354.00	4,603,600
ゼンショーホールディングス	8,500	3,655.00	31,067,500
幸楽苑ホールディングス	1,000	1,062.00	1,062,000
ハークスレイ	800	501.00	400,800
サイゼリヤ	2,600	2,633.00	6,845,800
V Tホールディングス	6,600	478.00	3,154,800
魚力	500	2,048.00	1,024,000
フジ・コーポレーション	900	1,251.00	1,125,900
ユナイテッドアローズ	1,800	1,985.00	3,573,000
ハイデイ日高	2,500	1,850.00	4,625,000
YU-WA Creation Holdings	1,300	221.00	287,300
コロワイド	7,100	1,791.00	12,716,100
ピーシーデポコーポレーション	2,200	290.00	638,000
壱番屋	1,200	4,545.00	5,454,000



P L A N T	400	640.00	256,000
スギホールディングス	3,500	5,890.00	20,615,000
薬王堂ホールディングス	900	2,651.00	2,385,900
スクロール	2,700	694.00	1,873,800
ヨンドシーホールディングス	1,500	1,710.00	2,565,000
木曽路	2,300	2,153.00	4,951,900
S R S ホールディングス	2,600	879.00	2,285,400
千趣会	2,900	398.00	1,154,200
リテールパートナーズ	2,300	1,188.00	2,732,400
ケーヨー	3,200	895.00	2,864,000
上新電機	1,700	1,918.00	3,260,600
日本瓦斯	8,300	2,117.00	17,571,100
ロイヤルホールディングス	3,000	2,324.00	6,972,000
東天紅	200	804.00	160,800
いなげや	1,700	1,118.00	1,900,600
チヨダ	1,500	720.00	1,080,000
ライフコーポレーション	1,400	2,260.00	3,164,000
リンガーハット	2,000	2,139.00	4,278,000
M r M a x H D	2,200	682.00	1,500,400
A O K I ホールディングス	3,400	717.00	2,437,800
オークワ	2,500	912.00	2,280,000
コメリ	2,700	2,637.00	7,119,900
青山商事	3,300	1,032.00	3,405,600
しまむら	2,000	12,200.00	24,400,000
はせがわ	1,000	416.00	416,000
高島屋	11,700	1,812.00	21,200,400
松屋	2,900	1,008.00	2,923,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,500	1,247.00	9,352,500
近鉄百貨店	500	2,482.00	1,241,000
丸井グループ	12,500	2,431.00	30,387,500
アクシアル リテイリング	1,200	3,455.00	4,146,000
イオン	57,200	2,765.50	158,186,600
イズミ	2,700	3,015.00	8,140,500
平和堂	2,600	1,879.00	4,885,400
フジ	3,800	1,831.00	6,957,800
ヤオコー	2,000	6,390.00	12,780,000
ゼビオホールディングス	2,400	1,007.00	2,416,800
ケーズホールディングス	14,800	1,163.00	17,212,400
O l y m p i c グループ	800	513.00	410,400
日産東京販売ホールディングス	2,600	269.00	699,400
シルバーライフ	400	1,420.00	568,000
Genky DrugStores	800	3,690.00	2,952,000

ナルミヤ・インターナショナル	400	837.00	334,800
ブックオフグループホールディングス	1,000	1,188.00	1,188,000
ギフトホールディングス	300	3,180.00	954,000
アインホールディングス	2,100	6,360.00	13,356,000
元気寿司	500	3,240.00	1,620,000
ヤマダホールディングス	61,400	487.00	29,901,800
アーケランズ	2,700	1,529.00	4,128,300
ニトリホールディングス	6,900	13,355.00	92,149,500
愛眼	1,400	178.00	249,200
ケーユーホールディングス	900	1,207.00	1,086,300
吉野家ホールディングス	6,100	2,283.00	13,926,300
松屋フーズホールディングス	800	4,000.00	3,200,000
サガミホールディングス	2,500	1,203.00	3,007,500
関西フードマーケット	1,400	1,439.00	2,014,600
王将フードサービス	1,200	6,320.00	7,584,000
プレナス	2,000	2,635.00	5,270,000
ミニストップ	1,300	1,412.00	1,835,600
アークス	3,100	1,978.00	6,131,800
パローホールディングス	3,600	1,735.00	6,246,000
ベルク	800	5,590.00	4,472,000
大庄	900	1,026.00	923,400
ファーストリテイリング	2,300	83,190.00	191,337,000
サンドラッグ	6,500	3,445.00	22,392,500
サクスパー ホールディングス	1,700	705.00	1,198,500
ヤマザワ	400	1,192.00	476,800
やまや	400	2,492.00	996,800
ベルーナ	3,800	728.00	2,766,400
いよぎんホールディングス	19,400	729.00	14,142,600
しずおかフィナンシャルグループ	35,800	967.00	34,618,600
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	12,200	910.00	11,102,000
島根銀行	600	454.00	272,400
じもとホールディングス	1,200	448.00	537,600
めぶきフィナンシャルグループ	71,400	296.00	21,134,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	2,226.00	4,452,000
九州フィナンシャルグループ	30,400	396.00	12,038,400
ゆうちょ銀行	40,900	1,002.00	40,981,800
富山第一銀行	3,900	435.00	1,696,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	85,900	482.00	41,403,800
西日本フィナンシャルホールディングス	9,200	789.00	7,258,800
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,510.00	2,114,000
第四北越フィナンシャルグループ	2,500	2,694.00	6,735,000
ひろぎんホールディングス	22,200	633.00	14,052,600

おきなわフィナンシャルグループ	1,500	2,086.00	3,129,000	
十六フィナンシャルグループ	2,000	2,587.00	5,174,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,400	5,040.00	7,056,000	
プロクレアホールディングス	1,800	2,207.00	3,972,600	
あいちフィナンシャルグループ	2,100	2,002.00	4,204,200	
新生銀行	11,300	2,251.00	25,436,300	
あおぞら銀行	9,700	2,592.00	25,142,400	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,016,300	709.40	720,963,220	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	183,700	580.20	106,582,740	
三井住友トラスト・ホールディングス	28,800	4,358.00	125,510,400	
三井住友フィナンシャルグループ	112,700	4,212.00	474,692,400	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	49,000	857.00	41,993,000	
群馬銀行	27,900	416.00	11,606,400	
武蔵野銀行	2,200	1,785.00	3,927,000	
千葉興業銀行	3,700	297.00	1,098,900	
筑波銀行	6,800	195.00	1,326,000	
七十七銀行	4,600	1,872.00	8,611,200	
秋田銀行	1,000	1,663.00	1,663,000	
山形銀行	1,600	1,056.00	1,689,600	
岩手銀行	1,100	1,844.00	2,028,400	
東邦銀行	12,500	209.00	2,612,500	
東北銀行	800	964.00	771,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	12,500	2,660.00	33,250,000	
スルガ銀行	15,200	403.00	6,125,600	
八十二銀行	32,200	496.00	15,971,200	
山梨中央銀行	1,800	1,089.00	1,960,200	
大垣共立銀行	3,000	1,807.00	5,421,000	
福井銀行	1,400	1,371.00	1,919,400	
清水銀行	600	1,455.00	873,000	
富山銀行	300	1,646.00	493,800	
滋賀銀行	2,800	2,667.00	7,467,600	
南都銀行	2,300	2,197.00	5,053,100	
百五銀行	14,500	336.00	4,872,000	
京都銀行	5,400	5,690.00	30,726,000	
紀陽銀行	5,200	1,476.00	7,675,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	9,800	918.00	8,996,400	
山陰合同銀行	9,700	740.00	7,178,000	
鳥取銀行	600	1,094.00	656,400	
百十四銀行	1,600	1,724.00	2,758,400	
四国銀行	2,300	878.00	2,019,400	
阿波銀行	2,300	1,923.00	4,422,900	

大分銀行	900	1,849.00	1,664,100
宮崎銀行	900	2,276.00	2,048,400
佐賀銀行	900	1,564.00	1,407,600
琉球銀行	3,800	792.00	3,009,600
セブン銀行	51,500	273.00	14,059,500
みずほフィナンシャルグループ	208,200	1,627.50	338,845,500
高知銀行	600	644.00	386,400
山口フィナンシャルグループ	17,300	809.00	13,995,700
長野銀行	500	1,221.00	610,500
名古屋銀行	1,100	3,135.00	3,448,500
北洋銀行	21,700	244.00	5,294,800
大光銀行	500	1,159.00	579,500
愛媛銀行	2,300	884.00	2,033,200
トマト銀行	600	982.00	589,200
京葉銀行	7,300	514.00	3,752,200
栃木銀行	7,800	315.00	2,457,000
北日本銀行	500	1,885.00	942,500
東和銀行	2,900	530.00	1,537,000
福島銀行	1,900	215.00	408,500
大東銀行	800	625.00	500,000
トモニホールディングス	12,600	333.00	4,195,800
フィデアホールディングス	1,600	1,320.00	2,112,000
池田泉州ホールディングス	18,500	221.00	4,088,500
F P G	5,900	1,168.00	6,891,200
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,200	1,351.00	1,621,200
マーキュリアホールディングス	1,000	612.00	612,000
S B Iホールディングス	21,400	2,668.00	57,095,200
ジャフコ グループ	6,000	2,336.00	14,016,000
大和証券グループ本社	111,500	576.60	64,290,900
野村ホールディングス	265,200	479.00	127,030,800
岡三証券グループ	12,600	333.00	4,195,800
丸三証券	5,200	419.00	2,178,800
東洋証券	5,300	239.00	1,266,700
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	17,300	345.00	5,968,500
光世証券	400	378.00	151,200
水戸証券	4,200	240.00	1,008,000
いちよし証券	2,900	612.00	1,774,800
松井証券	8,600	777.00	6,682,200
マネックスグループ	14,700	493.00	7,247,100
極東証券	2,000	653.00	1,306,000
岩井コスモホールディングス	1,700	1,252.00	2,128,400
アイザワ証券グループ	2,400	664.00	1,593,600

マネーパートナーズグループ	1,900	282.00	535,800
スパークス・グループ	1,600	1,444.00	2,310,400
かんぽ生命保険	17,500	2,182.00	38,185,000
S O M P Oホールディングス	24,700	6,150.00	151,905,000
アニコム ホールディングス	5,300	584.00	3,095,200
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	35,700	3,959.00	141,336,300
第一生命ホールディングス	84,600	2,363.00	199,909,800
東京海上ホールディングス	144,900	2,659.50	385,361,550
T & Dホールディングス	38,600	1,445.00	55,777,000
アドバンスクリエイト	800	975.00	780,000
全国保証	4,100	4,820.00	19,762,000
あんしん保証	700	253.00	177,100
ジェイリース	600	2,681.00	1,608,600
イントラスト	800	629.00	503,200
日本モーゲージサービス	1,000	836.00	836,000
C a s a	600	836.00	501,600
アルヒ	2,600	1,396.00	3,629,600
プレミアグループ	2,700	1,618.00	4,368,600
ネットプロテクションズホールディングス	5,300	454.00	2,406,200
クレディセゾン	10,100	1,562.00	15,776,200
芙蓉総合リース	1,500	8,220.00	12,330,000
みずほリース	2,200	3,205.00	7,051,000
東京センチュリー	2,700	4,940.00	13,338,000
日本証券金融	6,800	872.00	5,929,600
アイフル	29,100	393.00	11,436,300
リコーリース	1,500	3,620.00	5,430,000
イオンフィナンシャルサービス	9,400	1,437.00	13,507,800
アコム	34,200	322.00	11,012,400
ジャックス	1,700	3,590.00	6,103,000
オリエントコーポレーション	4,600	1,154.00	5,308,400
オリックス	103,200	2,166.50	223,582,800
三菱H C キャピタル	56,100	640.00	35,904,000
九州リースサービス	800	617.00	493,600
日本取引所グループ	40,400	2,000.00	80,800,000
イー・ギャランティ	2,600	2,428.00	6,312,800
アサックス	900	577.00	519,300
N E C キャピタルソリューション	700	2,107.00	1,474,900
大東建託	5,700	14,140.00	80,598,000
いちご	19,700	331.00	6,520,700
日本駐車場開発	17,800	242.00	4,307,600
スター・マイカ・ホールディングス	700	1,414.00	989,800
S R E ホールディングス	500	3,865.00	1,932,500

A Dワークスグループ	4,700	164.00	770,800
ヒューリック	33,600	1,050.00	35,280,000
三栄建築設計	800	1,531.00	1,224,800
野村不動産ホールディングス	9,000	3,370.00	30,330,000
三重交通グループホールディングス	3,800	516.00	1,960,800
サムティ	2,300	2,336.00	5,372,800
ディア・ライフ	2,300	617.00	1,419,100
コーセーアールイー	700	661.00	462,700
地主	1,200	2,005.00	2,406,000
プレサンスコーポレーション	2,000	1,502.00	3,004,000
T H E グローバル社	1,500	250.00	375,000
ハウスコム	500	1,004.00	502,000
J P M C	800	1,019.00	815,200
サンセイランディック	600	858.00	514,800
エストラスト	400	576.00	230,400
フージャースホールディングス	2,400	779.00	1,869,600
オープンハウスグループ	5,300	5,300.00	28,090,000
東急不動産ホールディングス	47,300	756.00	35,758,800
飯田グループホールディングス	14,200	2,118.00	30,075,600
イーランド	300	1,666.00	499,800
ムゲンエステート	1,300	474.00	616,200
ビーロッド	1,300	553.00	718,900
ファーストブラザーズ	500	890.00	445,000
A n d D oホールディングス	1,000	872.00	872,000
シーアールイー	700	1,329.00	930,300
プロパティエージェント	300	1,362.00	408,600
ケイアイスター不動産	800	4,690.00	3,752,000
アグレ都市デザイン	400	1,511.00	604,400
グッドコムアセット	700	1,588.00	1,111,600
ジェイ・エス・ビー	400	3,875.00	1,550,000
ロードスターキャピタル	700	1,690.00	1,183,000
テンポイノベーション	600	927.00	556,200
グローバル・リンク・マネジメント	500	1,009.00	504,500
フェイスネットワーク	300	1,329.00	398,700
パーク24	11,300	1,934.00	21,854,200
パラカ	600	1,873.00	1,123,800
三井不動産	67,800	2,827.50	191,704,500
三菱地所	98,900	1,868.50	184,794,650
平和不動産	2,800	4,060.00	11,368,000
東京建物	13,800	2,037.00	28,110,600
京阪神ビルディング	2,400	1,251.00	3,002,400
住友不動産	31,300	3,406.00	106,607,800

テオーシー	2,800	756.00	2,116,800
東京楽天地	300	4,245.00	1,273,500
スターツコーポレーション	2,400	2,585.00	6,204,000
フジ住宅	2,200	626.00	1,377,200
空港施設	1,900	547.00	1,039,300
明和地所	1,000	612.00	612,000
ゴールドクレスト	1,400	1,743.00	2,440,200
エスリード	700	1,765.00	1,235,500
日神グループホールディングス	3,100	434.00	1,345,400
日本エスコン	3,400	819.00	2,784,600
MIRARTHホールディングス	7,600	401.00	3,047,600
AVANTIA	1,000	789.00	789,000
イオンモール	8,800	1,602.00	14,097,600
毎日コムネット	800	680.00	544,000
ファースト住建	800	1,094.00	875,200
カチタス	4,300	3,235.00	13,910,500
トーセイ	2,500	1,363.00	3,407,500
サンフロンティア不動産	2,500	1,130.00	2,825,000
FJネクストホールディングス	1,800	999.00	1,798,200
インテリックス	600	544.00	326,400
ランドビジネス	1,100	226.00	248,600
グランディハウス	1,400	554.00	775,600
日本空港ビルデング	5,600	6,220.00	34,832,000
明豊ファシリティワークス	800	675.00	540,000
日本工営	1,100	3,380.00	3,718,000
LIFULL	5,000	165.00	825,000
MIXI	3,800	2,341.00	8,895,800
ジェイエイシーリクルートメント	1,400	2,415.00	3,381,000
日本M&Aセンターホールディングス	27,600	1,790.00	49,404,000
メンバーズ	400	2,786.00	1,114,400
中広	300	425.00	127,500
UTグループ	2,400	2,391.00	5,738,400
アイティメディア	800	1,774.00	1,419,200
E・Jホールディングス	1,000	1,268.00	1,268,000
夢真ビーネックスグループ	5,500	1,774.00	9,757,000
コシダカホールディングス	4,500	1,052.00	4,734,000
アルトナー	400	1,021.00	408,400
パソナグループ	1,800	1,977.00	3,558,600
CDS	400	1,829.00	731,600
リンクアンドモチベーション	4,300	875.00	3,762,500
エス・エム・エス	5,700	3,280.00	18,696,000
サニーサイドアップグループ	600	581.00	348,600

パーソルホールディングス	16,800	2,988.00	50,198,400
リニカル	900	742.00	667,800
クックパッド	4,100	203.00	832,300
エスクリ	800	364.00	291,200
アイ・ケイ・ケイホールディングス	800	629.00	503,200
学情	700	1,377.00	963,900
スタジオアリス	800	2,073.00	1,658,400
シミックホールディングス	800	1,686.00	1,348,800
エプコ	400	655.00	262,000
N J S	300	2,055.00	616,500
総合警備保障	6,100	3,755.00	22,905,500
カカクコム	12,300	2,581.00	31,746,300
アイロムグループ	600	2,588.00	1,552,800
セントケア・ホールディング	1,100	842.00	926,200
サイネックス	300	576.00	172,800
ルネサンス	1,100	939.00	1,032,900
ディップ	3,000	4,115.00	12,345,000
デジタルホールディングス	1,200	1,171.00	1,405,200
新日本科学	2,000	2,778.00	5,556,000
キャリアデザインセンター	400	1,494.00	597,600
ベネフィット・ワン	6,100	2,257.00	13,767,700
エムスリー	29,700	4,454.00	132,283,800
ツカダ・グローバルホールディング	1,000	370.00	370,000
プラス	200	930.00	186,000
アウトソーシング	8,900	1,159.00	10,315,100
ウェルネット	1,400	663.00	928,200
ワールドホールディングス	700	2,585.00	1,809,500
ディー・エヌ・エー	6,400	1,975.00	12,640,000
博報堂D Yホールディングス	21,300	1,305.00	27,796,500
ぐるなび	2,400	433.00	1,039,200
タカミヤ	2,000	393.00	786,000
ジャパンベストレスキューシステム	900	771.00	693,900
ファンコミュニケーションズ	2,900	443.00	1,284,700
ライク	500	1,917.00	958,500
ビジネス・ブレークスルー	700	402.00	281,400
エスプール	4,300	955.00	4,106,500
W D Bホールディングス	800	2,537.00	2,029,600
ティア	1,000	426.00	426,000
C D G	200	1,216.00	243,200
アドウェイズ	2,100	763.00	1,602,300
バリューコマース	1,100	2,296.00	2,525,600
インフォマート	15,700	477.00	7,488,900



J Pホールディングス	4,300	294.00	1,264,200
エコナックホールディングス	3,100	91.00	282,100
C Lホールディングス	400	861.00	344,400
プレステージ・インターナショナル	6,300	680.00	4,284,000
アミューズ	900	1,817.00	1,635,300
ドリームインキュベータ	500	2,230.00	1,115,000
クイック	1,000	1,891.00	1,891,000
T A C	900	208.00	187,200
電通グループ	15,800	4,810.00	75,998,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	800	1,638.00	1,310,400
ぴあ	500	3,315.00	1,657,500
イオンファンタジー	600	3,010.00	1,806,000
シーティーエス	1,900	791.00	1,502,900
ネクシィーズグループ	500	678.00	339,000
H . U . グループホールディングス	4,400	2,769.00	12,183,600
アルプス技研	1,300	2,012.00	2,615,600
ダイオーズ	300	1,497.00	449,100
日本空調サービス	1,700	741.00	1,259,700
オリエンタルランド	17,900	19,175.00	343,232,500
ダスキン	3,600	2,888.00	10,396,800
明光ネットワークジャパン	1,900	602.00	1,143,800
ファルコホールディングス	700	1,765.00	1,235,500
秀英予備校	400	446.00	178,400
ラウンドワン	14,100	622.00	8,770,200
リゾートトラスト	7,100	2,224.00	15,790,400
ビー・エム・エル	2,200	3,450.00	7,590,000
りらいあコミュニケーションズ	2,500	1,000.00	2,500,000
リソー教育	7,700	305.00	2,348,500
早稲田アカデミー	900	1,162.00	1,045,800
ユー・エス・エス	18,800	2,226.00	41,848,800
東京個別指導学院	1,500	510.00	765,000
サイバーエージェント	35,900	1,295.00	46,490,500
楽天グループ	69,400	672.00	46,636,800
クリーク・アンド・リバー社	900	2,025.00	1,822,500
モーニングスター	2,900	466.00	1,351,400
テー・オー・ダブリュ	3,100	307.00	951,700
山田コンサルティンググループ	800	1,216.00	972,800
セントラルスポーツ	600	2,398.00	1,438,800
フルキャストホールディングス	1,400	2,950.00	4,130,000
エン・ジャパン	3,000	2,611.00	7,833,000
リソルホールディングス	200	4,460.00	892,000
テクノプロ・ホールディングス	10,100	3,445.00	34,794,500

アトラグループ	400	191.00	76,400
インターワークス	500	389.00	194,500
アイ・アールジャパンホールディングス	800	2,202.00	1,761,600
K e e P e r 技研	1,100	3,795.00	4,174,500
ファーストロジック	300	800.00	240,000
三機サービス	300	934.00	280,200
G u n o s y	900	650.00	585,000
デザインワン・ジャパン	500	206.00	103,000
イー・ガーディアン	600	3,025.00	1,815,000
リブセンス	800	291.00	232,800
ジャパンマテリアル	5,200	1,917.00	9,968,400
ベクトル	2,400	1,097.00	2,632,800
ウチヤマホールディングス	900	300.00	270,000
チャーム・ケア・コーポレーション	1,200	1,077.00	1,292,400
キャリアリンク	600	2,432.00	1,459,200
I B J	900	975.00	877,500
アサンテ	700	1,586.00	1,110,200
バリューHR	1,300	1,565.00	2,034,500
M & A キャピタルパートナーズ	1,400	3,755.00	5,257,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,057.00	739,900
E R I ホールディングス	500	1,075.00	537,500
アビスト	300	2,864.00	859,200
シグマクシス・ホールディングス	2,000	1,175.00	2,350,000
ウィルグループ	1,200	1,440.00	1,728,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,900	148.00	281,200
メドピア	1,200	1,551.00	1,861,200
レアジョブ	300	1,003.00	300,900
リクルートホールディングス	120,500	4,621.00	556,830,500
エラン	2,000	1,126.00	2,252,000
土木管理総合試験所	700	309.00	216,300
ネットマーケティング	800	898.00	718,400
日本郵政	183,800	998.60	183,542,680
ベルシステム24ホールディングス	2,400	1,421.00	3,410,400
鎌倉新書	1,900	800.00	1,520,000
S M N	400	494.00	197,600
一蔵	200	478.00	95,600
グローバルキッズCOMPANY	300	577.00	173,100
エアトリ	1,000	2,475.00	2,475,000
アトラエ	1,200	1,495.00	1,794,000
ストライク	700	3,990.00	2,793,000
ソラスト	4,100	888.00	3,640,800
セラク	600	1,200.00	720,000

インソース	1,900	2,933.00	5,572,700
ペイカレント・コンサルティング	1,200	39,700.00	47,640,000
Orchestra Holdings	300	2,472.00	741,600
アイモバイル	800	1,181.00	944,800
キャリアインデックス	600	419.00	251,400
MS - Japan	700	820.00	574,000
船場	300	776.00	232,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,300	1,744.00	9,243,200
フルテック	300	1,131.00	339,300
グリーンズ	600	938.00	562,800
ツナググループ・ホールディングス	500	436.00	218,000
GameWith	500	370.00	185,000
MS&Consulting	200	632.00	126,400
ウェルビー	1,100	933.00	1,026,300
エル・ティー・エス	200	3,090.00	618,000
ミダックホールディングス	800	3,695.00	2,956,000
日総工産	1,300	563.00	731,900
キュービーネットホールディングス	800	1,298.00	1,038,400
RPAホールディングス	2,400	304.00	729,600
スプリックス	600	946.00	567,600
マネジメントソリューションズ	800	2,993.00	2,394,400
プロレド・パートナーズ	400	531.00	212,400
and factory	500	412.00	206,000
テノ・ホールディングス	200	568.00	113,600
フロンティア・マネジメント	500	1,213.00	606,500
ピアラ	300	692.00	207,600
コプロ・ホールディングス	300	894.00	268,200
ギークス	300	826.00	247,800
カーブスホールディングス	4,600	867.00	3,988,200
フォーラムエンジニアリング	1,000	925.00	925,000
Fast Fitness Japan	300	1,428.00	428,400
ダイレクトマーケティングミックス	1,700	1,699.00	2,888,300
ポピンズ	200	1,574.00	314,800
LITALICO	1,400	3,050.00	4,270,000
アドバンテッジリスクマネジメント	800	430.00	344,000
リログループ	9,200	2,141.00	19,697,200
東祥	1,300	1,115.00	1,449,500
ビーウィズ	500	1,173.00	586,500
TREホールディングス	3,100	1,598.00	4,953,800
人・夢・技術グループ	700	2,678.00	1,874,600
エイチ・アイ・エス	3,900	2,034.00	7,932,600
ラックランド	500	2,774.00	1,387,000

共立メンテナンス	3,000	5,830.00	17,490,000
イチネンホールディングス	1,700	1,276.00	2,169,200
建設技術研究所	800	2,976.00	2,380,800
スペース	1,100	873.00	960,300
燦ホールディングス	700	1,718.00	1,202,600
スバル興業	100	8,500.00	850,000
東京テアトル	600	1,114.00	668,400
タナベコンサルティンググループ	600	623.00	373,800
ナガワ	500	7,300.00	3,650,000
東京都競馬	1,300	3,865.00	5,024,500
常盤興産	600	1,185.00	711,000
カナモト	2,700	2,125.00	5,737,500
西尾レントオール	1,400	3,005.00	4,207,000
トランス・コスモス	2,100	3,545.00	7,444,500
乃村工藝社	7,200	1,066.00	7,675,200
藤田観光	700	3,045.00	2,131,500
KNT-CTホールディングス	1,000	1,647.00	1,647,000
日本管財	1,800	2,500.00	4,500,000
トーカイ	1,300	1,860.00	2,418,000
白洋舎	200	1,562.00	312,400
セコム	16,600	8,649.00	143,573,400
セントラル警備保障	800	2,533.00	2,026,400
丹青社	3,200	811.00	2,595,200
メイテック	6,000	2,472.00	14,832,000
応用地質	1,500	2,222.00	3,333,000
船井総研ホールディングス	3,200	2,635.00	8,432,000
進学会ホールディングス	600	311.00	186,600
オオバ	1,000	690.00	690,000
いであ	400	1,530.00	612,000
学究社	500	1,645.00	822,500
ベネッセホールディングス	5,600	2,164.00	12,118,400
イオンディライト	1,900	2,972.00	5,646,800
ナック	800	919.00	735,200
ダイセキ	3,100	4,505.00	13,965,500
ステップ	600	1,898.00	1,138,800
合計	18,053,000		43,156,227,610

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

#### 貸借対照表

	（単位：円）	
	2021年10月26日現在	2022年10月26日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	1,114,800,728	128,867,914
コール・ローン	1,256,678,700	1,593,648,861
株式	245,047,142,640	248,313,230,169
投資証券	5,776,317,242	5,675,069,108
派生商品評価勘定	115,983,661	142,436,979
未収入金	35,090,957	64,092,962
未収配当金	150,233,334	187,388,237
差入委託証拠金	619,735,003	2,133,240,976
流動資産合計	254,115,982,265	258,237,975,206
資産合計	254,115,982,265	258,237,975,206
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	410,255	4,718,761
未払金	-	67,885,745
未払解約金	59,987,211	115,966,485
未払利息	502	2,591
流動負債合計	60,397,968	188,573,582
負債合計	60,397,968	188,573,582
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	61,697,952,086	58,419,890,528
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	192,357,632,211	199,629,511,096
元本等合計	254,055,584,297	258,049,401,624
純資産合計	254,055,584,297	258,049,401,624
負債純資産合計	254,115,982,265	258,237,975,206

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>（2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券</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10月26日現在	2022年10月26日現在
1.	期首	2020年10月27日	2021年10月27日
	期首元本額	81,609,225,737円	61,697,952,086円
	期首からの追加設定元本額	5,464,327,155円	10,737,486,481円
	期首からの一部解約元本額	25,375,600,806円	14,015,548,039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）	25,040,493,433円	29,264,146,292円
	DCインデックスバランス（株式20）	114,212,302円	122,426,648円
	DCインデックスバランス（株式40）	306,565,733円	324,451,133円
	DCインデックスバランス（株式60）	606,000,742円	642,259,230円
	DCインデックスバランス（株式80）	652,726,376円	699,491,289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	1,505,111,876円	1,452,645,742円
	日興五大陸株式ファンド	3,965,095,222円	3,657,320,915円
	インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）	19,546,879円	14,318,011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	90,192,400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）	6,102,747,886円	5,927,380,507円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	16,508,539,257円	10,069,193,942円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	3,671,912円	-円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	3,199,083円	-円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	4,003,307円	-円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	3,267,649円	-円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	2,406,816,230円	1,821,226,129円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	19,521,661円	18,154,493円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	57,058,720円	51,457,152円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	88,910,634円	78,434,511円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	84,283,948円	76,968,989円
インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	4,101,619,144円	4,109,823,145円
計	61,697,952,086円	58,419,890,528円
2. 受益権の総数	61,697,952,086口	58,419,890,528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10月27日 至 2021年10月26日	自 2021年10月27日 至 2022年10月26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10月26日現在	2022年10月26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)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 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)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

（2021年10月26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	55,907,720,977
投資証券	1,338,897,771
合計	57,246,618,748

（2022年10月26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	44,792,393,104
投資証券	1,779,397,198
合計	46,571,790,302

（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10月26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	3,142,497,754	-	3,227,480,865	84,983,111
合計		3,142,497,754	-	3,227,480,865	84,983,111

(2022年10月26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	4,791,256,524	-	4,904,733,499	113,476,975
合計		4,791,256,524	-	4,904,733,499	113,476,975

## (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10月26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	1,384,511,650	-	1,415,107,120	30,595,470

	米ドル	1,031,861,900	-	1,058,362,900	26,501,000
	ユーロ	352,649,750	-	356,744,220	4,094,470
	売建	36,016,988	-	36,022,163	5,175
	英債券	36,016,988	-	36,022,163	5,175
	合計	1,420,528,638	-	1,451,129,283	30,590,295

(2022年10月26日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,493,474,647	-	2,517,715,890	24,241,243
	米ドル	1,876,457,070	-	1,892,892,070	16,435,000
	ユーロ	617,017,577	-	624,823,820	7,806,243
	合計	2,493,474,647	-	2,517,715,890	24,241,243

## (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10月26日現在		2022年10月26日現在	
1口当たり純資産額	4.1177円	1口当たり純資産額	4.4171円
(1万口当たり純資産額)	(41,177円)	(1万口当たり純資産額)	(44,171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	45.20	576,300.00	
	BAKER HUGHES CO	37,155	26.10	969,745.50	
	CHENIERE ENERGY INC	8,600	169.28	1,455,808.00	
	CHEVRON CORP	69,641	174.93	12,182,300.13	
	CONOCOPHILLIPS	48,276	123.94	5,983,327.44	
	COTERRA ENERGY INC	30,170	30.15	909,625.50	
	DEVON ENERGY CORPORATION	23,510	75.51	1,775,240.10	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	6,310	153.36	967,701.60	
	EOG RESOURCES INC	21,842	132.00	2,883,144.00	
	EQT CORP	12,660	39.60	501,336.00	
	EXXON MOBIL CORP	157,171	105.88	16,641,265.48	
	HALLIBURTON CO	33,827	34.98	1,183,268.46	
	HESS CORP	10,280	135.75	1,395,510.00	
	KINDER MORGAN INC	75,410	17.51	1,320,429.10	
	MARATHON OIL CORP	26,600	29.65	788,690.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	20,282	111.44	2,260,226.08	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	35,111	71.09	2,496,040.99	
	ONEOK INC	16,840	57.59	969,815.60	
	PHILLIPS 66	17,805	100.22	1,784,417.10	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,590	264.83	2,274,889.70	
	SCHLUMBERGER LTD	52,391	52.47	2,748,955.77	
	TARGA RESOURCES CORP	8,180	66.72	545,769.60	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	230	2,066.92	475,391.60	
	VALERO ENERGY CORP	15,292	126.80	1,939,025.60	
WILLIAMS COS INC	44,904	31.85	1,430,192.40		
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,220	251.56	2,067,823.20		

ALBEMARLE CORP	4,365	281.43	1,228,441.95
ALCOA CORP	6,700	41.49	277,983.00
AMCOR PLC	54,600	11.47	626,262.00
AVERY DENNISON CORP	3,040	177.01	538,110.40
BALL CORP	11,780	48.42	570,387.60
CELANESE CORP	4,090	96.02	392,721.80
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,820	107.70	842,214.00
CLEVELAND-CLIFFS INC	19,100	14.30	273,130.00
CORTEVA INC	27,272	64.96	1,771,589.12
CROWN HOLDINGS INC	4,565	70.69	322,699.85
DOW INC	27,325	47.85	1,307,501.25
DUPONT DE NEMOURS INC	19,162	56.96	1,091,467.52
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,815	75.45	363,291.75
ECOLAB INC	9,560	152.99	1,462,584.40
FMC CORP	4,840	118.65	574,266.00
FREEMPORT-MCMORAN INC	53,568	31.67	1,696,498.56
INTERNATIONAL PAPER CO	12,760	33.44	426,694.40
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,645	96.16	927,463.20
LINDE PLC	18,760	288.18	5,406,256.80
LYONDELLBASELL INDU-CL A	9,750	81.90	798,525.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,360	332.79	785,384.40
MOSAIC CO/THE	13,580	53.63	728,295.40
NEWMONT CORP	29,592	42.72	1,264,170.24
NUCOR CORP	9,989	136.51	1,363,598.39
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	115.93	415,029.40
PPG INDUSTRIES INC	8,774	112.96	991,111.04
RPM INTERNATIONAL INC	4,960	92.87	460,635.20
SEALED AIR CORP	5,746	47.62	273,624.52
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,151	220.20	2,015,050.20
STEEL DYNAMICS INC	7,140	97.71	697,649.40
VULCAN MATERIALS CO	4,923	162.28	798,904.44
WESTLAKE CORP	1,360	97.41	132,477.60
WESTROCK CO	9,989	33.48	334,431.72
3M CO	20,726	118.50	2,456,031.00
AERCAP HOLDINGS NV	4,850	51.31	248,853.50

ALLEGION PLC	3,340	97.54	325,783.60
AMETEK INC	8,533	123.04	1,049,900.32
BOEING CO/THE	20,942	146.65	3,071,144.30
CARLISLE COS INC	1,910	282.01	538,639.10
CARRIER GLOBAL CORP	31,608	37.29	1,178,662.32
CATERPILLAR INC	19,896	194.84	3,876,536.64
CUMMINS INC	5,195	234.68	1,219,162.60
DEERE & CO	10,840	391.63	4,245,269.20
DOVER CORP	5,350	127.29	681,001.50
EATON CORP PLC	14,906	146.05	2,177,021.30
EMERSON ELECTRIC CO	22,040	84.55	1,863,482.00
FASTENAL CO	21,616	47.20	1,020,275.20
FORTIVE CORP	12,674	63.91	809,995.34
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,050	58.83	297,091.50
GENERAC HOLDINGS INC	2,440	121.29	295,947.60
GENERAL DYNAMICS CORP	8,812	245.75	2,165,549.00
GENERAL ELECTRIC CO	40,727	73.00	2,973,071.00
HEICO CORP	1,800	159.01	286,218.00
HEICO CORP-CLASS A	2,480	125.43	311,066.40
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	25,486	189.65	4,833,419.90
HOWMET AEROSPACE INC	13,763	35.57	489,549.91
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,530	252.71	386,646.30
IDEX CORP	2,880	212.34	611,539.20
ILLINOIS TOOL WORKS	11,495	205.87	2,366,475.65
INGERSOLL-RAND INC	15,158	48.89	741,074.62
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5,770	45.07	260,053.90
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	25,894	57.18	1,480,618.92
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,220	248.23	1,792,220.60
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,145	235.55	269,704.75
LOCKHEED MARTIN CORP	8,961	460.15	4,123,404.15
MASCO CORP	8,489	48.34	410,358.26
NORDSON CORP	1,895	223.46	423,456.70
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,534	526.75	2,915,034.50
OTIS WORLDWIDE CORP	15,644	68.85	1,077,089.40
OWENS CORNING	3,550	89.39	317,334.50

PACCAR INC	12,924	91.74	1,185,647.76
PARKER HANNIFIN CORP	4,775	281.86	1,345,881.50
PENTAIR PLC	5,998	42.23	253,295.54
PLUG POWER INC	19,280	16.57	319,469.60
QUANTA SERVICES INC	5,300	142.35	754,455.00
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	55,516	88.36	4,905,393.76
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,303	241.65	1,039,819.95
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	5,670	39.46	223,738.20
SMITH (A.O.) CORP	5,020	52.10	261,542.00
SNAP-ON INC	1,975	218.24	431,024.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,806	78.89	458,035.34
TEXTRON INC	7,956	64.37	512,127.72
TRANE TECHNOLOGIES PLC	8,696	153.96	1,338,836.16
TRANSDIGM GROUP INC	1,940	555.04	1,076,777.60
UNITED RENTALS INC	2,665	294.94	786,015.10
WABTEC CORP	6,470	89.98	582,170.60
WW GRAINGER INC	1,667	530.80	884,843.60
XYLEM INC	6,678	98.22	655,913.16
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,070	101.48	514,503.60
CINTAS CORP	3,457	410.39	1,418,718.23
CLARIVATE PLC	10,850	10.13	109,910.50
COPART INC	7,850	113.63	891,995.50
COSTAR GROUP INC	14,910	74.50	1,110,795.00
EQUIFAX INC	4,574	161.48	738,609.52
JACOBS SOLUTIONS INC	4,880	112.59	549,439.20
LEIDOS HOLDINGS INC	4,960	97.31	482,657.60
REPUBLIC SERVICES INC	8,130	135.13	1,098,606.90
ROBERT HALF INTL INC	3,975	74.75	297,131.25
ROLLINS INC	8,265	35.94	297,044.10
TRANSUNION	7,270	57.39	417,225.30
VERISK ANALYTICS INC	5,800	173.82	1,008,156.00
WASTE CONNECTIONS INC	9,566	132.58	1,268,260.28
WASTE MANAGEMENT INC	15,584	165.05	2,572,139.20
AMERCO	375	577.80	216,675.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,930	94.80	467,364.00

CSX CORP	80,509	28.76	2,315,438.84
DELTA AIR LINES INC	5,515	33.90	186,958.50
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,147	96.03	590,296.41
FEDEX CORP	9,208	155.80	1,434,606.40
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	38,100	2.40	91,440.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,140	167.23	525,102.20
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5,630	48.10	270,803.00
LYFT INC-A	10,570	14.81	156,541.70
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,825	215.77	1,904,170.25
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,655	274.03	1,001,579.65
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	34.62	189,371.40
UBER TECHNOLOGIES INC	54,310	28.36	1,540,231.60
UNION PACIFIC CORP	23,471	194.61	4,567,691.31
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	27,427	167.00	4,580,309.00
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	2,920	24.42	71,306.40
APTIV PLC	10,100	90.30	912,030.00
BORGWARNER INC	9,120	36.36	331,603.20
FORD MOTOR COMPANY	147,945	12.83	1,898,134.35
GENERAL MOTORS CORP	51,865	37.01	1,919,523.65
LEAR CORP	2,290	136.19	311,875.10
LUCID GROUP INC	16,510	13.92	229,819.20
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	10,770	34.49	371,457.30
TESLA INC	98,525	222.41	21,913,437.87
DR HORTON INC	12,496	75.41	942,323.36
GARMIN LTD	5,865	84.89	497,879.85
HASBRO INC	4,748	66.97	317,973.56
LENNAR CORP-CL A	9,440	78.60	741,984.00
LULULEMON ATHLETICA INC	4,380	320.63	1,404,359.40
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,878	100.24	188,250.72
NEWELL BRANDS INC	14,666	15.72	230,549.52
NIKE INC -CL B	47,418	91.72	4,349,178.96
NVR INC	118	4,278.07	504,812.26
PULTE GROUP INC	8,850	39.55	350,017.50
VF CORP	12,170	28.63	348,427.10
WHIRLPOOL CORP	2,079	137.00	284,823.00

AIRBNB INC-CLASS A	14,000	118.45	1,658,300.00
ARAMARK	8,880	35.04	311,155.20
BOOKING HOLDINGS INC	1,508	1,874.61	2,826,911.88
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,970	42.49	338,645.30
CARNIVAL CORP	35,077	8.62	302,363.74
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,035	1,584.02	1,639,460.70
DARDEN RESTAURANTS INC	4,593	135.97	624,510.21
DOMINO'S PIZZA INC	1,375	328.88	452,210.00
EXPEDIA GROUP INC	5,662	98.71	558,896.02
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,410	130.64	1,359,962.40
LAS VEGAS SANDS CORP	12,900	34.77	448,533.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,413	155.43	1,618,492.59
MCDONALD'S CORP	27,651	255.73	7,071,190.23
MGM RESORTS INTERNATIONAL	12,900	34.19	441,051.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,748	50.90	445,273.20
STARBUCKS CORP	42,874	85.21	3,653,293.54
VAIL RESORTS INC	1,520	219.10	333,032.00
WYNN RESORTS LTD	4,180	57.44	240,099.20
YUM! BRANDS INC	10,554	111.24	1,174,026.96
ACTIVISION BLIZZARD INC	28,960	72.50	2,099,600.00
ALPHABET INC-CL A	224,490	104.48	23,454,715.20
ALPHABET INC-CL C	210,320	104.93	22,068,877.60
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	19,410	6.75	131,017.50
CABLE ONE INC	210	800.99	168,207.90
CHARTER COMMUNICATION-A	4,386	346.71	1,520,670.06
COMCAST CORP-CLASS A	166,354	31.56	5,250,132.24
DISH NETWORK CORP-A	9,279	14.95	138,721.05
ELECTRONIC ARTS INC	10,494	127.74	1,340,503.56
FOX CORP - CLASS A	11,444	29.84	341,488.96
FOX CORP- CLASS B	5,466	28.00	153,048.00
IAC INC	3,090	50.28	155,365.20
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,096	30.07	453,936.72
LIBERTY BROADBAND-C	4,850	79.41	385,138.50
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	3,325	42.45	141,146.25
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	5,726	42.31	242,267.06



LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	7,130	59.01	420,741.30
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,420	81.71	524,578.20
MATCH GROUP INC	9,892	45.43	449,393.56
META PLATFORMS INC-CLASS A	85,520	137.51	11,759,855.20
NETFLIX INC	16,535	291.02	4,812,015.70
NEWS CORP - CLASS A	14,750	17.17	253,257.50
OMNICOM GROUP	7,807	71.71	559,839.97
PARAMOUNT GLOBAL	22,823	19.67	448,928.41
PINTEREST INC- CLASS A	20,950	22.59	473,260.50
ROBLOX CORP -CLASS A	12,670	45.71	579,145.70
ROKU INC	4,700	55.34	260,098.00
SEA LTD-ADR	13,370	50.01	668,633.70
SIRIUS XM HOLDINGS INC	30,280	6.28	190,158.40
SNAP INC - A	40,460	9.60	388,416.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,980	125.03	747,679.40
THE WALT DISNEY CO.	67,792	104.36	7,074,773.12
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	16,510	57.84	954,938.40
TWITTER INC	24,070	52.78	1,270,414.60
WARNER BROS DISCOVERY INC	86,760	13.57	1,177,333.20
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	9,840	46.68	459,331.20
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,158	181.40	391,461.20
AMAZON.COM INC	341,510	120.60	41,186,106.00
AUTOZONE INC	732	2,439.89	1,785,999.48
BATH & BODY WORKS INC	9,270	34.70	321,669.00
BEST BUY CO INC	7,394	65.69	485,711.86
BURLINGTON STORES INC	2,585	140.47	363,114.95
CARMAX INC	5,949	61.85	367,945.65
CHEWY INC - CLASS A	3,410	39.79	135,683.90
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	8,405	250.46	2,105,116.30
DOLLAR TREE INC	8,466	153.90	1,302,917.40
DOORDASH INC - A	6,960	47.46	330,321.60
EBAY INC	20,787	38.97	810,069.39
ETSY INC	4,800	103.24	495,552.00
GENUINE PARTS CO	5,321	171.65	913,349.65
HOME DEPOT INC	38,365	290.26	11,135,824.90

LKQ CORP	10,260	53.90	553,014.00
LOWE'S COS INC	23,902	193.85	4,633,402.70
MERCADOLIBRE INC	1,695	862.97	1,462,734.15
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,450	775.73	1,900,538.50
POOL CORP	1,540	298.54	459,751.60
ROSS STORES INC	13,162	93.07	1,224,987.34
TARGET CORP	17,300	165.80	2,868,340.00
TJX COMPANIES INC	43,686	70.46	3,078,115.56
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,230	214.29	906,446.70
ULTA BEAUTY INC	1,970	395.40	778,938.00
WAYFAIR INC- CLASS A	2,840	34.52	98,036.80
COSTCO WHOLESALE CORP	16,554	499.06	8,261,439.24
KROGER CO	25,910	44.77	1,159,990.70
SYSCO CORP	19,236	82.52	1,587,354.72
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	27,082	35.52	961,952.64
WALMART INC	56,552	140.07	7,921,238.64
ALTRIA GROUP INC	67,748	45.74	3,098,793.52
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	21,073	91.14	1,920,593.22
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,680	66.82	780,457.60
BUNGE LTD	5,577	91.97	512,916.69
CAMPBELL SOUP CO	7,885	51.16	403,396.60
COCA-COLA CO/THE	153,892	58.95	9,071,933.40
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	7,710	46.82	360,982.20
CONAGRA BRANDS INC	18,040	35.04	632,121.60
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,115	238.75	1,459,956.25
GENERAL MILLS INC	22,579	78.30	1,767,935.70
HERSHEY CO/THE	5,395	234.12	1,263,077.40
HORMEL FOODS CORP	11,500	45.16	519,340.00
JM SMUCKER CO/THE	4,100	146.00	598,600.00
KELLOGG CO	9,358	74.09	693,334.22
KEURIG DR PEPPER INC	29,120	38.55	1,122,576.00
KRAFT HEINZ CO/THE	27,151	37.06	1,006,216.06
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,250	76.13	704,202.50
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	6,610	50.57	334,267.70
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	51,915	59.31	3,079,078.65

MONSTER BEVERAGE CORP	14,810	91.66	1,357,484.60
PEPSICO INC	51,671	178.27	9,211,389.17
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	57,938	88.50	5,127,513.00
TYSON FOODS INC-CL A	10,906	67.03	731,029.18
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,090	75.62	687,385.80
CLOROX COMPANY	4,646	140.46	652,577.16
COLGATE-PALMOLIVE CO	29,410	72.76	2,139,871.60
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,580	205.12	1,759,929.60
KIMBERLY-CLARK CORP	12,523	119.49	1,496,373.27
PROCTER & GAMBLE CO	89,579	130.86	11,722,307.94
ABBOTT LABORATORIES	65,396	97.95	6,405,538.20
ABIOMED INC	1,650	264.29	436,078.50
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,840	217.98	619,063.20
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,774	152.77	882,093.98
BAXTER INTERNATIONAL INC	18,739	57.11	1,070,184.29
BECTON DICKINSON AND CO	10,622	225.70	2,397,385.40
BOSTON SCIENTIFIC CORP	53,278	41.30	2,200,381.40
CARDINAL HEALTH INC	10,305	73.72	759,684.60
CENTENE CORP	21,847	83.63	1,827,064.61
CIGNA CORP	11,845	310.92	3,682,847.40
COOPER COS INC/THE	1,715	265.26	454,920.90
CVS HEALTH CORP	48,968	92.22	4,515,828.96
DAVITA INC	2,108	95.44	201,187.52
DENTSPLY SIRONA INC	8,222	30.31	249,208.82
DEXCOM INC	14,640	100.95	1,477,908.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	23,190	85.70	1,987,383.00
ELEVANCE HEALTH INC	9,001	523.95	4,716,073.95
HCA HEALTHCARE INC	8,830	214.40	1,893,152.00
HENRY SCHEIN INC	5,280	69.67	367,857.60
HOLOGIC INC	9,208	65.30	601,282.40
HUMANA INC	4,715	529.46	2,496,403.90
IDEXX LABORATORIES INC	3,150	352.35	1,109,902.50
INSULET CORP	2,600	238.03	618,878.00
INTUITIVE SURGICAL INC	13,395	237.87	3,186,268.65
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,415	228.21	779,337.15

MASIMO CORP	2,020	134.98	272,659.60
MCKESSON CORP	5,449	382.43	2,083,861.07
MEDTRONIC PLC	49,758	84.50	4,204,551.00
MOLINA HEALTHCARE INC	2,145	366.25	785,606.25
NOVOCURE LTD	3,430	66.91	229,501.30
QUEST DIAGNOSTICS	4,386	144.05	631,803.30
RESMED INC	5,380	229.98	1,237,292.40
STERIS PLC	3,710	171.90	637,749.00
STRYKER CORP	12,743	224.62	2,862,332.66
TELADOC HEALTH INC	6,610	26.75	176,817.50
TELEFLEX INC	1,760	204.39	359,726.40
UNITEDHEALTH GROUP INC	35,010	540.22	18,913,102.20
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,460	96.68	237,832.80
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	5,240	166.68	873,403.20
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,642	110.73	846,198.66
ABBVIE INC	65,796	149.82	9,857,556.72
AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,240	134.50	1,511,780.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,520	198.56	897,491.20
AMGEN INC	19,946	259.99	5,185,760.54
AVANTOR INC	22,710	20.53	466,236.30
BIO-RAD LABORATORIES-A	860	389.00	334,540.00
BIO-TECHNE CORP	1,480	296.60	438,968.00
BIOGEN INC	5,543	273.56	1,516,343.08
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,140	91.47	653,095.80
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	79,365	72.77	5,775,391.05
CATALENT INC	6,520	71.36	465,267.20
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,910	219.12	418,519.20
DANAHER CORP	25,759	251.87	6,487,919.33
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	16,526	13.31	219,961.06
ELI LILLY & CO	30,109	351.31	10,577,592.79
EXACT SCIENCES CORP	6,510	33.38	217,303.80
GILEAD SCIENCES INC	46,794	69.60	3,256,862.40
HORIZON THERAPEUTICS PLC	7,990	66.13	528,378.70
ILLUMINA INC	5,915	230.12	1,361,159.80
INCYTE CORP	7,110	72.42	514,906.20

IQVIA HOLDINGS INC	7,008	197.65	1,385,131.20
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,450	137.62	337,169.00
JOHNSON & JOHNSON	98,241	170.71	16,770,721.11
MERCK & CO. INC.	94,273	97.71	9,211,414.83
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	835	1,230.89	1,027,793.15
MODERNA INC	12,545	136.57	1,713,270.65
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,630	112.59	408,701.70
PERKINELMER INC	4,700	136.43	641,221.00
PFIZER INC	209,150	45.59	9,535,148.50
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,035	747.33	3,015,476.55
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	13,010	41.42	538,874.20
SEAGEN INC	5,320	128.77	685,056.40
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43,590	8.57	373,566.30
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	14,589	514.62	7,507,791.18
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,565	309.21	2,957,593.65
VIATRIS INC	45,819	9.78	448,109.82
WATERS CORP	2,246	296.81	666,635.26
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,780	249.21	692,803.80
ZOETIS INC	17,535	152.30	2,670,580.50
BANK OF AMERICA CORP	270,339	35.39	9,567,297.21
CITIGROUP INC	71,967	45.32	3,261,544.44
CITIZENS FINANCIAL GROUP	17,690	40.44	715,383.60
FIFTH THIRD BANCORP	25,549	35.35	903,157.15
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	450	847.92	381,564.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,750	117.40	792,450.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,720	14.84	797,204.80
JPMORGAN CHASE & CO	109,510	122.70	13,436,877.00
KEYCORP	34,648	17.77	615,694.96
M & T BANK CORP	6,733	163.50	1,100,845.50
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	15,480	163.22	2,526,645.60
REGIONS FINANCIAL CORP	35,164	21.23	746,531.72
SIGNATURE BANK	2,390	152.55	364,594.50
SVB FINANCIAL GROUP	2,155	239.50	516,122.50
TRUIST FINANCIAL CORP	49,700	43.85	2,179,345.00
US BANCORP	52,651	42.01	2,211,868.51

WEBSTER FINANCIAL CORP	6,370	52.87	336,781.90
WELLS FARGO & CO	141,260	45.37	6,408,966.20
ALLY FINANCIAL INC	12,240	27.12	331,948.80
AMERICAN EXPRESS CO	23,894	147.02	3,512,895.88
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,135	278.26	1,150,605.10
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,090	54.31	819,537.90
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	28,632	41.60	1,191,091.20
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	48,015	289.24	13,887,858.60
BLACKROCK INC	5,665	635.94	3,602,600.10
BLACKSTONE INC	26,230	91.55	2,401,356.50
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	14,655	101.58	1,488,654.90
CARLYLE GROUP INC/THE	7,650	27.85	213,052.50
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,940	124.41	490,175.40
CME GROUP INC	13,420	175.80	2,359,236.00
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	4,270	75.05	320,463.50
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,420	99.97	1,041,687.40
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,420	29.36	423,371.20
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,400	419.26	586,964.00
FRANKLIN RESOURCES INC	10,315	23.45	241,886.75
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	32.94	82,350.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	12,798	332.40	4,254,055.20
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	20,670	95.16	1,966,957.20
INVESCO LTD	13,527	15.05	203,581.35
KKR & CO INC -A	21,010	47.27	993,142.70
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,005	244.98	736,164.90
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,420	246.77	350,413.40
MOODY'S CORP	6,142	257.62	1,582,302.04
MORGAN STANLEY	49,093	80.51	3,952,477.43
MSCI INC	3,035	448.42	1,360,954.70
NASDAQ INC	12,955	60.55	784,425.25
NORTHERN TRUST CORP	7,340	82.02	602,026.80
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,010	104.78	734,507.80
S&P GLOBAL INC	12,985	312.03	4,051,709.55
SCHWAB (CHARLES) CORP	53,963	72.46	3,910,158.98
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,175	48.99	204,533.25

STATE STREET CORP	13,717	72.05	988,309.85	
SYNCHRONY FINANCIAL	19,010	34.95	664,399.50	
T ROWE PRICE GROUP INC	8,125	108.69	883,106.25	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,200	54.55	229,110.00	
AFLAC INC	22,934	61.95	1,420,761.30	
ALLSTATE CORP	10,243	124.65	1,276,789.95	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,660	133.26	354,471.60	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	29,525	54.29	1,602,912.25	
AON PLC	7,922	280.00	2,218,160.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,055	49.22	691,787.10	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,940	175.42	1,392,834.80	
ASSURANT INC	1,960	152.74	299,370.40	
BROWN & BROWN INC	9,090	55.10	500,859.00	
CHUBB LTD	15,875	201.43	3,197,701.25	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,610	98.95	555,109.50	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	940	235.56	221,426.40	
EVEREST RE GROUP LTD	1,469	283.06	415,815.14	
FNF GROUP	9,591	38.09	365,321.19	
GLOBE LIFE INC	3,586	114.64	411,099.04	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,382	69.49	860,425.18	
LINCOLN NATIONAL CORP	6,453	52.74	340,331.22	
LOEWS CORP	7,105	55.76	396,174.80	
MARKEL CORP	500	1,153.46	576,730.00	
MARSH & MCLENNAN COS	18,743	153.11	2,869,740.73	
METLIFE INC	25,715	70.93	1,823,964.95	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,520	80.14	762,932.80	
PROGRESSIVE CORP	21,850	122.11	2,668,103.50	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	13,972	101.40	1,416,760.80	
TRAVELERS COS INC/THE	8,889	176.09	1,565,264.01	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,198	211.47	887,751.06	
WR BERKLEY CORP	8,091	69.07	558,845.37	
CBRE GROUP INC - A	12,090	71.96	869,996.40	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,500	3.88	157,140.00	
ZILLOW GROUP INC - C	6,370	31.21	198,807.70	
ACCENTURE PLC-CL A	23,688	280.61	6,647,089.68	

ADOBE INC	17,629	323.79	5,708,093.91	
AFFIRM HOLDINGS INC	6,670	20.62	137,535.40	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,030	88.45	533,353.50	
ANSYS INC	3,295	219.50	723,252.50	
APPROVIN CORP-CLASS A	3,960	18.80	74,448.00	
AUTODESK INC	8,130	215.72	1,753,803.60	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	15,736	237.76	3,741,391.36	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,530	35.56	267,766.80	
BILL.COM HOLDINGS INC	3,630	133.80	485,694.00	
BLACK KNIGHT INC	5,860	64.05	375,333.00	
BLOCK INC	19,400	59.66	1,157,404.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	4,400	144.39	635,316.00	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	10,230	151.32	1,548,003.60	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,280	63.46	335,068.80	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	3,840	116.73	448,243.20	
CLOUDFLARE INC-CLASS A	9,750	57.55	561,112.50	
COGNIZANT TECHNOLOGIES SOLUTIONS-A	19,278	61.48	1,185,211.44	
COUPA SOFTWARE INC	2,800	54.27	151,956.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	7,490	162.11	1,214,203.90	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,650	156.19	257,713.50	
DATADOG INC-CLASS A	8,220	88.75	729,525.00	
DOCUSIGN INC	7,480	50.23	375,720.40	
DROPBOX INC-CLASS A	11,660	22.12	257,919.20	
DYNATRACE INC	7,560	35.26	266,565.60	
EPAM SYSTEMS INC	2,145	348.13	746,738.85	
FAIR ISAAC CORP	970	432.75	419,767.50	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	22,608	79.95	1,807,509.60	
FISERV INC	22,934	100.08	2,295,234.72	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,690	177.99	478,793.10	
FORTINET INC	25,525	55.92	1,427,358.00	
GARTNER INC	3,050	298.93	911,736.50	
GLOBAL PAYMENTS INC	10,589	118.18	1,251,408.02	
GODADDY INC-CLASS A	6,020	79.65	479,493.00	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,870	58.76	168,641.20	
HUBSPOT INC	1,725	290.58	501,250.50	



INTL BUSINESS MACHINES CORP	33,632	132.93	4,470,701.76
INTUIT INC	10,006	432.08	4,323,392.48
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,690	192.67	518,282.30
MASTERCARD INC	32,415	311.41	10,094,355.15
MICROSOFT CORP	265,084	250.66	66,445,955.44
MONGODB INC	2,520	200.69	505,738.80
NORTONLIFELOCK INC	22,205	22.25	494,061.25
OKTA INC	5,670	58.31	330,617.70
ORACLE CORP	59,823	73.14	4,375,454.22
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	61,050	8.66	528,693.00
PALO ALTO NETWORKS INC	11,085	166.19	1,842,216.15
PAYCHEX INC	12,032	116.48	1,401,487.36
PAYCOM SOFTWARE INC	1,945	337.16	655,776.20
PAYPAL HOLDINGS INC	40,767	89.24	3,638,047.08
PTC INC	4,160	115.36	479,897.60
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,990	35.12	105,008.80
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,960	378.00	1,496,880.00
SALESFORCE INC	37,036	165.27	6,120,939.72
SERVICENOW INC	7,430	376.66	2,798,583.80
SNOWFLAKE INC-CLASS A	8,310	181.82	1,510,924.20
SPLUNK INC	6,120	82.87	507,164.40
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	49.58	419,942.60
SYNOPSYS INC	5,722	294.73	1,686,445.06
TWILIO INC - A	6,435	76.61	492,985.35
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,570	346.06	543,314.20
UNITY SOFTWARE INC	6,770	29.67	200,865.90
VERISIGN INC	3,690	187.82	693,055.80
VISA INC-CLASS A SHARES	61,432	194.38	11,941,152.16
VMWARE INC-CLASS A	7,697	111.42	857,599.74
WESTERN UNION CO	14,561	13.92	202,689.12
WIX.COM LTD	2,280	85.97	196,011.60
WORKDAY INC-CLASS A	7,350	156.18	1,147,923.00
ZENDESK INC	4,780	76.35	364,953.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	8,530	84.09	717,287.70
ZSCALER INC	3,190	157.09	501,117.10

AMPHENOL CORP-CL A	22,030	72.75	1,602,682.50
APPLE INC	603,784	152.34	91,980,454.56
ARISTA NETWORKS INC	8,720	112.63	982,133.60
ARROW ELECTRONICS INC	2,520	100.07	252,176.40
CDW CORP/DE	5,040	168.56	849,542.40
CISCO SYSTEMS INC	154,850	44.36	6,869,146.00
COGNEX CORP	6,480	45.99	298,015.20
CORNING INC	29,878	31.73	948,028.94
DELL TECHNOLOGIES -C	10,172	37.74	383,891.28
F5 INC	2,385	153.47	366,025.95
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	48,285	13.85	668,747.25
HP INC	39,365	27.58	1,085,686.70
JUNIPER NETWORKS INC	11,943	29.16	348,257.88
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,760	173.71	1,174,279.60
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,220	239.68	1,490,809.60
NETAPP INC	8,246	67.85	559,491.10
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,794	58.00	452,052.00
TE CONNECTIVITY LTD	11,995	117.27	1,406,653.65
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,750	360.39	630,682.50
TRIMBLE INC	9,520	58.15	553,588.00
WESTERN DIGITAL CORP	11,818	35.29	417,057.22
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,915	274.58	525,820.70
AT&T INC	267,027	17.69	4,723,707.63
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,435	16.89	91,797.15
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	11,131	17.83	198,465.73
LUMEN TECHNOLOGIES INC	34,386	6.92	237,951.12
T-MOBILE US INC	23,459	140.63	3,299,039.17
VERIZON COMMUNICATIONS INC	156,677	36.43	5,707,743.11
AES CORP	25,138	25.19	633,226.22
ALLIANT ENERGY CORP	8,800	50.72	446,336.00
AMEREN CORPORATION	9,572	79.52	761,165.44
AMERICAN ELECTRIC POWER	18,988	87.42	1,659,930.96
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,705	139.55	935,682.75
ATMOS ENERGY CORP	4,740	103.32	489,736.80
CENTERPOINT ENERGY INC	22,202	27.65	613,885.30

CMS ENERGY CORP	10,520	55.75	586,490.00
CONSOLIDATED EDISON INC	12,896	85.85	1,107,121.60
CONSTELLATION ENERGY	12,258	88.15	1,080,542.70
DOMINION ENERGY INC	30,271	66.92	2,025,735.32
DTE ENERGY COMPANY	7,188	109.13	784,426.44
DUKE ENERGY CORP	28,746	90.24	2,594,039.04
EDISON INTERNATIONAL	14,439	56.85	820,857.15
ENERGY CORP	7,507	104.75	786,358.25
ESSENTIAL UTILITIES INC	9,190	42.37	389,380.30
EVERGY INC	8,720	59.46	518,491.20
EVERSOURCE ENERGY	12,680	74.15	940,222.00
EXELON CORP	36,716	37.76	1,386,396.16
FIRSTENERGY CORP	20,205	37.58	759,303.90
NEXTERA ENERGY INC	73,480	75.86	5,574,192.80
NISOURCE INC	15,610	25.13	392,279.30
NRG ENERGY INC	8,760	43.64	382,286.40
P G & E CORP	55,800	15.13	844,254.00
PPL CORP	26,948	25.96	699,570.08
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	18,748	56.08	1,051,387.84
SEMPRA ENERGY	11,762	146.22	1,719,839.64
SOUTHERN CO	39,425	65.72	2,591,011.00
UGI CORP	7,720	34.07	263,020.40
VISTRA CORP	14,720	21.99	323,692.80
WEC ENERGY GROUP INC	11,770	87.77	1,033,052.90
XCEL ENERGY INC	20,304	62.40	1,266,969.60
ADVANCED MICRO DEVICES	60,124	61.47	3,695,822.28
ANALOG DEVICES INC	19,417	146.37	2,842,066.29
APPLIED MATERIALS INC	32,343	87.53	2,830,982.79
BROADCOM INC	15,090	460.07	6,942,456.30
ENPHASE ENERGY INC	5,065	265.59	1,345,213.35
ENTEGRIS INC	5,050	79.74	402,687.00
INTEL CORP	152,472	27.41	4,179,257.52
KLA CORP	5,599	304.87	1,706,967.13
LAM RESEARCH CORP	5,192	379.86	1,972,233.12
MARVELL TECHNOLOGY INC	32,084	40.61	1,302,931.24

	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,748	64.48	1,337,831.04	
	MICRON TECHNOLOGY INC	41,717	55.87	2,330,728.79	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,705	342.16	583,382.80	
	NVIDIA CORP	93,350	132.61	12,379,143.50	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	9,847	148.74	1,464,642.78	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	16,180	66.59	1,077,426.20	
	QORVO INC	3,810	86.04	327,812.40	
	QUALCOMM INC	41,822	119.17	4,983,927.74	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,960	86.68	516,612.80	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	2,005	215.61	432,298.05	
	TERADYNE INC	6,190	79.65	493,033.50	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	34,492	162.16	5,593,222.72	
米ドル小計		12,700,832		1,248,313,141.08	(185,037,456,902)
加ドル	ARC RESOURCES LTD	25,510	18.71	477,292.10	
	CAMECO CORP	14,932	33.40	498,728.80	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	42,754	80.80	3,454,523.20	
	CENOVUS ENERGY INC	49,873	26.53	1,323,130.69	
	ENBRIDGE INC	75,987	51.89	3,942,965.43	
	IMPERIAL OIL LTD	8,922	65.80	587,067.60	
	KEYERA CORP	8,460	28.66	242,463.60	
	PARKLAND CORP	6,170	27.00	166,590.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	20,412	43.68	891,596.16	
	SUNCOR ENERGY INC	53,489	45.47	2,432,144.83	
	TC ENERGY CORP	36,643	58.16	2,131,156.88	
	TOURMALINE OIL CORP	11,250	75.23	846,337.50	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,806	58.48	982,814.88	
	BARRICK GOLD CORP	66,724	20.77	1,385,857.48	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	66.19	380,592.50	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	24.97	565,570.50	
	FRANCO-NEVADA CORP	7,175	166.48	1,194,494.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	24,510	9.22	225,982.20	
	KINROSS GOLD CORP	46,025	4.90	225,522.50	
	LUNDIN MINING CORP	25,010	7.06	176,570.60	
	NUTRIEN LTD	20,478	113.14	2,316,880.92	

PAN AMERICAN SILVER CORP	7,660	21.82	167,141.20
TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,975	46.85	842,128.75
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,450	100.48	246,176.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	16,865	44.87	756,732.55
CAE INC	12,305	25.00	307,625.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,260	99.84	325,478.40
WSP GLOBAL INC	4,590	161.29	740,321.10
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,410	36.32	269,131.20
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,040	87.31	352,732.40
THOMSON REUTERS CORP	6,546	142.52	932,935.92
AIR CANADA	7,190	18.74	134,740.60
CANADIAN NATL RAILWAY CO	21,818	157.25	3,430,880.50
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	34,881	97.74	3,409,268.94
TFI INTERNATIONAL INC	3,210	132.75	426,127.50
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,668	73.32	782,177.76
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,040	43.27	304,620.80
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,998	78.17	859,713.66
QUEBECOR INC -CL B	6,110	24.53	149,878.30
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	17,465	34.06	594,857.90
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,970	150.68	296,839.60
DOLLARAMA INC	10,360	82.00	849,520.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	31,090	59.58	1,852,342.20
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	34.49	239,705.50
LOBLAW COMPANIES LTD	5,509	111.36	613,482.24
METRO INC	8,750	70.87	620,112.50
WESTON (GEORGE) LTD	2,808	148.32	416,482.56
SAPUTO INC	9,620	32.67	314,285.40
BANK OF MONTREAL	25,231	124.59	3,143,530.29
BANK OF NOVA SCOTIA	44,439	65.34	2,903,644.26
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	33,740	60.09	2,027,436.60
NATIONAL BANK OF CANADA	12,600	90.76	1,143,576.00
ROYAL BANK OF CANADA	52,719	123.88	6,530,829.72
TORONTO-DOMINION BANK	68,020	87.29	5,937,465.80
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	52,859	53.36	2,820,556.24
IGM FINANCIAL INC	3,335	36.72	122,461.20

	ONEX CORPORATION	2,765	67.86	187,632.90	
	TMX GROUP LTD	2,170	130.47	283,119.90	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	646.89	582,201.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	8,904	30.33	270,058.32	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,075	73.90	301,142.50	
	INTACT FINANCIAL CORP	6,535	202.00	1,320,070.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	71,921	22.28	1,602,399.88	
	POWER CORP OF CANADA	20,479	32.67	669,048.93	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	21,544	56.93	1,226,499.92	
	FIRSTSERVICE CORP	1,500	174.38	261,570.00	
	BLACKBERRY LTD	22,208	6.21	137,911.68	
	CGI INC	8,030	108.52	871,415.60	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	740	1,949.41	1,442,563.40	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	4,390	25.23	110,759.70	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,250	39.80	89,550.00	
	OPEN TEXT CORP	9,610	38.83	373,156.30	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	42,330	40.63	1,719,867.90	
	BCE INC	3,000	59.78	179,340.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	13,875	53.63	744,116.25	
	TELUS CORP	12,662	28.35	358,967.70	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	14.65	396,722.00	
	ALTAGAS LTD	11,170	25.26	282,154.20	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	42.02	228,798.90	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	35.32	161,059.20	
	EMERA INC	10,460	51.38	537,434.80	
	FORTIS INC	17,195	51.84	891,388.80	
	HYDRO ONE LTD	13,230	32.80	433,944.00	
	NORTHLAND POWER INC	8,600	38.97	335,142.00	
加ドル小計		1,519,639		85,311,256.74	(9,272,480,495)
ユーロ	ENI SPA	92,446	12.32	1,139,119.61	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	18,755	9.71	182,111.05	
	NESTE OYJ	15,550	47.72	742,046.00	
	OMV AG	5,480	41.20	225,776.00	
	REPSOL SA	54,849	13.09	718,247.65	

TENARIS SA	15,625	15.04	235,078.12
TOTALENERGIES SE	92,657	53.25	4,933,985.25
AIR LIQUIDE SA	19,519	132.50	2,586,267.50
AKZO NOBEL	6,937	62.88	436,198.56
ARCELORMITTAL	19,142	22.84	437,298.99
ARKEMA	2,215	79.22	175,472.30
BASF SE	33,475	45.94	1,538,008.87
COVESTRO AG	7,410	34.37	254,681.70
CRH PLC	28,450	35.42	1,007,841.25
EVONIK INDUSTRIES AG	8,230	18.74	154,271.35
HEIDELBERGCEMENT AG	5,715	44.62	255,003.30
KONINKLIJKE DSM NV	6,392	126.65	809,546.80
OCI NV	3,520	41.90	147,488.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,050	33.74	305,347.00
SOLVAY SA	2,811	91.50	257,206.50
STORA ENSO OYJ-R SHS	19,785	14.08	278,671.72
SYMRISE AG	4,910	103.25	506,957.50
UMICORE	7,960	33.27	264,829.20
UPM-KYMMENE OYJ	19,568	35.20	688,793.60
VOESTALPINE AG	4,249	22.08	93,817.92
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,046	24.71	198,816.66
AIRBUS GROUP SE	21,808	104.06	2,269,340.48
ALSTOM	11,635	19.25	223,973.75
BOUYGUES SA	8,460	28.13	237,979.80
BRENTAG SE	5,605	60.88	341,232.40
CNH INDUSTRIAL NV	39,510	12.78	504,937.80
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	18,426	41.49	764,494.74
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	16,776	26.32	441,544.32
DASSAULT AVIATION SA	900	148.70	133,830.00
EIFFAGE	3,250	87.86	285,545.00
FERROVIAL SA	18,485	23.62	436,615.70
GEA GROUP AG	6,020	35.66	214,673.20
IMCD NV	2,120	129.50	274,540.00
KINGSPAN GROUP PLC	5,900	51.72	305,148.00
KION GROUP AG	2,874	21.51	61,819.74

KNORR-BREMSE AG	2,970	45.07	133,857.90
KONE OYJ-B	12,294	39.14	481,187.16
LEGRAND SA	10,058	76.44	768,833.52
MTU AERO ENGINES AG	2,020	174.25	351,985.00
PRYSMIAN SPA	9,565	33.51	320,523.15
RATIONAL AG	230	567.50	130,525.00
RHEINMETALL AG	1,730	165.25	285,882.50
SAFRAN SA	12,790	110.34	1,411,248.60
SCHNEIDER ELECTRIC SE	20,028	131.30	2,629,676.40
SIEMENS AG-REG	28,466	111.24	3,166,557.84
SIEMENS ENERGY AG	15,843	11.24	178,154.53
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	8,870	17.92	158,994.75
THALES SA	4,015	121.60	488,224.00
VINCI SA	19,890	90.19	1,793,879.10
WARTSILA OYJ ABP	18,180	6.76	122,933.16
BUREAU VERITAS SA	10,920	24.54	267,976.80
RANDSTAD NV	4,675	48.62	227,298.50
TELEPERFORMANCE	2,240	274.80	615,552.00
WOLTERS KLUWER	9,607	107.45	1,032,272.15
ADP	1,090	129.70	141,373.00
AENA SA	2,870	109.15	313,260.50
ATLANTIA SPA	18,740	22.68	425,023.20
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	6.63	158,348.28
DEUTSCHE POST AG-REG	36,733	35.59	1,307,327.47
GETLINK	17,310	15.44	267,266.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	12,385	78.22	968,754.70
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,210	73.35	162,103.50
CONTINENTAL AG	4,385	51.74	226,879.90
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	3,500	98.00	343,000.00
FERRARI NV	4,474	199.05	890,549.70
MERCEDES-BENZ GROUP AG	29,922	58.30	1,744,452.60
MICHELIN (CGDE)	25,266	25.53	645,040.98
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	57.48	325,911.60
RENAULT SA	6,837	31.84	217,690.08
STELLANTIS NV	83,216	13.53	1,125,912.48



VALEO SA	7,420	17.01	126,214.20
VOLKSWAGEN AG	1,151	169.80	195,439.80
VOLKSWAGEN AG-PFD	6,763	131.18	887,170.34
ADIDAS AG	6,451	100.50	648,325.50
HERMES INTERNATIONAL	1,172	1,354.50	1,587,474.00
KERING	2,782	472.40	1,314,216.80
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	10,369	658.00	6,822,802.00
MONCLER SPA	8,080	48.93	395,354.40
PUMA SE	4,200	46.82	196,644.00
SEB SA	987	66.10	65,240.70
ACCOR SA	6,056	22.96	139,045.76
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,356	131.25	834,225.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	32.35	126,165.00
SODEXO	3,240	87.14	282,333.60
BOLLORE SE	33,530	5.10	171,170.65
PUBLICIS GROUPE	8,645	58.56	506,251.20
SCOUT24 SE	2,970	52.66	156,400.20
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,510	27.25	95,647.50
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	27,730	21.09	584,964.35
VIVENDI SE	26,070	8.32	216,902.40
D'IETEREN GROUP	830	164.70	136,701.00
DELIVERY HERO SE	6,600	36.17	238,722.00
INDITEX	40,125	23.61	947,351.25
JUST EAT TAKEAWAY	6,460	16.83	108,760.56
PROSUS	30,720	41.77	1,283,174.40
ZALANDO SE	8,260	24.12	199,231.20
CARREFOUR SA	22,633	15.54	351,716.82
HELLOFRESH SE	6,070	22.42	136,089.40
JERONIMO MARTINS	9,035	21.50	194,252.50
KESKO OYJ-B SHS	10,930	18.98	207,506.05
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	38,478	28.14	1,082,770.92
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	32,441	47.41	1,538,027.81
DANONE	23,614	48.58	1,147,286.19
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,850	9.12	181,071.70
HEINEKEN HOLDING NV	3,675	70.20	257,985.00

HEINEKEN NV	9,673	88.18	852,965.14
JDE PEET'S NV	4,010	27.98	112,199.80
KERRY GROUP PLC-A	5,910	94.02	555,658.20
PERNOD-RICARD SA	7,726	177.55	1,371,751.30
REMY COINTREAU	810	157.00	127,170.00
BEIERSDORF AG	3,805	101.85	387,539.25
HENKEL AG & CO KGAA	3,450	59.05	203,722.50
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,793	63.22	429,453.46
L'OREAL	9,011	321.65	2,898,388.15
AMPLIFON SPA	4,830	26.25	126,787.50
BIOMERIEUX	1,690	92.30	155,987.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	121.55	195,695.50
DIASORIN ITALIA SPA	930	136.25	126,712.50
ESSILORLUXOTTICA	10,755	165.00	1,774,575.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,613	28.24	214,991.12
FRESENIUS SE & CO KGAA	15,695	22.15	347,644.25
KONINKLIJKE PHILIPS NV	32,510	13.02	423,475.26
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,640	46.41	493,802.40
ARGENX SE	1,985	389.90	773,951.50
BAYER AG-REG	36,704	50.87	1,867,132.48
EUROFINS SCIENTIFIC	5,050	64.98	328,149.00
GRIFOLS SA	12,050	8.37	100,906.70
IPSEN	1,350	97.95	132,232.50
MERCK KGAA	4,810	167.50	805,675.00
ORION OYJ-CLASS B	3,620	44.47	160,981.40
QIAGEN N.V.	8,384	43.62	365,710.08
RECORDATI SPA	3,720	37.93	141,099.60
SANOFI	42,176	82.29	3,470,663.04
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	960	352.70	338,592.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	319.30	344,844.00
UCB SA	4,928	74.56	367,431.68
ABN AMRO BANK NV-CVA	15,170	9.80	148,696.34
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	250,583	5.23	1,310,549.09
BANCO SANTANDER SA	631,589	2.73	1,729,606.47
BNP PARIBAS	41,122	47.33	1,946,509.87

CAIXABANK S.A	163,050	3.52	575,403.45
COMMERZBANK AG	40,474	8.25	333,910.50
CREDIT AGRICOLE SA	44,062	9.09	400,699.82
ERSTE GROUP BANK AG	11,458	24.81	284,272.98
FINECOBANK SPA	23,540	13.54	318,731.60
ING GROEP NV-CVA	146,925	9.88	1,452,941.32
INTESA SANPAOLO	613,793	1.86	1,144,478.42
KBC GROEP NV	9,719	51.08	496,446.52
MEDIOBANCA SPA	20,580	8.80	181,227.48
SOCIETE GENERALE	29,859	23.27	694,818.93
UNICREDIT SPA	79,316	11.52	913,720.32
AMUNDI SA	2,140	47.26	101,136.40
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	75,775	9.26	702,131.15
DEUTSCHE BOERSE AG	7,000	162.70	1,138,900.00
EURAZEO SE	1,487	57.00	84,759.00
EURONEXT NV	3,470	64.50	223,815.00
EXOR NV	4,164	67.58	281,403.12
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,452	74.82	258,278.64
SOFINA	655	196.60	128,773.00
WENDEL	1,000	80.25	80,250.00
AEGON NV	69,679	4.38	305,333.37
AGEAS	5,924	38.16	226,059.84
ALLIANZ SE-REG	15,158	177.36	2,688,422.88
ASSICURAZIONI GENERALI	42,248	14.85	627,594.04
AXA SA	69,562	24.97	1,736,963.14
HANNOVER RUECK SE-REG	2,275	160.55	365,251.25
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,176	261.80	1,355,076.80
NN GROUP NV	10,270	42.39	435,345.30
POSTE ITALIANE SPA	19,560	8.51	166,455.60
SAMPO OYJ-A SHS	17,799	46.06	819,821.94
AROUNDTOWN SA	35,980	2.00	72,139.90
LEG IMMOBILIEN SE	2,470	65.76	162,427.20
VONOVIA SE	27,119	22.28	604,211.32
ADYEN NV	810	1,432.60	1,160,406.00
AMADEUS IT GROUP SA	17,090	51.58	881,502.20

BECHTLE AG	3,070	36.50	112,055.00
CAP GEMINI SA	6,109	173.00	1,056,857.00
DASSAULT SYSTEMES SE	24,650	36.67	904,038.75
EDENRED	9,626	49.90	480,337.40
NEMETSCHKE SE	2,350	52.02	122,247.00
NEXI SPA	21,240	8.78	186,487.20
SAP SE	38,812	97.25	3,774,467.00
WORLDLINE SA	8,950	43.77	391,741.50
NOKIA OYJ	203,856	4.47	912,867.16
CELLNEX TELECOM SA	19,720	30.69	605,206.80
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	119,926	18.52	2,221,269.37
ELISA OYJ	5,465	47.17	257,784.05
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	8.76	132,949.88
KONINKLIJKE KPN NV	124,056	2.70	335,323.36
ORANGE S.A.	74,364	9.40	699,393.42
PROXIMUS	5,600	9.61	53,860.80
TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.19	78,861.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	46,470	2.11	98,191.11
TELEFONICA SA	195,629	3.25	635,989.87
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,000	18.67	74,700.00
ACCIONA SA	830	175.90	145,997.00
E.ON SE	82,679	8.30	686,897.13
EDF	21,315	11.95	254,714.25
EDP RENOVAVEIS SA	11,010	20.68	227,686.80
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	105,831	4.39	465,233.07
ELIA GROUP SA/NV	1,356	124.70	169,093.20
ENAGAS SA	8,610	15.51	133,541.10
ENDESA SA	12,050	15.56	187,558.25
ENEL SPA	300,937	4.37	1,317,803.12
ENGIE	68,324	13.04	891,081.60
FORTUM OYJ	16,755	13.98	234,234.90
IBERDROLA SA	220,452	9.86	2,174,097.62
NATURGY ENERGY GROUP SA	6,252	24.74	154,674.48
RED ELECTRICA CORPORACION SA	15,580	15.71	244,839.70
RWE AG	23,675	39.15	926,876.25

	SNAM SPA	72,420	4.43	321,182.70	
	TERNA SPA	53,627	6.57	352,436.64	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,790	22.73	563,476.70	
	VERBUND AG	2,780	81.70	227,126.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	1,765	278.15	490,934.75	
	ASML HOLDING NV	15,177	496.00	7,527,792.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	47,565	26.27	1,249,770.37	
	STMICROELECTRONICS NV	25,233	35.18	887,696.94	
ユーロ小計		6,872,867		151,763,377.73 (22,363,851,342)	
英ポンド	BP PLC	720,998	4.65	3,356,966.68	
	SHELL PLC-NEW	278,007	22.89	6,364,970.26	
	ANGLO AMERICAN PLC	46,644	26.58	1,240,030.74	
	ANTOFAGASTA PLC	14,330	11.46	164,293.45	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	5,071	68.48	347,262.08	
	GLENCORE PLC	367,613	5.02	1,847,990.55	
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,339	19.39	142,303.21	
	MONDI PLC	18,370	15.04	276,284.80	
	RIO TINTO PLC	42,025	47.14	1,981,058.50	
	ASHTREAD GROUP PLC	16,150	44.42	717,383.00	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	117,325	8.05	944,935.55	
	BUNZL PLC	12,896	28.15	363,022.40	
	DCC PLC	3,820	48.86	186,645.20	
	FERGUSON PLC	7,952	95.00	755,440.00	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	162,972	1.09	177,965.42	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	321,031	0.73	236,567.74	
	SMITHS GROUP PLC	13,603	15.48	210,642.45	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,890	109.45	316,310.50	
	EXPERIAN PLC	33,988	27.40	931,271.20	
	INTERTEK GROUP PLC	6,025	38.17	229,974.25	
	RELX PLC	71,505	23.12	1,653,195.60	
	RENTOKIL INITIAL PLC	85,940	5.21	448,434.92	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	3.72	151,844.88	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,515	35.20	158,928.00	
	BURBERRY GROUP PLC	15,504	18.77	291,087.60	

PERSIMMON PLC	12,440	13.02	162,031.00
TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	0.95	117,984.77
COMPASS GROUP PLC	66,698	18.19	1,213,570.11
ENTAIN PLC	21,400	12.42	265,788.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	6,493	45.77	297,184.61
WHITBREAD PLC	6,920	26.22	181,442.40
AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	5.12	187,069.44
INFORMA PLC	56,580	5.64	319,111.20
PEARSON PLC	26,089	9.57	249,776.08
WPP PLC	41,144	7.69	316,644.22
JD SPORTS FASHION PLC	97,350	0.98	95,695.05
KINGFISHER PLC	78,137	2.13	166,588.08
NEXT PLC	4,637	50.32	233,333.84
OCADO GROUP PLC	22,670	5.04	114,438.16
SAINSBURY (J) PLC	70,601	1.90	134,212.50
TESCO PLC	277,818	2.11	586,195.98
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,125	13.55	177,909.37
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	80,197	33.84	2,713,866.48
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	19.53	150,224.15
DIAGEO PLC	85,002	36.29	3,085,147.59
IMPERIAL BRANDS PLC	33,172	20.99	696,280.28
HALEON PLC	194,651	2.73	531,591.88
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	26,545	59.66	1,583,674.70
UNILEVER PLC	95,332	39.26	3,743,210.98
NMC HEALTH PLC	8,090	-	-
SMITH & NEPHEW PLC	31,596	10.01	316,433.94
ASTRAZENECA PLC	57,722	97.53	5,629,626.66
GSK PLC	151,320	13.83	2,093,663.52
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,740	11.90	68,334.70
BARCLAYS PLC	613,451	1.50	921,526.09
HSBC HOLDINGS PLC	749,281	4.42	3,316,692.34
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,553,536	0.42	1,097,382.09
NATWEST GROUP PLC	192,985	2.44	471,655.34
STANDARD CHARTERED PLC	95,420	5.54	529,008.48
3I GROUP PLC	36,819	11.46	421,945.74

	ABRDN PLC	88,515	1.55	137,685.08	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	7.77	101,165.40	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	12,467	74.40	927,544.80	
	M&G PLC	99,522	1.81	180,284.10	
	SCHRODERS PLC	30,299	3.96	120,135.53	
	ST JAMES'S PLACE PLC	20,540	10.58	217,313.20	
	ADMIRAL GROUP PLC	6,795	20.09	136,511.55	
	AVIVA PLC	101,624	4.16	423,162.33	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	225,651	2.35	530,279.85	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,230	5.48	165,902.24	
	PRUDENTIAL PLC	101,732	8.17	831,353.90	
	AVEVA GROUP PLC	4,515	31.36	141,590.40	
	SAGE GROUP PLC/THE	38,840	7.46	289,824.08	
	HALMA PLC	14,690	21.70	318,773.00	
	BT GROUP PLC	267,752	1.25	336,564.26	
	VODAFONE GROUP PLC	996,528	0.98	983,274.17	
	NATIONAL GRID PLC	134,938	9.40	1,268,417.20	
	SEVERN TRENT PLC	9,023	24.63	222,236.49	
	SSE PLC	39,837	15.23	606,717.51	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	9.29	242,672.08	
英ボンド小計		10,661,077		63,865,455.92	(10,826,472,087)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,990	17.25	137,827.50	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	661.50	178,605.00	
	GIVAUDAN-REG	348	3,078.00	1,071,144.00	
	HOLCIM LTD	20,649	42.74	882,538.26	
	SIG GROUP AG	10,900	19.98	217,782.00	
	SIKA AG-REG	5,505	228.50	1,257,892.50	
	ABB LTD-REG	61,275	27.81	1,704,057.75	
	GEBERIT AG-REG	1,310	452.50	592,775.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,070	155.60	166,492.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,310	162.20	212,482.00	
	VAT GROUP AG	1,015	236.00	239,540.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	5,517	30.22	166,723.74	
	SGS SA-REG	238	2,219.00	528,122.00	

	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,990	223.50	444,765.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	19,549	103.10	2,015,501.90	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,125	230.80	259,650.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,850	43.08	79,698.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	130	1,877.00	244,010.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	40	9,850.00	394,000.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	100,300.00	401,200.00	
	NESTLE SA-REG	105,100	108.16	11,367,616.00	
	ALCON INC	18,644	59.68	1,112,673.92	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,051	239.90	492,034.90	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,050	100.80	408,240.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,400	76.75	107,450.00	
	LONZA GROUP AG-REG	2,793	518.40	1,447,891.20	
	NOVARTIS AG-REG	80,683	77.84	6,280,364.72	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,020	405.00	413,100.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	26,148	331.50	8,668,062.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	98,798	4.78	473,044.82	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,420	46.85	394,477.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	850	897.00	762,450.00	
	UBS GROUP AG-REG	130,142	16.30	2,121,965.31	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,740	134.70	234,378.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,140	480.80	548,112.00	
	SWISS RE AG	11,379	76.38	869,128.02	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,651	420.40	2,375,680.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,711	81.60	221,217.60	
	TEMENOS AG	2,280	58.50	133,380.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	51.18	340,858.80	
	SWISSCOM AG-REG	964	456.30	439,873.20	
	スイスフラン小計	654,709		50,406,804.54 (7,501,036,583)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	10,290	328.55	3,380,779.50	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,520	426.90	1,502,688.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	22,680	144.20	3,270,456.00	
	ALFA LAVAL AB	10,710	259.30	2,777,103.00	
	ASSA ABLOY AB-B	37,490	220.40	8,262,796.00	



ATLAS COPCO AB-A SHS	102,900	118.28	12,171,012.00	
ATLAS COPCO AB-B SHS	53,450	106.74	5,705,253.00	
EPIROC AB-A	24,905	174.80	4,353,394.00	
EPIROC AB-B	15,450	152.45	2,355,352.50	
HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	63.88	958,200.00	
INDUTRADE AB	10,180	197.10	2,006,478.00	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	192.10	1,306,280.00	
LIFCO AB-B SHS	8,470	164.75	1,395,432.50	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	56,420	88.64	5,001,068.80	
SANDVIK AB	38,950	173.15	6,744,192.50	
SKANSKA AB-B SHS	14,390	154.60	2,224,694.00	
SKF AB-B SHARES-B	14,079	157.85	2,222,370.15	
VOLVO AB-A SHS	7,120	182.70	1,300,824.00	
VOLVO AB-B SHS-B	56,670	176.04	9,976,186.80	
SECURITAS AB-B SHS	9,429	88.48	834,277.92	
SECURITAS AB-B SHS(N)	8,359	88.48	739,604.32	
VOLVO CAR AB-B	20,400	45.56	929,526.00	
ELECTROLUX AB-B	8,095	127.18	1,029,522.10	
EVOLUTION AB	6,740	1,016.40	6,850,536.00	
EMBRACER GROUP AB	23,940	54.40	1,302,336.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,848	116.68	3,249,304.64	
SWEDISH MATCH AB	56,700	113.25	6,421,275.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	23,695	227.00	5,378,765.00	
GETINGE AB-B SHS	7,680	219.10	1,682,688.00	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	7,130	204.40	1,457,372.00	
NORDEA BANK ABP	126,012	107.40	13,533,688.80	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	62,450	119.75	7,478,387.50	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	53,420	103.55	5,531,641.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	34,550	161.20	5,569,460.00	
EQT AB	10,680	224.00	2,392,320.00	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	249.40	1,243,009.60	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	248.00	1,483,040.00	
INVESTOR AB-A SHS	19,180	187.35	3,593,373.00	
INVESTOR AB-B SHS	69,350	181.24	12,568,994.00	
KINNEVIK AB - B	8,285	143.70	1,190,554.50	

	LUNDBERGS AB-B SHS	2,260	437.20	988,072.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	23,220	39.46	916,261.20	
	SAGAX AB-B	7,910	196.05	1,550,755.50	
	ERICSSON LM-B SHS	107,615	60.59	6,520,392.85	
	HEXAGON AB-B SHS	71,970	112.55	8,100,223.50	
	TELE2 AB-B SHS	23,245	88.56	2,058,577.20	
	TELIA CO AB	94,230	29.04	2,736,439.20	
スウェーデンクローナ小計		1,434,831		184,244,957.58	(2,485,464,477)
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	12,100	319.20	3,862,320.00	
	EQUINOR ASA	36,424	358.65	13,063,467.60	
	NORSK HYDRO A S	50,660	64.64	3,274,662.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,670	457.40	3,050,858.00	
	ADEVINTA ASA	11,400	69.35	790,590.00	
	MOWI ASA	16,360	140.90	2,305,124.00	
	ORKLA ASA	25,960	77.86	2,021,245.60	
	SALMAR ASA	2,100	315.00	661,500.00	
	DNB BANK ASA	35,845	180.05	6,453,892.25	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,410	189.90	1,407,159.00	
	TELENOR ASA	23,915	90.38	2,161,437.70	
ノルウェークローネ小計		228,844		39,052,256.55	(554,542,043)
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,840	431.40	1,656,576.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,255	393.40	2,854,117.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	315	1,470.00	463,050.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	38,290	143.00	5,475,470.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	110	15,220.00	1,674,200.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	195	15,975.00	3,115,125.00	
	DSV A/S	6,940	1,014.50	7,040,630.00	
	PANDORA A/S	3,310	404.20	1,337,902.00	
	CARLSBERG AS-B	3,630	895.00	3,248,850.00	
	COLOPLAST-B	4,485	844.00	3,785,340.00	
	DEMANT A/S	3,640	210.00	764,400.00	
	GN STORE NORD A/S	4,970	158.65	788,490.50	
	GENMAB A/S	2,475	2,817.00	6,972,075.00	

	NOVO NORDISK A/S-B	61,735	807.10	49,826,318.50	
	DANSKE BANK A/S	26,635	101.60	2,706,116.00	
	TRYG A/S	13,945	156.45	2,181,695.25	
	ORSTED A/S	7,030	626.70	4,405,701.00	
	デンマーククロネ小計	188,800		98,296,056.25 (1,947,244,874)	
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	27.35	239,996.25	
	SANTOS LTD	121,660	7.66	931,915.60	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,370	27.58	230,844.60	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	71,206	35.28	2,512,147.68	
	BHP GROUP LTD	189,207	38.50	7,284,469.50	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	15.70	287,467.00	
	EVOLUTION MINING LTD	69,000	1.93	133,515.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	64,055	16.26	1,041,534.30	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	16,955	33.19	562,736.45	
	MINERAL RESOURCES LTD	6,240	74.75	466,440.00	
	NEWCREST MINING LTD	32,309	17.10	552,483.90	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42,190	8.27	348,911.30	
	ORICA LIMITED	17,675	13.64	241,087.00	
	RIO TINTO LTD	14,098	91.32	1,287,429.36	
	SOUTH32 LTD	169,887	3.60	611,593.20	
	REECE LTD	10,200	14.63	149,226.00	
	BRAMBLES LTD	54,798	11.17	612,093.66	
	AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	3.54	260,437.80	
	QANTAS AIRWAYS LTD	35,030	5.94	208,078.20	
	TRANSURBAN GROUP	113,696	12.61	1,433,706.56	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	22,000	36.17	795,740.00	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,130	58.54	124,690.20	
	IDP EDUCATION LTD	7,220	28.81	208,008.20	
	LOTTERY CORP LTD/THE	85,554	4.21	360,182.34	
	REA GROUP LTD	1,820	119.55	217,581.00	
	SEEK LTD	12,860	21.10	271,346.00	
	WESFARMERS LTD	40,925	44.59	1,824,845.75	
	COLES GROUP LTD	49,255	16.60	817,633.00	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	50,462	7.32	369,381.84	

	WOOLWORTHS GROUP LTD	43,952	33.38	1,467,117.76
	TREASURY WINE ESTATES LTD	27,906	12.73	355,243.38
	COCHLEAR LTD	2,527	196.08	495,494.16
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,105	57.21	406,477.05
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	31.59	557,879.40
	CSL LTD	17,942	276.00	4,951,992.00
	AUST AND NZ BANKING GROUP	110,339	25.70	2,835,712.30
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	63,917	101.78	6,505,472.26
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	119,433	31.95	3,815,884.35
	WESTPAC BANKING CORP	131,371	23.90	3,139,766.90
	ASX LTD	7,105	66.28	470,919.40
	MACQUARIE GROUP LTD	13,614	165.00	2,246,310.00
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	4.85	461,356.25
	MEDIBANK PRIVATE LTD	108,430	3.50	380,047.15
	QBE INSURANCE GROUP LTD	55,210	12.01	663,072.10
	SUNCORP GROUP LTD	44,226	11.04	488,255.04
	COMPUTERSHARE LTD	20,910	24.68	516,058.80
	WISETECH GLOBAL LTD	5,920	56.82	336,374.40
	XERO LTD	4,930	76.40	376,652.00
	TELSTRA GROUP LTD	144,984	3.87	561,088.08
	APA GROUP	45,818	9.88	452,681.84
	ORIGIN ENERGY LTD	68,320	5.37	366,878.40
豪ドル小計		2,566,201		56,236,254.71 (5,314,888,432)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,165	7.37	347,606.05
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,130	19.12	442,245.60
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	5.10	390,542.70
	MERCURY NZ LTD	20,400	5.33	108,732.00
	MERIDIAN ENERGY LTD	45,980	4.56	209,668.80
ニュージーランドドル小計		213,252		1,498,795.15 (127,277,684)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	97,708	40.30	3,937,632.40
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	52,500	76.50	4,016,250.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	71,000	11.02	782,420.00
	MTR CORP	57,500	33.85	1,946,375.00

	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	14.44	750,880.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	81,000	36.80	2,980,800.00	
	SANDS CHINA LTD	96,600	13.72	1,325,352.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	57,000	13.68	779,760.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	16.46	1,117,634.00	
	WH GROUP LTD	299,894	4.50	1,349,523.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	134,500	24.75	3,328,875.00	
	HANG SENG BANK LTD	29,100	111.90	3,256,290.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	44,600	224.00	9,990,400.00	
	AIA GROUP LTD	449,190	58.10	26,097,939.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	73,038	44.20	3,228,279.60	
	ESR GROUP LTD	75,800	15.24	1,155,192.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	11.34	884,520.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	20.25	1,172,495.25	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	61,666	17.58	1,084,088.28	
	SINO LAND CO	123,050	9.21	1,133,290.50	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	52,480	85.95	4,510,656.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	17,517	54.60	956,428.20	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	15.48	643,968.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	32.75	2,089,450.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	8.96	1,344,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	35.75	893,750.00	
	CLP HOLDINGS LTD	59,500	51.85	3,085,075.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	95,000	4.71	447,450.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	403,237	6.10	2,459,745.70	
	POWER ASSETS HOLDINGS	49,500	35.70	1,767,150.00	
香港ドル小計		3,017,581		88,515,668.93	(1,671,175,829)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	53,360	6.59	351,642.40	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	63,300	3.19	201,927.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	5.03	271,117.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.79	166,769.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	3.48	257,380.80	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	67,395	32.76	2,207,860.20	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	124,040	11.70	1,451,268.00	

	UNITED OVERSEAS BANK LTD	41,800	26.13	1,092,234.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	25,200	8.35	210,420.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	105,000	3.07	322,350.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	7.31	126,463.00	
	UOL GROUP LTD	15,550	5.99	93,144.50	
	VENTURE CORP LTD	9,900	15.89	157,311.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	304,780	2.43	740,615.40	
シンガポールドル小計		1,166,585		7,650,502.30	(799,477,490)
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	26,090	31.15	812,703.50	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,010	712.10	719,221.00	
	BANK HAPOALIM BM	41,135	33.96	1,396,944.60	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	62,565	33.79	2,114,071.35	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	48,330	19.95	964,183.50	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,900	131.80	645,820.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,780	259.60	462,088.00	
	NICE LTD	2,440	693.80	1,692,872.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	68,700	6.12	420,856.20	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	3,740	148.60	555,764.00	
イスラエルシュケル小計		260,690		9,784,524.15	(411,861,931)
合 計		41,485,908		248,313,230,169	(248,313,230,169)

(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	5,690	797,794.90	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	11,180	366,592.20	
		AMERICAN TOWER CORP	17,089	3,341,412.17	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15,557	275,047.76	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,220	933,336.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,717	430,661.61	

		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,700	432,049.00	
		CROWN CASTLE INC	16,040	2,027,937.20	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	10,635	1,079,984.25	
		EQUINIX INC	3,368	1,868,869.52	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,550	396,537.00	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	13,340	883,241.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	586,396.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	4,960	859,915.20	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	9,370	446,480.50	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	11,000	215,710.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	469,440.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	27,179	489,222.00	
		INVITATION HOMES INC	22,810	774,627.60	
		IRON MOUNTAIN INC	10,895	539,411.45	
		KIMCO REALTY CORP	21,830	447,515.00	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	23,470	254,180.10	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,300	661,985.00	
		PROLOGIS INC	34,365	3,722,760.45	
		PUBLIC STORAGE	5,919	1,776,351.09	
		REALTY INCOME CORP	22,221	1,344,148.29	
		REGENCY CENTERS CORP	6,005	349,130.70	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,030	1,034,098.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	12,114	1,282,145.76	
		SUN COMMUNITIES INC	4,640	600,740.80	
		UDR INC	12,100	490,897.00	
		VENTAS INC	14,895	582,692.40	
		VICI PROPERTIES INC	35,610	1,094,651.40	
		VORNADO REALTY TRUST	6,851	162,711.25	
		WELLTOWER INC	16,750	1,011,030.00	
		WEYERHAEUSER CO	27,758	857,999.78	
		WP CAREY INC	7,310	537,285.00	
米ドル小計			483,323	33,424,987.78	(4,954,585,938)
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	116,452.00	
			2,800	116,452.00	

加ドル小計				(12,657,167)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	103,950.00
		GECINA SA	1,950	175,305.00
		KLEPIERRE	8,402	166,023.52
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,160	195,748.80
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	5,160	136,327.20
ユーロ小計			21,597	777,354.52 (114,550,962)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	30,601	111,112.23
		LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	151,437.31
		SEGRO PLC	45,033	359,363.34
英ポンド小計			102,258	621,912.88 (105,426,671)
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	42,067	322,653.89
		GOODMAN GROUP	63,582	1,052,917.92
		GPT GROUP	71,335	287,480.05
		LENDLEASE GROUP	23,367	191,375.73
		MIRVAC GROUP	135,075	264,747.00
		SCENTRE GROUP	198,271	531,366.28
		STOCKLAND	82,300	278,174.00
		VICINITY CENTRES	154,902	281,147.13
豪ドル小計			770,899	3,209,862.00 (303,364,057)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	77,300	3,644,695.00
香港ドル小計			77,300	3,644,695.00 (68,811,841)
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,243	346,989.93
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	381,391.92
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	144,556	211,051.76
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	106,000	167,480.00
シンガポールドル小計			598,355	1,106,913.61 (115,672,472)
合計				5,675,069,108 (5,675,069,108)

(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 598銘柄	97.4%		72.7%
	投資証券 37銘柄		2.6%	2.0%
加ドル	株式 84銘柄	99.9%		3.7%
	投資証券 1銘柄		0.1%	0.0%
ユーロ	株式 223銘柄	99.5%		8.8%
	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 47銘柄	100.0%		1.0%
ノルウェークローネ	株式 11銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%		0.8%
豪ドル	株式 51銘柄	94.6%		2.1%
	投資証券 8銘柄		5.4%	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 30銘柄	96.0%		0.7%
	投資証券 1銘柄		4.0%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	87.4%		0.3%
	投資証券 4銘柄		12.6%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 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。

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

## 貸借対照表

（単位：円）

	2021年10月26日現在	2022年10月26日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	49,665,611	68,117,184
コール・ローン	390,550,490	1,167,168,322
株式	16,780,154,292	16,378,481,161
投資証券	396,395,818	376,675,031
派生商品評価勘定	10,472,882	42,304,567
未収入金	3,355,763	4,150,883
未収配当金	10,209,550	12,390,369
差入委託証拠金	357,963,641	385,736,522
流動資産合計	17,998,768,047	18,435,024,039
資産合計		
	17,998,768,047	18,435,024,039
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	385,794,529	465,964,195
未払金	21,501,268	361,524,014
未払解約金	2,877,983	31,761,566
未払利息	156	1,898
流動負債合計	410,173,936	859,251,673
負債合計		
	410,173,936	859,251,673
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,831,162,629	8,061,313,419
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	10,757,431,482	9,514,458,947
元本等合計	17,588,594,111	17,575,772,366
純資産合計		
	17,588,594,111	17,575,772,366
負債純資産合計		
	17,998,768,047	18,435,024,039

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(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10月26日現在	2022年10月26日現在
1.	期首	2020年10月27日	2021年10月27日
	期首元本額	5,875,608,160円	6,831,162,629円
	期首からの追加設定元本額	1,363,175,797円	1,837,477,067円
	期首からの一部解約元本額	407,621,328円	607,326,277円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外株式ヘッジあり（DC専用）	5,349,584,556円	6,553,093,225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）	324,670,953円	353,402,483円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	5,734,203円	-円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	5,090,574円	-円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	6,210,213円	-円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	5,202,286円	-円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	31,207,983円	36,886,955円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	90,331,157円	103,003,896円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	138,338,781円	155,066,780円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	132,630,704円	155,257,338円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジあり）	742,161,219円	704,602,742円
	計	6,831,162,629円	8,061,313,419円
2.	受益権の総数	6,831,162,629口	8,061,313,419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10月27日 至 2021年10月26日	自 2021年10月27日 至 2022年10月26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10月26日現在	2022年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「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つた場合、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つた場合、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10月26日現在)

## 売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,639,777,594
投資証券	87,312,902
合計	3,727,090,496

（2022年10月26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	2,999,946,385
投資証券	118,265,811
合計	3,118,212,196

(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10月26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	421,562,260	-	430,330,782	8,768,522
	合計	421,562,260	-	430,330,782	8,768,522

（2022年10月26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	935,552,532	-	947,120,951	11,568,419
	合計	935,552,532	-	947,120,951	11,568,419

## (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10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	17,203,273,601	-	17,587,363,770	384,090,169
	米ドル	12,625,971,820	-	12,898,626,326	272,654,506
	加ドル	596,310,418	-	619,065,088	22,754,670
	ユーロ	1,779,281,817	-	1,802,957,143	23,675,326
	英ポンド	747,819,472	-	768,630,405	20,810,933
	スイスフラン	500,474,879	-	510,759,785	10,284,906
	スウェーデンクローナ	194,700,246	-	200,963,700	6,263,454
	ノルウェークローネ	34,615,995	-	37,133,538	2,517,543
	デンマーククローネ	140,710,687	-	142,559,187	1,848,500
	豪ドル	359,651,044	-	376,188,313	16,537,269
	ニュージーランドドル	10,509,414	-	11,080,465	571,051
	香港ドル	143,595,010	-	148,022,037	4,427,027
	シンガポールドル	52,432,965	-	53,524,336	1,091,371

	イスラエルシェケル	17,199,834	-	17,853,447	653,613
合計		17,203,273,601	-	17,587,363,770	384,090,169

(2022年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益	
			うち1年超			
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	売建	16,648,919,002	-	17,084,147,049	435,228,047	
	米ドル	12,465,226,169	-	12,786,033,348	320,807,179	
	加ドル	597,933,013	-	610,981,665	13,048,652	
	ユーロ	1,507,050,964	-	1,559,577,519	52,526,555	
	英ポンド	697,749,185	-	721,896,836	24,147,651	
	スイスフラン	488,239,847	-	497,278,664	9,038,817	
	スウェーデンクローナ	159,512,748	-	162,456,634	2,943,886	
	ノルウェークローネ	36,378,395	-	36,992,831	614,436	
	デンマーククローネ	125,812,707	-	129,859,985	4,047,278	
	豪ドル	372,019,375	-	375,132,165	3,112,790	
	ニュージーランドドル	6,765,143	-	6,893,513	128,370	
	香港ドル	111,683,012	-	113,846,601	2,163,589	
	シンガポールドル	58,073,572	-	60,350,056	2,276,484	
	イスラエルシェケル	22,474,872	-	22,847,232	372,360	
	合計		16,648,919,002	-	17,084,147,049	435,228,047

## (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10月26日現在		2022年10月26日現在	
1口当たり純資産額	2.5748円	1口当たり純資産額	2.1803円
(1万口当たり純資産額)	(25,748円)	(1万口当たり純資産額)	(21,803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	890	45.20	40,228.00	
	BAKER HUGHES CO	2,439	26.10	63,657.90	
	CHENIERE ENERGY INC	606	169.28	102,583.68	
	CHEVRON CORP	4,580	174.93	801,179.40	
	CONOCOPHILLIPS	3,150	123.94	390,411.00	
	COTERRA ENERGY INC	2,100	30.15	63,315.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	1,500	75.51	113,265.00	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	380	153.36	58,276.80	
	EOG RESOURCES INC	1,456	132.00	192,192.00	
	EQT CORP	870	39.60	34,452.00	
	EXXON MOBIL CORP	10,370	105.88	1,097,975.60	
	HALLIBURTON CO	2,436	34.98	85,211.28	
	HESS CORP	692	135.75	93,939.00	
KINDER MORGAN INC	5,000	17.51	87,550.00		



MARATHON OIL CORP	1,840	29.65	54,556.00
MARATHON PETROLEUM CORP	1,320	111.44	147,100.80
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	2,341	71.09	166,421.69
ONEOK INC	1,080	57.59	62,197.20
PHILLIPS 66	1,179	100.22	118,159.38
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	576	264.83	152,542.08
SCHLUMBERGER LTD	3,600	52.47	188,892.00
TARGA RESOURCES CORP	550	66.72	36,696.00
TEXAS PACIFIC LAND CORP	20	2,066.92	41,338.40
VALERO ENERGY CORP	990	126.80	125,532.00
WILLIAMS COS INC	2,980	31.85	94,913.00
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	546	251.56	137,351.76
ALBEMARLE CORP	307	281.43	86,399.01
ALCOA CORP	470	41.49	19,500.30
AMCOR PLC	4,230	11.47	48,518.10
AVERY DENNISON CORP	196	177.01	34,693.96
BALL CORP	855	48.42	41,399.10
CELANESE CORP	251	96.02	24,101.02
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	510	107.70	54,927.00
CLEVELAND-CLIFFS INC	1,340	14.30	19,162.00
CORTEVA INC	1,796	64.96	116,668.16
CROWN HOLDINGS INC	298	70.69	21,065.62
DOW INC	1,710	47.85	81,823.50
DUPONT DE NEMOURS INC	1,231	56.96	70,117.76
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	270	75.45	20,371.50
ECOLAB INC	590	152.99	90,264.10
FMC CORP	326	118.65	38,679.90
FREEPORT-MCMORAN INC	3,480	31.67	110,211.60
INTERNATIONAL PAPER CO	874	33.44	29,226.56
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	609	96.16	58,561.44
LINDE PLC	1,240	288.18	357,343.20
LYONDELLBASELL INDU-CL A	648	81.90	53,071.20
MARTIN MARIETTA MATERIALS	144	332.79	47,921.76
MOSAIC CO/THE	882	53.63	47,301.66
NEWMONT CORP	1,958	42.72	83,645.76

NUCOR CORP	677	136.51	92,417.27
PACKAGING CORP OF AMERICA	240	115.93	27,823.20
PPG INDUSTRIES INC	560	112.96	63,257.60
RPM INTERNATIONAL INC	385	92.87	35,754.95
SEALED AIR CORP	300	47.62	14,286.00
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	590	220.20	129,918.00
STEEL DYNAMICS INC	451	97.71	44,067.21
VULCAN MATERIALS CO	335	162.28	54,363.80
WESTROCK CO	562	33.48	18,815.76
3M CO	1,310	118.50	155,235.00
ALLEGION PLC	231	97.54	22,531.74
AMETEK INC	551	123.04	67,795.04
BOEING CO/THE	1,404	146.65	205,896.60
CARLISLE COS INC	130	282.01	36,661.30
CARRIER GLOBAL CORP	2,126	37.29	79,278.54
CATERPILLAR INC	1,290	194.84	251,343.60
CUMMINS INC	357	234.68	83,780.76
DEERE & CO	710	391.63	278,057.30
DOVER CORP	354	127.29	45,060.66
EATON CORP PLC	987	146.05	144,151.35
EMERSON ELECTRIC CO	1,440	84.55	121,752.00
FASTENAL CO	1,443	47.20	68,109.60
FORTIVE CORP	784	63.91	50,105.44
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	347	58.83	20,414.01
GENERAC HOLDINGS INC	147	121.29	17,829.63
GENERAL DYNAMICS CORP	618	245.75	151,873.50
GENERAL ELECTRIC CO	2,660	73.00	194,180.00
HEICO CORP-CLASS A	253	125.43	31,733.79
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,660	189.65	314,819.00
HOWMET AEROSPACE INC	1,146	35.57	40,763.22
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	117	252.71	29,567.07
IDEX CORP	206	212.34	43,742.04
ILLINOIS TOOL WORKS	765	205.87	157,490.55
INGERSOLL-RAND INC	1,003	48.89	49,036.67
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	500	45.07	22,535.00

JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	1,682	57.18	96,176.76
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	516	248.23	128,086.68
LENNOX INTERNATIONAL INC	80	235.55	18,844.00
LOCKHEED MARTIN CORP	600	460.15	276,090.00
MASCO CORP	490	48.34	23,686.60
NORDSON CORP	120	223.46	26,815.20
NORTHROP GRUMMAN CORP	370	526.75	194,897.50
OTIS WORLDWIDE CORP	1,077	68.85	74,151.45
OWENS CORNING	242	89.39	21,632.38
PACCAR INC	845	91.74	77,520.30
PARKER HANNIFIN CORP	317	281.86	89,349.62
PENTAIR PLC	520	42.23	21,959.60
PLUG POWER INC	1,148	16.57	19,022.36
QUANTA SERVICES INC	370	142.35	52,669.50
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	3,720	88.36	328,699.20
ROCKWELL AUTOMATION INC	283	241.65	68,386.95
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	358	39.46	14,126.68
SMITH (A.O.) CORP	270	52.10	14,067.00
SNAP-ON INC	152	218.24	33,172.48
STANLEY BLACK & DECKER INC	421	78.89	33,212.69
TEXTRON INC	508	64.37	32,699.96
TRANE TECHNOLOGIES PLC	554	153.96	85,293.84
TRANSDIGM GROUP INC	130	555.04	72,155.20
UNITED RENTALS INC	170	294.94	50,139.80
WABTEC CORP	412	89.98	37,071.76
WW GRAINGER INC	107	530.80	56,795.60
XYLEM INC	420	98.22	41,252.40
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	365	101.48	37,040.20
CINTAS CORP	220	410.39	90,285.80
CLARIVATE PLC	1,013	10.13	10,261.69
COPART INC	510	113.63	57,951.30
COSTAR GROUP INC	950	74.50	70,775.00
EQUIFAX INC	288	161.48	46,506.24
JACOBS SOLUTIONS INC	300	112.59	33,777.00
LEIDOS HOLDINGS INC	309	97.31	30,068.79

REPUBLIC SERVICES INC	580	135.13	78,375.40
ROBERT HALF INTL INC	290	74.75	21,677.50
ROLLINS INC	540	35.94	19,407.60
TRANSUNION	455	57.39	26,112.45
VERISK ANALYTICS INC	370	173.82	64,313.40
WASTE CONNECTIONS INC	680	132.58	90,154.40
WASTE MANAGEMENT INC	1,010	165.05	166,700.50
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	300	94.80	28,440.00
CSX CORP	5,200	28.76	149,552.00
DELTA AIR LINES INC	276	33.90	9,356.40
EXPEDITORS INTL WASH INC	427	96.03	41,004.81
FEDEX CORP	590	155.80	91,922.00
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	3,920	2.40	9,408.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	219	167.23	36,623.37
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	463	48.10	22,270.30
LYFT INC-A	641	14.81	9,493.21
NORFOLK SOUTHERN CORP	601	215.77	129,677.77
OLD DOMINION FREIGHT LINE	230	274.03	63,026.90
SOUTHWEST AIRLINES CO	466	34.62	16,132.92
UBER TECHNOLOGIES INC	3,643	28.36	103,315.48
UNION PACIFIC CORP	1,530	194.61	297,753.30
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,800	167.00	300,600.00
APTIV PLC	693	90.30	62,577.90
BORGWARNER INC	614	36.36	22,325.04
FORD MOTOR COMPANY	9,762	12.83	125,246.46
GENERAL MOTORS CORP	3,408	37.01	126,130.08
LEAR CORP	167	136.19	22,743.73
LUCID GROUP INC	1,261	13.92	17,553.12
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	870	34.49	30,006.30
TESLA INC	6,480	222.41	1,441,249.20
DR HORTON INC	790	75.41	59,573.90
GARMIN LTD	360	84.89	30,560.40
HASBRO INC	280	66.97	18,751.60
LENNAR CORP-CL A	603	78.60	47,395.80
LULULEMON ATHLETICA INC	280	320.63	89,776.40

MOHAWK INDUSTRIES INC	125	100.24	12,530.00
NEWELL BRANDS INC	1,116	15.72	17,543.52
NIKE INC -CL B	3,080	91.72	282,497.60
NVR INC	7	4,278.07	29,946.49
PULTE GROUP INC	610	39.55	24,125.50
VF CORP	800	28.63	22,904.00
WHIRLPOOL CORP	176	137.00	24,112.00
AIRBNB INC-CLASS A	890	118.45	105,420.50
ARAMARK	646	35.04	22,635.84
BOOKING HOLDINGS INC	102	1,874.61	191,210.22
CAESARS ENTERTAINMENT INC	521	42.49	22,137.29
CARNIVAL CORP	2,298	8.62	19,808.76
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	70	1,584.02	110,881.40
DARDEN RESTAURANTS INC	311	135.97	42,286.67
DOMINO'S PIZZA INC	93	328.88	30,585.84
EXPEDIA GROUP INC	397	98.71	39,187.87
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	660	130.64	86,222.40
LAS VEGAS SANDS CORP	909	34.77	31,605.93
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	680	155.43	105,692.40
MCDONALD'S CORP	1,830	255.73	467,985.90
MGM RESORTS INTERNATIONAL	761	34.19	26,018.59
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	430	50.90	21,887.00
STARBUCKS CORP	2,770	85.21	236,031.70
VAIL RESORTS INC	122	219.10	26,730.20
WYNN RESORTS LTD	353	57.44	20,276.32
YUM! BRANDS INC	724	111.24	80,537.76
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,910	72.50	138,475.00
ALPHABET INC-CL A	14,740	104.48	1,540,035.20
ALPHABET INC-CL C	13,920	104.93	1,460,625.60
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	1,331	6.75	8,984.25
CABLE ONE INC	17	800.99	13,616.83
CHARTER COMMUNICATION-A	295	346.71	102,279.45
COMCAST CORP-CLASS A	10,850	31.56	342,426.00
DISH NETWORK CORP-A	595	14.95	8,895.25
ELECTRONIC ARTS INC	695	127.74	88,779.30

FOX CORP - CLASS A	1,043	29.84	31,123.12
IAC INC	168	50.28	8,447.04
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	932	30.07	28,025.24
LIBERTY BROADBAND-C	290	79.41	23,028.90
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	623	42.31	26,359.13
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	514	59.01	30,331.14
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	399	81.71	32,602.29
MATCH GROUP INC	682	45.43	30,983.26
META PLATFORMS INC-CLASS A	5,620	137.51	772,806.20
NETFLIX INC	1,070	291.02	311,391.40
NEWS CORP - CLASS A	1,331	17.17	22,853.27
OMNICOM GROUP	510	71.71	36,572.10
PARAMOUNT GLOBAL	1,604	19.67	31,550.68
PINTEREST INC- CLASS A	1,316	22.59	29,728.44
ROBLOX CORP -CLASS A	900	45.71	41,139.00
ROKU INC	306	55.34	16,934.04
SEA LTD-ADR	950	50.01	47,509.50
SNAP INC - A	2,685	9.60	25,776.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	417	125.03	52,137.51
THE WALT DISNEY CO.	4,440	104.36	463,358.40
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1,090	57.84	63,045.60
TWITTER INC	1,690	52.78	89,198.20
WARNER BROS DISCOVERY INC	5,845	13.57	79,316.65
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	594	46.68	27,727.92
ADVANCE AUTO PARTS INC	133	181.40	24,126.20
AMAZON.COM INC	22,480	120.60	2,711,088.00
AUTOZONE INC	52	2,439.89	126,874.28
BATH & BODY WORKS INC	593	34.70	20,577.10
BEST BUY CO INC	559	65.69	36,720.71
BURLINGTON STORES INC	158	140.47	22,194.26
CARMAX INC	443	61.85	27,399.55
CHEWY INC - CLASS A	225	39.79	8,952.75
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	568	250.46	142,261.28
DOLLAR TREE INC	576	153.90	88,646.40
DOORDASH INC - A	460	47.46	21,831.60

EBAY INC	1,260	38.97	49,102.20
ETSY INC	348	103.24	35,927.52
GENUINE PARTS CO	390	171.65	66,943.50
HOME DEPOT INC	2,520	290.26	731,455.20
LKQ CORP	715	53.90	38,538.50
LOWE'S COS INC	1,550	193.85	300,467.50
MERCADOLIBRE INC	110	862.97	94,926.70
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	162	775.73	125,668.26
POOL CORP	94	298.54	28,062.76
ROSS STORES INC	790	93.07	73,525.30
TARGET CORP	1,110	165.80	184,038.00
TJX COMPANIES INC	2,923	70.46	205,954.58
TRACTOR SUPPLY COMPANY	288	214.29	61,715.52
ULTA BEAUTY INC	130	395.40	51,402.00
WAYFAIR INC- CLASS A	198	34.52	6,834.96
COSTCO WHOLESALE CORP	1,090	499.06	543,975.40
KROGER CO	1,720	44.77	77,004.40
SYSCO CORP	1,260	82.52	103,975.20
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,889	35.52	67,097.28
WALMART INC	3,750	140.07	525,262.50
ALTRIA GROUP INC	4,519	45.74	206,699.06
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,431	91.14	130,421.34
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	757	66.82	50,582.74
BUNGE LTD	384	91.97	35,316.48
CAMPBELL SOUP CO	618	51.16	31,616.88
COCA-COLA CO/THE	10,170	58.95	599,521.50
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	578	46.82	27,061.96
CONAGRA BRANDS INC	1,363	35.04	47,759.52
CONSTELLATION BRANDS INC-A	400	238.75	95,500.00
GENERAL MILLS INC	1,530	78.30	119,799.00
HERSHEY CO/THE	373	234.12	87,326.76
HORMEL FOODS CORP	696	45.16	31,431.36
JM SMUCKER CO/THE	281	146.00	41,026.00
KELLOGG CO	581	74.09	43,046.29
KEURIG DR PEPPER INC	2,054	38.55	79,181.70

KRAFT HEINZ CO/THE	1,765	37.06	65,410.90
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	634	76.13	48,266.42
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	389	50.57	19,671.73
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	3,412	59.31	202,365.72
MONSTER BEVERAGE CORP	983	91.66	90,101.78
PEPSICO INC	3,400	178.27	606,118.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	3,810	88.50	337,185.00
TYSON FOODS INC-CL A	731	67.03	48,998.93
CHURCH & DWIGHT CO INC	624	75.62	47,186.88
CLOROX COMPANY	311	140.46	43,683.06
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,930	72.76	140,426.80
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	560	205.12	114,867.20
KIMBERLY-CLARK CORP	872	119.49	104,195.28
PROCTER & GAMBLE CO	5,930	130.86	775,999.80
ABBOTT LABORATORIES	4,290	97.95	420,205.50
ABIOMED INC	101	264.29	26,693.29
ALIGN TECHNOLOGY INC	189	217.98	41,198.22
AMERISOURCEBERGEN CORP	379	152.77	57,899.83
BAXTER INTERNATIONAL INC	1,263	57.11	72,129.93
BECTON DICKINSON AND CO	720	225.70	162,504.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	3,515	41.30	145,169.50
CARDINAL HEALTH INC	643	73.72	47,401.96
CENTENE CORP	1,485	83.63	124,190.55
CIGNA CORP	780	310.92	242,517.60
COOPER COS INC/THE	138	265.26	36,605.88
CVS HEALTH CORP	3,220	92.22	296,948.40
DENTSPLY SIRONA INC	651	30.31	19,731.81
DEXCOM INC	910	100.95	91,864.50
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,540	85.70	131,978.00
ELEVANCE HEALTH INC	590	523.95	309,130.50
HCA HEALTHCARE INC	570	214.40	122,208.00
HENRY SCHEIN INC	310	69.67	21,597.70
HOLOGIC INC	616	65.30	40,224.80
HUMANA INC	310	529.46	164,132.60
IDEXX LABORATORIES INC	195	352.35	68,708.25



INSULET CORP	183	238.03	43,559.49
INTUITIVE SURGICAL INC	850	237.87	202,189.50
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	228	228.21	52,031.88
MASIMO CORP	158	134.98	21,326.84
MCKESSON CORP	360	382.43	137,674.80
MEDTRONIC PLC	3,200	84.50	270,400.00
MOLINA HEALTHCARE INC	160	366.25	58,600.00
NOVOCURE LTD	202	66.91	13,515.82
QUEST DIAGNOSTICS	309	144.05	44,511.45
RESMED INC	359	229.98	82,562.82
STERIS PLC	230	171.90	39,537.00
STRYKER CORP	810	224.62	181,942.20
TELADOC HEALTH INC	390	26.75	10,432.50
TELEFLEX INC	138	204.39	28,205.82
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,310	540.22	1,247,908.20
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	184	96.68	17,789.12
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	354	166.68	59,004.72
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	542	110.73	60,015.66
ABBVIE INC	4,360	149.82	653,215.20
AGILENT TECHNOLOGIES INC	774	134.50	104,103.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	289	198.56	57,383.84
AMGEN INC	1,310	259.99	340,586.90
AVANTOR INC	1,461	20.53	29,994.33
BIO-RAD LABORATORIES-A	64	389.00	24,896.00
BIO-TECHNE CORP	97	296.60	28,770.20
BIOGEN INC	355	273.56	97,113.80
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	488	91.47	44,637.36
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	5,260	72.77	382,770.20
CATALENT INC	429	71.36	30,613.44
CHARLES RIVER LABORATORIES	125	219.12	27,390.00
DANAHER CORP	1,700	251.87	428,179.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	880	13.31	11,712.80
ELI LILLY & CO	1,990	351.31	699,106.90
EXACT SCIENCES CORP	426	33.38	14,219.88
GILEAD SCIENCES INC	3,060	69.60	212,976.00

HORIZON THERAPEUTICS PLC	519	66.13	34,321.47
ILLUMINA INC	387	230.12	89,056.44
INCYTE CORP	431	72.42	31,213.02
IQVIA HOLDINGS INC	460	197.65	90,919.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	140	137.62	19,266.80
JOHNSON & JOHNSON	6,490	170.71	1,107,907.90
MERCK & CO. INC.	6,230	97.71	608,733.30
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	54	1,230.89	66,468.06
MODERNA INC	857	136.57	117,040.49
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	220	112.59	24,769.80
PERKINELMER INC	293	136.43	39,973.99
PFIZER INC	13,800	45.59	629,142.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	270	747.33	201,779.10
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	845	41.42	34,999.90
SEAGEN INC	340	128.77	43,781.80
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	3,353	8.57	28,735.21
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	970	514.62	499,181.40
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	630	309.21	194,802.30
VIATRIS INC	3,111	9.78	30,425.58
WATERS CORP	151	296.81	44,818.31
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	199	249.21	49,592.79
ZOETIS INC	1,169	152.30	178,038.70
BANK OF AMERICA CORP	17,640	35.39	624,279.60
CITIGROUP INC	4,650	45.32	210,738.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,172	40.44	47,395.68
FIFTH THIRD BANCORP	1,734	35.35	61,296.90
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	30	847.92	25,437.60
FIRST REPUBLIC BANK/CA	438	117.40	51,421.20
HUNTINGTON BANCSHARES INC	3,576	14.84	53,067.84
JPMORGAN CHASE & CO	7,170	122.70	879,759.00
KEYCORP	2,531	17.77	44,975.87
M & T BANK CORP	450	163.50	73,575.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	990	163.22	161,587.80
REGIONS FINANCIAL CORP	2,407	21.23	51,100.61
SIGNATURE BANK	160	152.55	24,408.00

SVB FINANCIAL GROUP	143	239.50	34,248.50
TRUIST FINANCIAL CORP	3,120	43.85	136,812.00
US BANCORP	3,380	42.01	141,993.80
WEBSTER FINANCIAL CORP	500	52.87	26,435.00
WELLS FARGO & CO	9,210	45.37	417,857.70
ALLY FINANCIAL INC	670	27.12	18,170.40
AMERICAN EXPRESS CO	1,602	147.02	235,526.04
AMERIPRISE FINANCIAL INC	263	278.26	73,182.38
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	950	54.31	51,594.50
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	1,990	41.60	82,784.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	3,170	289.24	916,890.80
BLACKROCK INC	360	635.94	228,938.40
BLACKSTONE INC	1,760	91.55	161,128.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	930	101.58	94,469.40
CBOE GLOBAL MARKETS INC	306	124.41	38,069.46
CME GROUP INC	870	175.80	152,946.00
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	310	75.05	23,265.50
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	728	99.97	72,778.16
EQUITABLE HOLDINGS INC	960	29.36	28,185.60
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	90	419.26	37,733.40
FRANKLIN RESOURCES INC	780	23.45	18,291.00
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	139	32.94	4,578.66
GOLDMAN SACHS GROUP INC	830	332.40	275,892.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,390	95.16	132,272.40
INVESCO LTD	990	15.05	14,899.50
KKR & CO INC -A	1,463	47.27	69,156.01
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	200	244.98	48,996.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	94	246.77	23,196.38
MOODY'S CORP	419	257.62	107,942.78
MORGAN STANLEY	3,190	80.51	256,826.90
MSCI INC	204	448.42	91,477.68
NASDAQ INC	867	60.55	52,496.85
NORTHERN TRUST CORP	508	82.02	41,666.16
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	480	104.78	50,294.40
S&P GLOBAL INC	840	312.03	262,105.20

SCHWAB (CHARLES) CORP	3,550	72.46	257,233.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	347	48.99	16,999.53
STATE STREET CORP	955	72.05	68,807.75
SYNCHRONY FINANCIAL	1,226	34.95	42,848.70
T ROWE PRICE GROUP INC	480	108.69	52,171.20
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	333	54.55	18,165.15
AFLAC INC	1,500	61.95	92,925.00
ALLSTATE CORP	660	124.65	82,269.00
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	204	133.26	27,185.04
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,940	54.29	105,322.60
AON PLC	531	280.00	148,680.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	955	49.22	47,005.10
ARTHUR J GALLAGHER & CO	544	175.42	95,428.48
ASSURANT INC	167	152.74	25,507.58
BROWN & BROWN INC	595	55.10	32,784.50
CHUBB LTD	1,070	201.43	215,530.10
CINCINNATI FINANCIAL CORP	382	98.95	37,798.90
EVEREST RE GROUP LTD	105	283.06	29,721.30
FNF GROUP	589	38.09	22,435.01
GLOBE LIFE INC	215	114.64	24,647.60
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	827	69.49	57,468.23
LINCOLN NATIONAL CORP	407	52.74	21,465.18
LOEWS CORP	575	55.76	32,062.00
MARKEL CORP	34	1,153.46	39,217.64
MARSH & MCLENNAN COS	1,244	153.11	190,468.84
METLIFE INC	1,690	70.93	119,871.70
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	658	80.14	52,732.12
PROGRESSIVE CORP	1,474	122.11	179,990.14
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	962	101.40	97,546.80
TRAVELERS COS INC/THE	590	176.09	103,893.10
WILLIS TOWERS WATSON PLC	290	211.47	61,326.30
WR BERKLEY CORP	600	69.07	41,442.00
CBRE GROUP INC - A	903	71.96	64,979.88
ZILLOW GROUP INC - C	478	31.21	14,918.38
ACCENTURE PLC-CL A	1,560	280.61	437,751.60

ADOBE INC	1,150	323.79	372,358.50
AFFIRM HOLDINGS INC	477	20.62	9,835.74
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	370	88.45	32,726.50
ANSYS INC	190	219.50	41,705.00
AUTODESK INC	520	215.72	112,174.40
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,030	237.76	244,892.80
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	519	35.56	18,455.64
BILL.COM HOLDINGS INC	260	133.80	34,788.00
BLACK KNIGHT INC	380	64.05	24,339.00
BLOCK INC	1,332	59.66	79,467.12
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	279	144.39	40,284.81
CADENCE DESIGN SYS INC	690	151.32	104,410.80
CERIDIAN HCM HOLDING INC	312	63.46	19,799.52
CHECK POINT SOFTWARE TECH	291	116.73	33,968.43
CLOUDFLARE INC-CLASS A	590	57.55	33,954.50
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	1,308	61.48	80,415.84
COUPA SOFTWARE INC	188	54.27	10,202.76
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	502	162.11	81,379.22
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	121	156.19	18,898.99
DATADOG INC-CLASS A	630	88.75	55,912.50
DOCUSIGN INC	501	50.23	25,165.23
DROPBOX INC-CLASS A	608	22.12	13,448.96
DYNATRACE INC	565	35.26	19,921.90
EPAM SYSTEMS INC	140	348.13	48,738.20
FAIR ISAAC CORP	62	432.75	26,830.50
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	1,514	79.95	121,044.30
FISERV INC	1,528	100.08	152,922.24
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	192	177.99	34,174.08
FORTINET INC	1,695	55.92	94,784.40
GARTNER INC	196	298.93	58,590.28
GLOBAL PAYMENTS INC	700	118.18	82,726.00
GODADDY INC-CLASS A	443	79.65	35,284.95
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	175	58.76	10,283.00
HUBSPOT INC	123	290.58	35,741.34
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,200	132.93	292,446.00

INTUIT INC	650	432.08	280,852.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	201	192.67	38,726.67
MASTERCARD INC	2,130	311.41	663,303.30
MICROSOFT CORP	17,470	250.66	4,379,030.20
MONGODB INC	180	200.69	36,124.20
NORTONLIFELOCK INC	1,407	22.25	31,305.75
OKTA INC	349	58.31	20,350.19
ORACLE CORP	3,930	73.14	287,440.20
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	4,101	8.66	35,514.66
PALO ALTO NETWORKS INC	735	166.19	122,149.65
PAYCHEX INC	805	116.48	93,766.40
PAYCOM SOFTWARE INC	120	337.16	40,459.20
PAYPAL HOLDINGS INC	2,640	89.24	235,593.60
PTC INC	270	115.36	31,147.20
RINGCENTRAL INC-CLASS A	201	35.12	7,059.12
ROPER TECHNOLOGIES INC	258	378.00	97,524.00
SALESFORCE INC	2,420	165.27	399,953.40
SERVICENOW INC	490	376.66	184,563.40
SNOWFLAKE INC-CLASS A	530	181.82	96,364.60
SPLUNK INC	350	82.87	29,004.50
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	603	49.58	29,896.74
SYNOPSYS INC	379	294.73	111,702.67
TWILIO INC - A	437	76.61	33,478.57
TYLER TECHNOLOGIES INC	99	346.06	34,259.94
UNITY SOFTWARE INC	460	29.67	13,648.20
VERISIGN INC	250	187.82	46,955.00
VISA INC-CLASS A SHARES	4,040	194.38	785,295.20
VMWARE INC-CLASS A	510	111.42	56,824.20
WESTERN UNION CO	1,045	13.92	14,546.40
WIX.COM LTD	150	85.97	12,895.50
WORKDAY INC-CLASS A	440	156.18	68,719.20
ZENDESK INC	271	76.35	20,690.85
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	567	84.09	47,679.03
ZSCALER INC	227	157.09	35,659.43
AMPHENOL CORP-CL A	1,538	72.75	111,889.50

APPLE INC	39,770	152.34	6,058,561.80
ARISTA NETWORKS INC	616	112.63	69,380.08
ARROW ELECTRONICS INC	170	100.07	17,011.90
CDW CORP/DE	335	168.56	56,467.60
CISCO SYSTEMS INC	10,050	44.36	445,818.00
COGNEX CORP	423	45.99	19,453.77
CORNING INC	2,001	31.73	63,491.73
DELL TECHNOLOGIES -C	750	37.74	28,305.00
F5 INC	167	153.47	25,629.49
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	3,272	13.85	45,317.20
HP INC	2,624	27.58	72,369.92
JUNIPER NETWORKS INC	802	29.16	23,386.32
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	455	173.71	79,038.05
MOTOROLA SOLUTIONS INC	407	239.68	97,549.76
NETAPP INC	510	67.85	34,603.50
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	463	58.00	26,854.00
TE CONNECTIVITY LTD	799	117.27	93,698.73
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	120	360.39	43,246.80
TRIMBLE INC	590	58.15	34,308.50
WESTERN DIGITAL CORP	807	35.29	28,479.03
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	120	274.58	32,949.60
AT&T INC	17,520	17.69	309,928.80
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	1,319	17.83	23,517.77
LUMEN TECHNOLOGIES INC	2,399	6.92	16,601.08
T-MOBILE US INC	1,582	140.63	222,476.66
VERIZON COMMUNICATIONS INC	10,250	36.43	373,407.50
AES CORP	1,586	25.19	39,951.34
ALLIANT ENERGY CORP	583	50.72	29,569.76
AMEREN CORPORATION	628	79.52	49,938.56
AMERICAN ELECTRIC POWER	1,261	87.42	110,236.62
AMERICAN WATER WORKS CO INC	430	139.55	60,006.50
ATMOS ENERGY CORP	310	103.32	32,029.20
CENTERPOINT ENERGY INC	1,520	27.65	42,028.00
CMS ENERGY CORP	670	55.75	37,352.50
CONSOLIDATED EDISON INC	860	85.85	73,831.00

CONSTELLATION ENERGY	828	88.15	72,988.20
DOMINION ENERGY INC	1,960	66.92	131,163.20
DTE ENERGY COMPANY	470	109.13	51,291.10
DUKE ENERGY CORP	1,918	90.24	173,080.32
EDISON INTERNATIONAL	935	56.85	53,154.75
ENERGY CORP	480	104.75	50,280.00
ESSENTIAL UTILITIES INC	610	42.37	25,845.70
EVERGY INC	527	59.46	31,335.42
EVERSOURCE ENERGY	804	74.15	59,616.60
EXELON CORP	2,350	37.76	88,736.00
FIRSTENERGY CORP	1,280	37.58	48,102.40
NEXTERA ENERGY INC	4,810	75.86	364,886.60
NISOURCE INC	1,151	25.13	28,924.63
NRG ENERGY INC	676	43.64	29,500.64
P G & E CORP	4,032	15.13	61,004.16
PPL CORP	1,773	25.96	46,027.08
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	1,249	56.08	70,043.92
SEMPRA ENERGY	770	146.22	112,589.40
SOUTHERN CO	2,649	65.72	174,092.28
UGI CORP	547	34.07	18,636.29
VISTRA CORP	921	21.99	20,252.79
WEC ENERGY GROUP INC	789	87.77	69,250.53
XCEL ENERGY INC	1,319	62.40	82,305.60
ADVANCED MICRO DEVICES	3,940	61.47	242,191.80
ANALOG DEVICES INC	1,309	146.37	191,598.33
APPLIED MATERIALS INC	2,110	87.53	184,688.30
BROADCOM INC	990	460.07	455,469.30
ENPHASE ENERGY INC	348	265.59	92,425.32
ENTEGRIS INC	350	79.74	27,909.00
INTEL CORP	9,900	27.41	271,359.00
KLA CORP	375	304.87	114,326.25
LAM RESEARCH CORP	330	379.86	125,353.80
MARVELL TECHNOLOGY INC	2,109	40.61	85,646.49
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	1,360	64.48	87,692.80
MICRON TECHNOLOGY INC	2,710	55.87	151,407.70



	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	109	342.16	37,295.44	
	NVIDIA CORP	6,130	132.61	812,899.30	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	655	148.74	97,424.70	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	1,060	66.59	70,585.40	
	QORVO INC	316	86.04	27,188.64	
	QUALCOMM INC	2,750	119.17	327,717.50	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	437	86.68	37,879.16	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	130	215.61	28,029.30	
	TERADYNE INC	403	79.65	32,098.95	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	2,270	162.16	368,103.20	
米ドル小計		837,269		82,346,654.50	(12,206,244,596)
加ドル	ARC RESOURCES LTD	1,760	18.71	32,929.60	
	CAMECO CORP	960	33.40	32,064.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	2,890	80.80	233,512.00	
	CENOVUS ENERGY INC	3,560	26.53	94,446.80	
	ENBRIDGE INC	4,870	51.89	252,704.30	
	IMPERIAL OIL LTD	600	65.80	39,480.00	
	KEYERA CORP	660	28.66	18,915.60	
	PARKLAND CORP	500	27.00	13,500.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	1,380	43.68	60,278.40	
	SUNCOR ENERGY INC	3,660	45.47	166,420.20	
	TC ENERGY CORP	2,391	58.16	139,060.56	
	TOURMALINE OIL CORP	870	75.23	65,450.10	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	1,050	58.48	61,404.00	
	BARRICK GOLD CORP	4,489	20.77	93,236.53	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	530	66.19	35,080.70	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	1,389	24.97	34,683.33	
	FRANCO-NEVADA CORP	507	166.48	84,405.36	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	1,881	9.22	17,342.82	
	KINROSS GOLD CORP	4,540	4.90	22,246.00	
	LUNDIN MINING CORP	1,990	7.06	14,049.40	
	NUTRIEN LTD	1,380	113.14	156,133.20	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	611	21.82	13,332.02	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	1,299	46.85	60,858.15	

WEST FRASER TIMBER CO LTD	150	100.48	15,072.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,081	44.87	48,504.47
CAE INC	753	25.00	18,825.00
WSP GLOBAL INC	330	161.29	53,225.70
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	503	36.32	18,268.96
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	280	87.31	24,446.80
THOMSON REUTERS CORP	543	142.52	77,388.36
AIR CANADA	550	18.74	10,307.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,480	157.25	232,730.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	2,340	97.74	228,711.60
TFI INTERNATIONAL INC	260	132.75	34,515.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	684	73.32	50,150.88
GILDAN ACTIVEWEAR INC	660	43.27	28,558.20
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	708	78.17	55,344.36
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	1,223	34.06	41,655.38
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	139	150.68	20,944.52
DOLLARAMA INC	672	82.00	55,104.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	2,141	59.58	127,560.78
LOBLAW COMPANIES LTD	480	111.36	53,452.80
METRO INC	776	70.87	54,995.12
SAPUTO INC	748	32.67	24,437.16
BANK OF MONTREAL	1,600	124.59	199,344.00
BANK OF NOVA SCOTIA	2,850	65.34	186,219.00
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	2,242	60.09	134,721.78
NATIONAL BANK OF CANADA	855	90.76	77,599.80
ROYAL BANK OF CANADA	3,420	123.88	423,669.60
TORONTO-DOMINION BANK	4,380	87.29	382,330.20
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	3,587	53.36	191,402.32
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	60	646.89	38,813.40
GREAT-WEST LIFECO INC	917	30.33	27,812.61
INTACT FINANCIAL CORP	473	202.00	95,546.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	4,480	22.28	99,814.40
POWER CORP OF CANADA	1,536	32.67	50,181.12
SUN LIFE FINANCIAL INC	1,360	56.93	77,424.80
FIRSTSERVICE CORP	137	174.38	23,890.06

	BLACKBERRY LTD	1,625	6.21	10,091.25	
	CGI INC	605	108.52	65,654.60	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	50	1,949.41	97,470.50	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	310	25.23	7,821.30	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	150	39.80	5,970.00	
	OPEN TEXT CORP	973	38.83	37,781.59	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	2,810	40.63	114,170.30	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	971	53.63	52,074.73	
	TELUS CORP	1,220	28.35	34,587.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	1,915	14.65	28,054.75	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	411	42.02	17,270.22	
	EMERA INC	675	51.38	34,681.50	
	FORTIS INC	1,130	51.84	58,579.20	
	HYDRO ONE LTD	950	32.80	31,160.00	
	NORTHLAND POWER INC	703	38.97	27,395.91	
加ドル小計		102,663		5,647,263.10 (613,801,026)	
ユーロ	ENI SPA	6,644	12.32	81,867.36	
	NESTE OYJ	1,076	47.72	51,346.72	
	OMV AG	430	41.20	17,716.00	
	REPSOL SA	3,620	13.09	47,403.90	
	TOTALENERGIES SE	5,990	53.25	318,967.50	
	AIR LIQUIDE SA	1,325	132.50	175,562.50	
	AKZO NOBEL	468	62.88	29,427.84	
	ARCELORMITTAL	1,080	22.84	24,672.60	
	ARKEMA	208	79.22	16,477.76	
	BASF SE	2,348	45.94	107,878.86	
	COVESTRO AG	543	34.37	18,662.91	
	CRH PLC	1,988	35.42	70,424.90	
	HEIDELBERGCEMENT AG	333	44.62	14,858.46	
	KONINKLIJKE DSM NV	480	126.65	60,792.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	739	33.74	24,933.86	
	SOLVAY SA	192	91.50	17,568.00	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	1,558	14.08	21,944.43	
	SYMRISE AG	310	103.25	32,007.50	

UMICORE	604	33.27	20,095.08
UPM-KYMMENE OYJ	1,438	35.20	50,617.60
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	774	24.71	19,125.54
AIRBUS GROUP SE	1,420	104.06	147,765.20
ALSTOM	875	19.25	16,843.75
BOUYGUES SA	502	28.13	14,121.26
BRENTAG SE	402	60.88	24,473.76
CNH INDUSTRIAL NV	2,756	12.78	35,221.68
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	1,267	41.49	52,567.83
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	1,179	26.32	31,031.28
EIFFAGE	260	87.86	22,843.60
FERROVIAL SA	1,472	23.62	34,768.64
GEA GROUP AG	486	35.66	17,330.76
IMCD NV	150	129.50	19,425.00
KINGSPAN GROUP PLC	450	51.72	23,274.00
KION GROUP AG	261	21.51	5,614.11
KNORR-BREMSE AG	225	45.07	10,140.75
KONE OYJ-B	899	39.14	35,186.86
LEGRAND SA	570	76.44	43,570.80
MTU AERO ENGINES AG	140	174.25	24,395.00
PRYSMIAN SPA	690	33.51	23,121.90
RATIONAL AG	15	567.50	8,512.50
SAFRAN SA	876	110.34	96,657.84
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,350	131.30	177,255.00
SIEMENS AG-REG	1,820	111.24	202,456.80
SIEMENS ENERGY AG	891	11.24	10,019.29
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	758	17.92	13,587.15
THALES SA	278	121.60	33,804.80
VINCI SA	1,220	90.19	110,031.80
WARTSILA OYJ ABP	1,289	6.76	8,716.21
BUREAU VERITAS SA	1,035	24.54	25,398.90
RANDSTAD NV	417	48.62	20,274.54
TELEPERFORMANCE	160	274.80	43,968.00
WOLTERS KLUWER	669	107.45	71,884.05
ADP	93	129.70	12,062.10

AENA SA	247	109.15	26,960.05
ATLANTIA SPA	1,458	22.68	33,067.44
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,970	6.63	13,063.07
DEUTSCHE POST AG-REG	2,400	35.59	85,416.00
GETLINK	1,605	15.44	24,781.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	930	78.22	72,744.60
CONTINENTAL AG	268	51.74	13,866.32
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	300	98.00	29,400.00
FERRARI NV	325	199.05	64,691.25
MERCEDES-BENZ GROUP AG	2,100	58.30	122,430.00
MICHELIN (CGDE)	1,616	25.53	41,256.48
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	404	57.48	23,221.92
RENAULT SA	379	31.84	12,067.36
STELLANTIS NV	6,119	13.53	82,790.07
VALEO SA	686	17.01	11,668.86
VOLKSWAGEN AG-PFD	460	131.18	60,342.80
ADIDAS AG	440	100.50	44,220.00
HERMES INTERNATIONAL	80	1,354.50	108,360.00
KERING	190	472.40	89,756.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	680	658.00	447,440.00
MONCLER SPA	532	48.93	26,030.76
PUMA SE	260	46.82	12,173.20
ACCOR SA	541	22.96	12,421.36
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	443	131.25	58,143.75
SODEXO	273	87.14	23,789.22
PUBLICIS GROUPE	562	58.56	32,910.72
SCOUT24 SE	240	52.66	12,638.40
UBISOFT ENTERTAINMENT	247	27.25	6,730.75
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	2,083	21.09	43,940.88
VIVENDI SE	2,083	8.32	17,330.56
DELIVERY HERO SE	387	36.17	13,997.79
INDITEX	2,460	23.61	58,080.60
JUST EAT TAKEAWAY	537	16.83	9,040.93
PROSUS	2,040	41.77	85,210.80
ZALANDO SE	601	24.12	14,496.12

CARREFOUR SA	1,713	15.54	26,620.02
HELLOFRESH SE	442	22.42	9,909.64
KESKO OYJ-B SHS	643	18.98	12,207.35
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	2,730	28.14	76,822.20
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	2,173	47.41	103,021.93
DANONE	1,686	48.58	81,914.31
HEINEKEN HOLDING NV	280	70.20	19,656.00
HEINEKEN NV	660	88.18	58,198.80
KERRY GROUP PLC-A	390	94.02	36,667.80
PERNOD-RICARD SA	520	177.55	92,326.00
BEIERSDORF AG	244	101.85	24,851.40
HENKEL AG & CO KGAA	373	59.05	22,025.65
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	404	63.22	25,540.88
L'OREAL	600	321.65	192,990.00
AMPLIFON SPA	380	26.25	9,975.00
BIOMERIEUX	146	92.30	13,475.80
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	135	121.55	16,409.25
DIASORIN ITALIA SPA	90	136.25	12,262.50
ESSILORLUXOTTICA	700	165.00	115,500.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	585	28.24	16,520.40
FRESENIUS SE & CO KGAA	1,254	22.15	27,776.10
KONINKLIJKE PHILIPS NV	2,379	13.02	30,988.85
SIEMENS HEALTHINEERS AG	723	46.41	33,554.43
ARGENX SE	140	389.90	54,586.00
BAYER AG-REG	2,468	50.87	125,547.16
EUROFINS SCIENTIFIC	362	64.98	23,522.76
GRIFOLS SA	713	8.37	5,970.66
IPSEN	120	97.95	11,754.00
MERCK KGAA	308	167.50	51,590.00
QIAGEN N.V.	550	43.62	23,991.00
SANOFI	2,750	82.29	226,297.50
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	60	352.70	21,162.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	76	319.30	24,266.80
UCB SA	286	74.56	21,324.16
ABN AMRO BANK NV-CVA	809	9.80	7,929.81

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	16,027	5.23	83,821.21
BANCO SANTANDER SA	42,620	2.73	116,714.87
BNP PARIBAS	2,751	47.33	130,218.58
CAIXABANK S.A	11,895	3.52	41,977.45
COMMERZBANK AG	2,690	8.25	22,192.50
CREDIT AGRICOLE SA	3,122	9.09	28,391.46
ERSTE GROUP BANK AG	838	24.81	20,790.78
FINECOBANK SPA	1,495	13.54	20,242.30
ING GROEP NV-CVA	9,510	9.88	94,044.39
INTESA SANPAOLO	42,240	1.86	78,760.70
KBC GROEP NV	743	51.08	37,952.44
MEDIOBANCA SPA	2,222	8.80	19,566.93
SOCIETE GENERALE	2,059	23.27	47,912.93
UNICREDIT SPA	5,231	11.52	60,261.12
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	5,491	9.26	50,879.60
DEUTSCHE BOERSE AG	500	162.70	81,350.00
EURONEXT NV	180	64.50	11,610.00
EXOR NV	344	67.58	23,247.52
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	250	74.82	18,705.00
AEGON NV	4,432	4.38	19,421.02
AGEAS	414	38.16	15,798.24
ALLIANZ SE-REG	970	177.36	172,039.20
ASSICURAZIONI GENERALI	2,489	14.85	36,974.09
AXA SA	4,260	24.97	106,372.20
HANNOVER RUECK SE-REG	148	160.55	23,761.40
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	300	261.80	78,540.00
NN GROUP NV	906	42.39	38,405.34
SAMPO OYJ-A SHS	1,336	46.06	61,536.16
AROUNDTOWN SA	3,248	2.00	6,512.24
LEG IMMOBILIEN SE	250	65.76	16,440.00
VONOVIA SE	1,930	22.28	43,000.40
ADYEN NV	54	1,432.60	77,360.40
AMADEUS IT GROUP SA	1,169	51.58	60,297.02
CAP GEMINI SA	390	173.00	67,470.00
DASSAULT SYSTEMES SE	1,680	36.67	61,614.00

EDENRED	658	49.90	32,834.20	
NEMETSCHEK SE	178	52.02	9,259.56	
NEXI SPA	1,336	8.78	11,730.08	
SAP SE	2,500	97.25	243,125.00	
WORLDLINE SA	704	43.77	30,814.08	
NOKIA OYJ	13,580	4.47	60,811.24	
CELLNEX TELECOM SA	1,417	30.69	43,487.73	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	8,020	18.52	148,546.44	
ELISA OYJ	390	47.17	18,396.30	
KONINKLIJKE KPN NV	9,792	2.70	26,467.77	
ORANGE S.A.	5,254	9.40	49,413.87	
TELECOM ITALIA SPA	22,100	0.19	4,351.49	
TELEFONICA SA	13,630	3.25	44,311.13	
E.ON SE	5,959	8.30	49,507.37	
EDF	1,761	11.95	21,043.95	
EDP RENOVAVEIS SA	838	20.68	17,329.84	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	9,250	4.39	40,663.00	
ENDESA SA	822	15.56	12,794.43	
ENEL SPA	21,112	4.37	92,449.44	
ENGIE	4,500	13.04	58,689.00	
FORTUM OYJ	1,026	13.98	14,343.48	
IBERDROLA SA	14,050	9.86	138,561.10	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	1,450	15.71	22,786.75	
RWE AG	1,700	39.15	66,555.00	
SNAM SPA	7,266	4.43	32,224.71	
TERNA SPA	4,271	6.57	28,069.01	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,640	22.73	37,277.20	
VERBUND AG	152	81.70	12,418.40	
ASM INTERNATIONAL NV	116	278.15	32,265.40	
ASML HOLDING NV	990	496.00	491,040.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	3,330	26.27	87,495.75	
STMICROELECTRONICS NV	1,769	35.18	62,233.42	
ユーロ小計	456,606		10,045,789.53 (1,480,347,545)	
英債券	BP PLC	46,390	4.65	215,991.84



SHELL PLC-NEW	18,220	22.89	417,146.90
ANGLO AMERICAN PLC	3,080	26.58	81,881.80
ANTOFAGASTA PLC	1,183	11.46	13,563.09
CRODA INTERNATIONAL PLC	385	68.48	26,364.80
GLENCORE PLC	24,130	5.02	121,301.51
JOHNSON MATTHEY PLC	515	19.39	9,985.85
MONDI PLC	1,379	15.04	20,740.16
RIO TINTO PLC	2,720	47.14	128,220.80
ASHTED GROUP PLC	1,010	44.42	44,864.20
BAE SYSTEMS PLC ORD	8,085	8.05	65,116.59
BUNZL PLC	865	28.15	24,349.75
DCC PLC	217	48.86	10,602.62
FERGUSON PLC	496	95.00	47,120.00
MELROSE INDUSTRIES PLC	10,179	1.09	11,115.46
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	23,501	0.73	17,317.88
SMITHS GROUP PLC	845	15.48	13,084.82
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	235	109.45	25,720.75
EXPERIAN PLC	2,070	27.40	56,718.00
INTERTEK GROUP PLC	389	38.17	14,848.13
RELX PLC	4,580	23.12	105,889.60
RENTOKIL INITIAL PLC	4,172	5.21	21,769.49
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,356	3.72	8,785.52
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	290	35.20	10,208.00
BURBERRY GROUP PLC	993	18.77	18,643.57
PERSIMMON PLC	994	13.02	12,946.85
TAYLOR WIMPEY PLC	6,807	0.95	6,472.09
COMPASS GROUP PLC	4,330	18.19	78,784.35
ENTAIN PLC	1,657	12.42	20,579.94
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	510	45.77	23,342.70
WHITBREAD PLC	639	26.22	16,754.58
AUTO TRADER GROUP PLC	2,915	5.12	14,948.12
INFORMA PLC	4,393	5.64	24,776.52
PEARSON PLC	1,530	9.57	14,648.22
WPP PLC	3,319	7.69	25,543.02
JD SPORTS FASHION PLC	8,520	0.98	8,375.16

KINGFISHER PLC	6,190	2.13	13,197.08
NEXT PLC	320	50.32	16,102.40
OCADO GROUP PLC	1,268	5.04	6,400.86
TESCO PLC	19,005	2.11	40,100.55
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	857	13.55	11,616.63
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	5,250	33.84	177,660.00
COCA-COLA HBC AG-CDI	556	19.53	10,861.46
DIAGEO PLC	5,570	36.29	202,163.15
IMPERIAL BRANDS PLC	2,170	20.99	45,548.30
HALEON PLC	12,906	2.73	35,246.28
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,730	59.66	103,211.80
UNILEVER PLC	6,190	39.26	243,050.35
SMITH & NEPHEW PLC	1,973	10.01	19,759.59
ASTRAZENECA PLC	3,800	97.53	370,614.00
GSK PLC	10,324	13.83	142,842.86
BARCLAYS PLC	42,590	1.50	63,978.69
HSBC HOLDINGS PLC	48,450	4.42	214,463.92
LLOYDS BANKING GROUP PLC	181,487	0.42	77,994.03
NATWEST GROUP PLC	12,964	2.44	31,684.01
STANDARD CHARTERED PLC	5,954	5.54	33,008.97
3I GROUP PLC	2,819	11.46	32,305.74
ABRDN PLC	6,446	1.55	10,026.75
HARGREAVES LANSDOWN PLC	913	7.77	7,094.01
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	827	74.40	61,528.80
M&G PLC	9,216	1.81	16,694.78
ST JAMES'S PLACE PLC	1,607	10.58	17,002.06
ADMIRAL GROUP PLC	280	20.09	5,625.20
AVIVA PLC	7,600	4.16	31,646.40
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	15,774	2.35	37,068.90
PRUDENTIAL PLC	6,750	8.17	55,161.00
SAGE GROUP PLC/THE	3,107	7.46	23,184.43
HALMA PLC	1,095	21.70	23,761.50
BT GROUP PLC	16,090	1.25	20,225.13
VODAFONE GROUP PLC	62,720	0.98	61,885.82
NATIONAL GRID PLC	8,600	9.40	80,840.00

	SEVERN TRENT PLC	682	24.63	16,797.66	
	SSE PLC	2,750	15.23	41,882.50	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,628	9.29	15,133.88	
英債券小計		712,357		4,195,892.17 (711,287,640)	
スイスフラン	GIVAUDAN-REG	23	3,078.00	70,794.00	
	HOLCIM LTD	1,360	42.74	58,126.40	
	SIKA AG-REG	389	228.50	88,886.50	
	ABB LTD-REG	3,630	27.81	100,950.30	
	GEBERIT AG-REG	96	452.50	43,440.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	145	162.20	23,519.00	
	VAT GROUP AG	70	236.00	16,520.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	419	30.22	12,662.18	
	SGS SA-REG	17	2,219.00	37,723.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	164	223.50	36,654.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	1,290	103.10	132,999.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	95	230.80	21,926.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	10	1,877.00	18,770.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	4	9,850.00	39,400.00	
	NESTLE SA-REG	6,910	108.16	747,385.60	
	ALCON INC	1,263	59.68	75,375.84	
	SONOVA HOLDING AG-REG	153	239.90	36,704.70	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	290	100.80	29,232.00	
	LONZA GROUP AG-REG	190	518.40	98,496.00	
	NOVARTIS AG-REG	5,280	77.84	410,995.20	
	ROCHE HOLDING AG-BR	90	405.00	36,450.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,710	331.50	566,865.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	7,329	4.78	35,091.25	
	JULIUS BAER GROUP LTD	579	46.85	27,126.15	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	63	897.00	56,511.00	
	UBS GROUP AG-REG	8,920	16.30	145,440.60	
	BALOISE HOLDING AG - REG	160	134.70	21,552.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	87	480.80	41,829.60	
	SWISS RE AG	770	76.38	58,812.60	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	380	420.40	159,752.00	

	SWISS PRIME SITE-REG	220	81.60	17,952.00	
	TEMENOS AG	155	58.50	9,067.50	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	484	51.18	24,771.12	
	SWISSCOM AG-REG	80	456.30	36,504.00	
スイスフラン小計		42,825		3,338,284.54	(496,770,122)
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	620	328.55	203,701.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	1,812	144.20	261,290.40	
	ALFA LAVAL AB	950	259.30	246,335.00	
	ASSA ABLOY AB-B	2,713	220.40	597,945.20	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	7,648	118.28	904,605.44	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	3,220	106.74	343,702.80	
	EPIROC AB-A	1,540	174.80	269,192.00	
	EPIROC AB-B	1,322	152.45	201,538.90	
	HUSQVARNA AB-B SHS	1,126	63.88	71,928.88	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	349	192.10	67,042.90	
	LIFCO AB-B SHS	830	164.75	136,742.50	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	3,908	88.64	346,405.12	
	SANDVIK AB	3,052	173.15	528,453.80	
	SKANSKA AB-B SHS	1,056	154.60	163,257.60	
	SKF AB-B SHARES-B	1,125	157.85	177,581.25	
	VOLVO AB-B SHS-B	4,355	176.04	766,654.20	
	ELECTROLUX AB-B	430	127.18	54,687.40	
	EVOLUTION AB	458	1,016.40	465,511.20	
	EMBRACER GROUP AB	1,820	54.40	99,008.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	2,248	116.68	262,296.64	
	SWEDISH MATCH AB	3,790	113.25	429,217.50	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,708	227.00	387,716.00	
	GETINGE AB-B SHS	650	219.10	142,415.00	
	NORDEA BANK ABP	8,543	107.40	917,518.20	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	4,444	119.75	532,169.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	4,361	103.55	451,581.55	
SWEDBANK AB - A SHARES	2,076	161.20	334,651.20		
EQT AB	718	224.00	160,832.00		
INVESTOR AB-B SHS	5,200	181.24	942,448.00		

	KINNEVIK AB - B	550	143.70	79,035.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	2,238	39.46	88,311.48	
	ERICSSON LM-B SHS	7,741	60.59	469,027.19	
	HEXAGON AB-B SHS	5,313	112.55	597,978.15	
	TELE2 AB-B SHS	1,460	88.56	129,297.60	
	TELIA CO AB	8,145	29.04	236,530.80	
スウェーデンクローナ小計		97,519		12,066,608.90	(162,778,554)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	750	319.20	239,400.00	
	EQUINOR ASA	2,610	358.65	936,076.50	
	NORSK HYDRO A S	4,055	64.64	262,115.20	
	YARA INTERNATIONAL ASA	429	457.40	196,224.60	
	ADEVINTA ASA	778	69.35	53,954.30	
	MOWI ASA	1,466	140.90	206,559.40	
	DNB BANK ASA	2,870	180.05	516,743.50	
	TELENOR ASA	2,000	90.38	180,760.00	
ノルウェークローネ小計		14,958		2,591,833.50	(36,804,035)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	320	431.40	138,048.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	602	393.40	236,826.80	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,706	143.00	386,958.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	18	15,975.00	287,550.00	
	DSV A/S	490	1,014.50	497,105.00	
	PANDORA A/S	311	404.20	125,706.20	
	CARLSBERG AS-B	293	895.00	262,235.00	
	COLOPLAST-B	302	844.00	254,888.00	
	DEMANT A/S	302	210.00	63,420.00	
	GN STORE NORD A/S	290	158.65	46,008.50	
	GENMAB A/S	160	2,817.00	450,720.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	4,060	807.10	3,276,826.00	
	DANSKE BANK A/S	2,079	101.60	211,226.40	
ORSTED A/S	528	626.70	330,897.60		
デンマーククローネ小計		12,461		6,568,415.50	(130,120,311)
豪ドル	AMPOL LTD	730	27.35	19,965.50	

SANTOS LTD	7,613	7.66	58,315.58
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	4,650	35.28	164,052.00
BHP GROUP LTD	12,350	38.50	475,475.00
BLUESCOPE STEEL LTD	1,660	15.70	26,062.00
EVOLUTION MINING LTD	4,205	1.93	8,136.67
FORTESCUE METALS GROUP LTD	4,520	16.26	73,495.20
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	1,306	33.19	43,346.14
NEWCREST MINING LTD	2,263	17.10	38,697.30
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	3,384	8.27	27,985.68
RIO TINTO LTD	956	91.32	87,301.92
SOUTH32 LTD	12,462	3.60	44,863.20
REECE LTD	895	14.63	13,093.85
BRAMBLES LTD	3,858	11.17	43,093.86
AURIZON HOLDINGS LTD	5,319	3.54	18,829.26
TRANSURBAN GROUP	7,835	12.61	98,799.35
ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,665	36.17	60,223.05
IDP EDUCATION LTD	750	28.81	21,607.50
LOTTERY CORP LTD/THE	7,922	4.21	33,351.62
SEEK LTD	1,090	21.10	22,999.00
WESFARMERS LTD	2,988	44.59	133,234.92
COLES GROUP LTD	3,500	16.60	58,100.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	3,015	33.38	100,640.70
TREASURY WINE ESTATES LTD	2,315	12.73	29,469.95
COCHLEAR LTD	160	196.08	31,372.80
RAMSAY HEALTH CARE LTD	450	57.21	25,744.50
SONIC HEALTHCARE LTD	1,188	31.59	37,528.92
CSL LTD	1,200	276.00	331,200.00
AUST AND NZ BANKING GROUP	6,740	25.70	173,218.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	4,160	101.78	423,404.80
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	7,710	31.95	246,334.50
WESTPAC BANKING CORP	8,640	23.90	206,496.00
ASX LTD	514	66.28	34,067.92
MACQUARIE GROUP LTD	911	165.00	150,315.00
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	8,157	4.85	39,561.45
QBE INSURANCE GROUP LTD	3,874	12.01	46,526.74

	SUNCORP GROUP LTD	4,089	11.04	45,142.56	
	COMPUTERSHARE LTD	1,410	24.68	34,798.80	
	WISETECH GLOBAL LTD	485	56.82	27,557.70	
	XERO LTD	286	76.40	21,850.40	
	TELSTRA GROUP LTD	10,933	3.87	42,310.71	
	APA GROUP	3,040	9.88	30,035.20	
	ORIGIN ENERGY LTD	6,145	5.37	32,998.65	
豪ドル小計		167,343		3,681,603.90	(347,948,384)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	3,190	7.37	23,510.30	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	1,488	19.12	28,450.56	
	MERCURY NZ LTD	2,262	5.33	12,056.46	
	MERIDIAN ENERGY LTD	3,409	4.56	15,545.04	
ニュージーランドドル小計		10,349		79,562.36	(6,756,435)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	7,598	40.30	306,199.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	4,000	76.50	306,000.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	6,000	11.02	66,120.00	
	MTR CORP	5,500	33.85	186,175.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	3,000	14.44	43,320.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	6,161	36.80	226,724.80	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	5,100	16.46	83,946.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	10,731	24.75	265,592.25	
	HANG SENG BANK LTD	2,150	111.90	240,585.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	3,071	224.00	687,904.00	
	AIA GROUP LTD	30,263	58.10	1,758,280.30	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	5,073	44.20	224,226.60	
	ESR GROUP LTD	5,400	15.24	82,296.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	4,750	17.58	83,505.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	4,433	85.95	381,016.35	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	1,000	54.60	54,600.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	5,000	32.75	163,750.00	
	CLP HOLDINGS LTD	4,694	51.85	243,383.90	
	HONG KONG & CHINA GAS	32,768	6.10	199,884.80	
	POWER ASSETS HOLDINGS	4,000	35.70	142,800.00	

香港ドル小計		150,692		5,746,309.40 (108,490,321)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	5,283	6.59	34,814.97	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	4,100	5.03	20,623.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	6,300	3.48	21,924.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	4,402	32.76	144,209.52	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	9,408	11.70	110,073.60	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	3,242	26.13	84,713.46	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	2,976	8.35	24,849.60	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	8,911	3.07	27,356.77	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	22,600	2.43	54,918.00	
シンガポールドル小計		67,222		523,482.92 (54,703,965)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	2,760	31.15	85,974.00	
	BANK HAPOLIM BM	4,308	33.96	146,299.68	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	5,363	33.79	181,215.77	
	NICE LTD	172	693.80	119,333.60	
イスラエルシュケル小計		12,603		532,823.05 (22,428,227)	
合 計		2,684,867		16,378,481,161 (16,378,481,161)	

(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	409	57,345.89	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	800	26,232.00	
		AMERICAN TOWER CORP	1,110	217,038.30	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	1,163	20,561.84	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	320	57,216.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	326	24,557.58	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	291	33,980.07	
		CROWN CASTLE INC	1,040	131,487.20	



		DIGITAL REALTY TRUST INC	730	74,131.50	
		EQUINIX INC	220	122,075.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	497	30,088.38	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	830	54,954.30	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	175	41,378.75	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	323	55,998.51	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	640	30,496.00	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	860	16,864.60	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	990	22,809.60	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	1,967	35,406.00	
		INVITATION HOMES INC	1,640	55,694.40	
		IRON MOUNTAIN INC	818	40,499.18	
		KIMCO REALTY CORP	1,600	32,800.00	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	1,990	21,551.70	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	300	46,185.00	
		PROLOGIS INC	2,241	242,767.53	
		PUBLIC STORAGE	390	117,042.90	
		REALTY INCOME CORP	1,493	90,311.57	
		REGENCY CENTERS CORP	482	28,023.48	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	260	66,716.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	844	89,328.96	
		SUN COMMUNITIES INC	317	41,041.99	
		UDR INC	827	33,551.39	
		VENTAS INC	1,005	39,315.60	
		VICI PROPERTIES INC	2,527	77,679.98	
		VORNADO REALTY TRUST	436	10,355.00	
		WELLTOWER INC	1,070	64,585.20	
		WEYERHAEUSER CO	1,810	55,947.10	
		WP CAREY INC	594	43,659.00	
		米ドル小計	33,335	2,249,678.30	(333,469,814)
ユーロ	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	351	16,516.30	
		ユーロ小計	351	16,516.30	(2,433,841)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	3,140	11,401.34	

		LAND SECURITIES GROUP PLC	1,694	9,635.47	
		SEGRO PLC	3,361	26,820.78	
英ポンド小計			8,195	47,857.59	(8,112,818)
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	2,875	22,051.25	
		GOODMAN GROUP	4,311	71,390.16	
		GPT GROUP	5,900	23,777.00	
		LENDLEASE GROUP	1,550	12,694.50	
		MIRVAC GROUP	11,628	22,790.88	
		SCENTRE GROUP	15,350	41,138.00	
		STOCKLAND	5,114	17,285.32	
		VICINITY CENTRES	10,480	19,021.20	
豪ドル小計			57,208	230,148.31	(21,751,316)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	5,567	262,484.05	
香港ドル小計			5,567	262,484.05	(4,955,698)
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	10,162	25,506.62	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	17,278	31,445.96	
シンガポールドル小計			27,440	56,952.58	(5,951,544)
合計				376,675,031	(376,675,031)

(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 584銘柄	97.3%		73.1%
	投資証券 37銘柄		2.7%	2.0%
加ドル	株式 73銘柄	100.0%		3.7%
ユーロ	株式 190銘柄	99.8%		8.8%

	投資証券	1銘柄		0.2%	0.0%
英ポンド	株式	74銘柄	98.9%		4.2%
	投資証券	3銘柄		1.1%	0.0%
スイスフラン	株式	34銘柄	100.0%		3.0%
スウェーデンクローナ	株式	35銘柄	100.0%		1.0%
ノルウェークローネ	株式	8銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式	14銘柄	100.0%		0.8%
豪ドル	株式	43銘柄	94.1%		2.1%
	投資証券	8銘柄		5.9%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	4銘柄	100.0%		0.0%
香港ドル	株式	20銘柄	95.6%		0.6%
	投資証券	1銘柄		4.4%	0.0%
シンガポールドル	株式	9銘柄	90.2%		0.3%
	投資証券	2銘柄		9.8%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	4銘柄	100.0%		0.1%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

## 日本債券インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	2021年10月26日現在	2022年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	71,007,193	38,142,474
国債証券	36,703,224,643	39,782,689,370
地方債証券	4,809,141,758	3,556,850,650
特殊債証券	5,296,862,350	3,528,619,000
社債証券	1,617,886,592	603,631,000
未収入金	57,033,800	-
未収利息	84,374,456	81,611,164
前払費用	2,584,908	737,116
流動資産合計	48,642,115,700	47,592,280,774

	2021年10月26日現在	2022年10月26日現在
資産合計	48,642,115,700	47,592,280,774
負債の部		
流動負債		
未払解約金	24,088,484	14,845,556
未払利息	28	62
流動負債合計	24,088,512	14,845,618
負債合計	24,088,512	14,845,618
純資産の部		
元本等		
元本	34,479,945,047	35,139,813,158
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	14,138,082,141	12,437,621,998
元本等合計	48,618,027,188	47,577,435,156
純資産合計	48,618,027,188	47,577,435,156
負債純資産合計	48,642,115,700	47,592,280,774

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	2021年10月26日現在	2022年10月26日現在
1. 期首	2020年10月27日	2021年10月27日
期首元本額	31,007,104,895円	34,479,945,047円
期首からの追加設定元本額	5,127,924,648円	4,247,701,412円
期首からの一部解約元本額	1,655,084,496円	3,587,833,301円
元本の内訳		
DCインデックスバランス（株式20）	4,165,088,588円	4,815,944,655円
DCインデックスバランス（株式40）	3,824,408,447円	4,446,314,480円
DCインデックスバランス（株式60）	2,792,330,713円	3,280,760,207円
DCインデックスバランス（株式80）	453,495,710円	537,618,854円

インデックスファンド日本債券（DC専用）	2,228,428,435円	2,209,280,459円
世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	4,120,607,198円	4,488,925,161円
インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,703,336,062円	1,615,057,133円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	5,011,963円	-円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	30,178,231円	-円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	99,004,620円	-円
アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	244,385,579円	-円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	4,024,703,763円	3,381,046,243円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,457,917,809円	1,480,910,178円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,449,114,415円	1,423,718,543円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	816,461,795円	807,219,661円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	116,490,805円	119,043,599円
インデックスファンド日本債券（1年決算型）	6,607,446,677円	6,161,581,877円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	341,534,237円	372,392,108円
計	34,479,945,047円	35,139,813,158円
2. 受益権の総数	34,479,945,047口	35,139,813,158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10月27日 至 2021年10月26日	自 2021年10月27日 至 2022年10月26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10月26日現在	2022年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

(2021年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	421,073,277
地方債証券	20,961,242
特殊債証券	31,174,650
社債証券	7,985,408
合計	481,194,577

(2022年10月26日現在)

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	2,272,854,520
地方債証券	23,007,350
特殊債券	25,283,000
社債券	3,852,000
合計	2,324,996,870

(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10月26日現在		2022年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.4100円	1口当たり純資産額	1.3539円
(1万口当たり純資産額)	(14,100円)	(1万口当たり純資産額)	(13,539円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第153回利付国債（5年）	300,000,000	299,025,000	
	第1回利付国債（40年）	70,000,000	84,619,500	
	第2回利付国債（40年）	125,000,000	145,111,250	
	第3回利付国債（40年）	85,000,000	98,855,850	
	第4回利付国債（40年）	95,000,000	110,441,300	
	第5回利付国債（40年）	75,000,000	83,847,000	
	第6回利付国債（40年）	110,000,000	119,810,900	
	第7回利付国債（40年）	80,000,000	83,236,800	

第8回利付国債(40年)	95,000,000	91,531,550	
第9回利付国債(40年)	130,000,000	91,278,200	
第10回利付国債(40年)	125,000,000	103,520,000	
第11回利付国債(40年)	140,000,000	111,539,400	
第12回利付国債(40年)	175,000,000	124,153,750	
第13回利付国債(40年)	180,000,000	126,707,400	
第14回利付国債(40年)	150,000,000	112,666,500	
第15回利付国債(40年)	140,000,000	115,112,200	
第333回利付国債(10年)	210,000,000	211,934,100	
第334回利付国債(10年)	120,000,000	121,274,400	
第335回利付国債(10年)	490,000,000	494,929,400	
第336回利付国債(10年)	180,000,000	182,030,400	
第337回利付国債(10年)	230,000,000	231,605,400	
第338回利付国債(10年)	390,000,000	393,970,200	
第339回利付国債(10年)	570,000,000	576,338,400	
第340回利付国債(10年)	620,000,000	627,551,600	
第341回利付国債(10年)	700,000,000	706,944,000	
第342回利付国債(10年)	530,000,000	531,976,900	
第343回利付国債(10年)	545,000,000	546,885,700	
第344回利付国債(10年)	500,000,000	501,460,000	
第345回利付国債(10年)	610,000,000	611,384,700	
第346回利付国債(10年)	690,000,000	691,207,500	
第347回利付国債(10年)	580,000,000	580,800,400	
第348回利付国債(10年)	500,000,000	500,240,000	
第349回利付国債(10年)	640,000,000	639,667,200	
第350回利付国債(10年)	640,000,000	638,969,600	
第351回利付国債(10年)	535,000,000	533,646,450	
第352回利付国債(10年)	590,000,000	587,929,100	
第353回利付国債(10年)	400,000,000	398,172,000	
第354回利付国債(10年)	325,000,000	323,251,500	
第355回利付国債(10年)	350,000,000	347,816,000	
第356回利付国債(10年)	350,000,000	347,378,500	
第357回利付国債(10年)	560,000,000	555,072,000	
第358回利付国債(10年)	600,000,000	593,460,000	
第359回利付国債(10年)	420,000,000	414,493,800	
第360回利付国債(10年)	580,000,000	571,485,600	
第361回利付国債(10年)	270,000,000	265,809,600	
第362回利付国債(10年)	400,000,000	393,448,000	
第363回利付国債(10年)	300,000,000	294,816,000	
第364回利付国債(10年)	300,000,000	294,543,000	
第365回利付国債(10年)	300,000,000	295,050,000	
第366回利付国債(10年)	400,000,000	400,000,000	



第367回利付国債(10年)	350,000,000	348,512,500	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	58,866,000	
第3回利付国債(30年)	70,000,000	80,649,100	
第5回利付国債(30年)	80,000,000	92,842,400	
第6回利付国債(30年)	50,000,000	59,345,500	
第8回利付国債(30年)	80,000,000	91,107,200	
第14回利付国債(30年)	108,000,000	130,120,560	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	178,962,210	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	42,645,750	
第17回利付国債(30年)	50,000,000	60,429,500	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	131,649,100	
第19回利付国債(30年)	40,000,000	47,936,800	
第20回利付国債(30年)	40,000,000	48,952,000	
第21回利付国債(30年)	70,000,000	84,040,600	
第22回利付国債(30年)	70,000,000	85,850,800	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	67,499,850	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	83,503,320	
第25回利付国債(30年)	60,000,000	72,126,000	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	206,575,500	
第27回利付国債(30年)	89,000,000	109,358,750	
第28回利付国債(30年)	144,000,000	176,945,760	
第29回利付国債(30年)	176,000,000	213,609,440	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	176,023,680	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	141,634,800	
第32回利付国債(30年)	160,000,000	191,243,200	
第33回利付国債(30年)	135,000,000	154,672,200	
第34回利付国債(30年)	180,000,000	212,076,000	
第35回利付国債(30年)	128,000,000	146,712,320	
第36回利付国債(30年)	135,000,000	154,668,150	
第37回利付国債(30年)	161,000,000	181,434,120	
第38回利付国債(30年)	135,000,000	149,494,950	
第39回利付国債(30年)	115,000,000	129,281,850	
第40回利付国債(30年)	130,000,000	143,631,800	
第41回利付国債(30年)	160,000,000	173,640,000	
第42回利付国債(30年)	135,000,000	146,365,650	
第43回利付国債(30年)	155,000,000	167,883,600	
第44回利付国債(30年)	150,000,000	162,301,500	
第45回利付国債(30年)	120,000,000	124,986,000	
第46回利付国債(30年)	120,000,000	124,812,000	
第47回利付国債(30年)	125,000,000	132,255,000	
第48回利付国債(30年)	85,000,000	86,422,900	
第49回利付国債(30年)	140,000,000	142,111,200	

第50回利付国債(30年)	95,000,000	84,805,550	
第51回利付国債(30年)	90,000,000	70,962,300	
第52回利付国債(30年)	130,000,000	107,318,900	
第53回利付国債(30年)	105,000,000	88,482,450	
第54回利付国債(30年)	110,000,000	96,852,800	
第55回利付国債(30年)	110,000,000	96,578,900	
第56回利付国債(30年)	90,000,000	78,721,200	
第57回利付国債(30年)	100,000,000	87,138,000	
第58回利付国債(30年)	100,000,000	86,808,000	
第59回利付国債(30年)	170,000,000	143,481,700	
第60回利付国債(30年)	120,000,000	105,976,800	
第61回利付国債(30年)	100,000,000	83,639,000	
第62回利付国債(30年)	120,000,000	94,712,400	
第63回利付国債(30年)	90,000,000	68,795,100	
第64回利付国債(30年)	100,000,000	76,215,000	
第65回利付国債(30年)	110,000,000	83,826,600	
第66回利付国債(30年)	180,000,000	136,902,600	
第67回利付国債(30年)	110,000,000	87,820,700	
第68回利付国債(30年)	140,000,000	111,595,400	
第69回利付国債(30年)	110,000,000	89,999,800	
第70回利付国債(30年)	110,000,000	89,794,100	
第71回利付国債(30年)	120,000,000	97,729,200	
第72回利付国債(30年)	160,000,000	130,128,000	
第73回利付国債(30年)	120,000,000	97,562,400	
第74回利付国債(30年)	130,000,000	114,519,600	
第75回利付国債(30年)	90,000,000	85,428,900	
第65回利付国債(20年)	100,000,000	102,286,000	
第66回利付国債(20年)	34,000,000	34,738,140	
第67回利付国債(20年)	34,000,000	34,929,900	
第68回利付国債(20年)	78,000,000	80,460,120	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	108,189,120	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	116,531,520	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	117,916,630	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	123,387,880	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	10,509,100	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	21,968,520	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	41,940,400	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	168,579,200	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	63,688,800	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	139,755,200	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	325,101,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	17,355,360	

第9 1 回利付国債(20年)	250,000,000	272,150,000	
第9 2 回利付国債(20年)	60,000,000	65,104,800	
第9 3 回利付国債(20年)	60,000,000	65,101,200	
第9 4 回利付国債(20年)	50,000,000	54,470,500	
第9 5 回利付国債(20年)	82,000,000	90,468,960	
第9 6 回利付国債(20年)	248,000,000	271,314,480	
第9 7 回利付国債(20年)	45,000,000	49,642,650	
第9 8 回利付国債(20年)	94,000,000	103,239,260	
第9 9 回利付国債(20年)	117,000,000	128,950,380	
第1 0 0 回利付国債(20年)	30,000,000	33,335,400	
第1 0 1 回利付国債(20年)	66,000,000	74,045,400	
第1 0 2 回利付国債(20年)	81,000,000	91,255,410	
第1 0 3 回利付国債(20年)	11,000,000	12,331,000	
第1 0 4 回利付国債(20年)	33,000,000	36,623,400	
第1 0 5 回利付国債(20年)	77,000,000	85,778,770	
第1 0 6 回利付国債(20年)	2,000,000	2,239,720	
第1 0 7 回利付国債(20年)	130,000,000	145,308,800	
第1 0 8 回利付国債(20年)	134,000,000	148,149,060	
第1 0 9 回利付国債(20年)	27,000,000	29,945,160	
第1 1 0 回利付国債(20年)	98,000,000	109,929,540	
第1 1 1 回利付国債(20年)	25,000,000	28,307,500	
第1 1 2 回利付国債(20年)	80,000,000	90,058,400	
第1 1 3 回利付国債(20年)	290,000,000	327,494,100	
第1 1 4 回利付国債(20年)	52,000,000	58,920,680	
第1 1 5 回利付国債(20年)	125,000,000	142,517,500	
第1 1 6 回利付国債(20年)	135,000,000	154,280,700	
第1 1 7 回利付国債(20年)	343,000,000	389,493,650	
第1 1 8 回利付国債(20年)	10,000,000	11,304,500	
第1 1 9 回利付国債(20年)	30,000,000	33,463,800	
第1 2 0 回利付国債(20年)	170,000,000	187,078,200	
第1 2 1 回利付国債(20年)	22,000,000	24,763,640	
第1 2 2 回利付国債(20年)	17,000,000	19,004,130	
第1 2 3 回利付国債(20年)	195,000,000	223,360,800	
第1 2 4 回利付国債(20年)	90,000,000	102,372,300	
第1 2 5 回利付国債(20年)	50,000,000	57,873,500	
第1 2 6 回利付国債(20年)	105,000,000	119,811,300	
第1 2 7 回利付国債(20年)	50,000,000	56,643,000	
第1 2 8 回利付国債(20年)	65,000,000	73,858,200	
第1 2 9 回利付国債(20年)	85,000,000	95,866,400	
第1 3 0 回利付国債(20年)	150,000,000	169,647,000	
第1 3 1 回利付国債(20年)	92,000,000	103,252,520	
第1 3 2 回利付国債(20年)	135,000,000	151,895,250	

第133回利付国債(20年)	30,000,000	34,021,500	
第134回利付国債(20年)	120,000,000	136,321,200	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	33,806,400	
第136回利付国債(20年)	220,000,000	245,905,000	
第137回利付国債(20年)	200,000,000	225,720,000	
第138回利付国債(20年)	120,000,000	133,188,000	
第139回利付国債(20年)	230,000,000	257,427,500	
第140回利付国債(20年)	358,000,000	404,235,700	
第141回利付国債(20年)	195,000,000	220,149,150	
第142回利付国債(20年)	125,000,000	142,343,750	
第143回利付国債(20年)	94,000,000	105,151,220	
第144回利付国債(20年)	370,000,000	410,204,200	
第145回利付国債(20年)	315,000,000	355,543,650	
第146回利付国債(20年)	135,000,000	152,373,150	
第147回利付国債(20年)	98,000,000	109,498,340	
第148回利付国債(20年)	90,000,000	99,487,800	
第149回利付国債(20年)	115,000,000	127,026,700	
第150回利付国債(20年)	140,000,000	152,947,200	
第151回利付国債(20年)	140,000,000	149,510,200	
第152回利付国債(20年)	300,000,000	319,842,000	
第153回利付国債(20年)	270,000,000	290,846,700	
第154回利付国債(20年)	160,000,000	170,168,000	
第155回利付国債(20年)	270,000,000	280,087,200	
第156回利付国債(20年)	160,000,000	153,369,600	
第157回利付国債(20年)	150,000,000	139,354,500	
第158回利付国債(20年)	170,000,000	164,031,300	
第159回利付国債(20年)	150,000,000	146,187,000	
第160回利付国債(20年)	140,000,000	137,837,000	
第161回利付国債(20年)	120,000,000	116,091,600	
第162回利付国債(20年)	150,000,000	144,562,500	
第163回利付国債(20年)	165,000,000	158,400,000	
第164回利付国債(20年)	255,000,000	240,232,950	
第165回利付国債(20年)	170,000,000	159,470,200	
第166回利付国債(20年)	150,000,000	144,520,500	
第167回利付国債(20年)	160,000,000	148,772,800	
第168回利付国債(20年)	100,000,000	91,035,000	
第169回利付国債(20年)	160,000,000	142,491,200	
第170回利付国債(20年)	140,000,000	124,040,000	
第171回利付国債(20年)	170,000,000	149,946,800	
第172回利付国債(20年)	230,000,000	205,590,100	
第173回利付国債(20年)	150,000,000	133,495,500	
第174回利付国債(20年)	200,000,000	177,340,000	

	第175回利付国債(20年)	140,000,000	125,958,000	
	第176回利付国債(20年)	160,000,000	143,446,400	
	第177回利付国債(20年)	150,000,000	131,614,500	
	第178回利付国債(20年)	120,000,000	106,976,400	
	第179回利付国債(20年)	190,000,000	168,896,700	
	第180回利付国債(20年)	190,000,000	178,182,000	
	第181回利付国債(20年)	190,000,000	181,081,400	
国債証券 合計		39,154,000,000	39,782,689,370	
地方債証券	第4回東京都公募公債(東京グリーンbond(5年))	100,000,000	99,786,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,588,000	
	第32回東京都公募公債(5年)	300,000,000	299,451,000	
	第726回東京都公募公債	100,000,000	100,805,000	
	第730回東京都公募公債	100,000,000	100,856,000	
	第739回東京都公募公債	100,000,000	100,429,000	
	第744回東京都公募公債	100,000,000	101,303,000	
	令和2年度第2回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,808,000	
	令和3年度第6回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,514,000	
	第214回神奈川県公募公債	100,000,000	101,266,000	
	平成25年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	100,869,000	
	平成27年度第10回静岡県公募公債	200,000,000	202,120,000	
	平成26年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	100,943,000	
	平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	104,823,000	
	平成26年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	100,812,000	
	第10回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	100,696,000	
	平成26年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	100,901,000	
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,943,000	
	第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,872,000	
	第142回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,152,000	
	第144回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,938,000	
	第147回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,232,000	
	第165回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,916,000	
	平成28年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	99,863,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	101,190,000	
	平成29年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	99,849,000	
	平成27年度第2回熊本県公募公債(10年)	100,000,000	101,160,000	
	第2回名古屋市定時償還公募公債(10年)	30,000,000	30,073,650	
	平成27年度第5回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	101,086,000	
	令和元年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	99,830,000	
	令和2年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	99,776,000	
地方債証券 合計		3,530,000,000	3,556,850,650	
特殊債券	第5回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	100,002,000	

	第13回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	201,310,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,804,000	
	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	199,264,000	
	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,432,000	
	第28回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,308,000	
	第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,517,000	
	第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,837,000	
	第125回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,604,000	
	第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,698,000	
	第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,728,000	
	第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,752,000	
	第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,000,000	
	第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,967,000	
	第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,805,000	
	第324回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,170,000	
	第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,547,000	
	第69回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,672,000	
	第77回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,968,000	
	第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,622,000	
	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,906,000	
	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,948,000	
	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,459,000	
	第39回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	100,936,000	
	第357回信金中金債(5年)	100,000,000	99,778,000	
	第363回信金中金債(5年)	100,000,000	99,670,000	
	第29回国際協力機構債券	100,000,000	101,225,000	
	第37回国際協力機構債券	100,000,000	99,690,000	
	特殊債券 合計	3,500,000,000	3,528,619,000	
社債券	第15回成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,823,000	
	第25回西日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人日本高速道路保有・債務返済機構重畳の債務引受条項付)	100,000,000	100,780,000	
	第11回株式会社セブン銀行無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,639,000	
	第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,727,000	
	第20回KDDI株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,748,000	
	第26回KDDI株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,914,000	

社債券 合計	600,000,000	603,631,000	
合計	46,784,000,000	47,471,790,020	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	2021年10月26日現在	2022年10月26日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	163,236,561	117,967,036
コール・ローン	21,345,245	69,590,695
国債証券	158,054,958,026	150,981,343,458
派生商品評価勘定	201,424	7,491
未収入金	94,274,239	74,008,274
未収利息	986,017,043	1,091,775,551
前払費用	25,797,561	46,505,846
流動資産合計	159,345,830,099	152,381,198,351
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	76,670	72,386
未払解約金	129,447,656	106,989,541
未払利息	8	113
流動負債合計	129,524,334	107,062,040
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	61,672,878,643	57,575,300,165
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	97,543,427,122	94,698,836,146
元本等合計	159,216,305,765	152,274,136,311
<b>負債純資産合計</b>		
負債純資産合計	159,345,830,099	152,381,198,351

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

		2021年10月26日現在	2022年10月26日現在
1.	期首	2020年10月27日	2021年10月27日
	期首元本額	62,305,294,771円	61,672,878,643円
	期首からの追加設定元本額	5,092,447,058円	3,281,227,327円
	期首からの一部解約元本額	5,724,863,186円	7,378,805,805円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	14,821,148,270円	16,794,261,878円
	DCインデックスバランス(株式20)	353,037,161円	389,007,488円
	DCインデックスバランス(株式40)	470,603,500円	515,032,949円
	DCインデックスバランス(株式60)	619,099,493円	682,975,875円
	DCインデックスバランス(株式80)	500,890,063円	560,018,801円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	20,225,218,218円	16,979,582,310円
	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	2,289,399,731円	2,355,333,711円
	日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	14,500,797,808円	13,154,930,712円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	900,317,948円	835,698,012円
	インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	157,019,480円	144,328,916円
	財産3分法(適格機関投資家専用)	24,920,544円	203,841,699円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	2,796,108円	-円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,295,953円	-円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	6,106,515円	-円
	アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	10,297,506円	-円
	世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	1,750,402,022円	173,659,188円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	741,844,896円	588,340,485円



年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	61,212,474円	58,797,064円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	88,314,261円	82,606,618円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	90,547,305円	84,495,854円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	64,570,825円	62,113,777円
インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）1年決算型	3,711,173,590円	3,607,947,517円
海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	279,864,972円	302,327,311円
計	61,672,878,643円	57,575,300,165円
2. 受益権の総数	61,672,878,643口	57,575,300,165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10月27日 至 2021年10月26日	自 2021年10月27日 至 2022年10月26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10月26日現在	2022年10月26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10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	7,532,287,116
合計	7,532,287,116

（2022年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	29,029,728,271
合計	29,029,728,271

(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10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	162,163,552	-	162,038,798	124,754
	米ドル	62,529,500	-	62,606,170	76,670
	ユーロ	90,359,624	-	90,192,107	167,517
	英ポンド	9,274,428	-	9,240,521	33,907
合計		162,163,552	-	162,038,798	124,754

（2022年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	54,085,544	-	54,150,439	64,895
	ユーロ	31,099,290	-	31,091,799	7,491
	英ポンド	10,623,129	-	10,678,865	55,736
	豪ドル	12,363,125	-	12,379,775	16,650
合計		54,085,544	-	54,150,439	64,895

## （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10月26日現在		2022年10月26日現在	
1口当たり純資産額	2.5816円	1口当たり純資産額	2.6448円
(1万口当たり純資産額)	(25,816円)	(1万口当たり純資産額)	(26,448円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-1.375%-23/09/30	2,500,000.00	2,429,005.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/09/30	660,000.00	650,825.49	
		US TREASURY N/B-0.25%-23/09/30	3,500,000.00	3,363,160.36	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/10/15	1,400,000.00	1,341,657.33	
		US TREASURY N/B-1.625%-23/10/31	1,700,000.00	1,651,671.36	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/10/31	900,000.00	885,418.56	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	4,000,000.00	3,926,607.16	
		US TREASURY N/B-0.25%-23/11/15	7,000,000.00	6,692,180.60	
		US TREASURY N/B-2.125%-23/11/30	2,680,000.00	2,611,010.93	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/11/30	1,810,000.00	1,778,572.46	
		US TREASURY N/B-0.5%-23/11/30	4,000,000.00	3,828,281.24	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/12/15	3,000,000.00	2,854,921.86	
		US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,000,000.00	1,947,578.12	
		US TREASURY N/B-2.625%-23/12/31	2,470,000.00	2,415,438.09	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	1,942,968.76	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/01/31	2,520,000.00	2,455,572.64	
		US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,222,527.35	
		US TREASURY N/B-0.125%-24/02/15	5,000,000.00	4,719,921.90	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,500,000.00	1,452,304.68	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/02/29	1,630,000.00	1,583,646.87	
		US TREASURY N/B-0.25%-24/03/15	5,000,000.00	4,710,546.90	
US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	3,860,000.00	3,729,574.22			

US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	1,923,828.12
US TREASURY N/B-2.25%-24/04/30	3,000,000.00	2,897,226.57
US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	3,380,000.00	3,273,054.70
US TREASURY N/B-0.25%-24/05/15	2,830,000.00	2,646,823.83
US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	3,870,000.00	3,716,711.69
US TREASURY N/B-0.25%-24/06/15	4,700,000.00	4,381,281.25
US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	2,300,000.00	2,204,855.46
US TREASURY N/B-1.75%-24/06/30	2,660,000.00	2,539,780.47
US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	2,490,000.00	2,387,384.75
US TREASURY N/B-1.75%-24/07/31	4,640,000.00	4,420,506.23
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,445,306.25
US TREASURY N/B-0.375%-24/08/15	5,000,000.00	4,640,820.30
US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,353,326.56
US TREASURY N/B-1.25%-24/08/31	2,300,000.00	2,167,121.08
US TREASURY N/B-0.375%-24/09/15	6,000,000.00	5,554,218.72
US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,015,000.00	1,927,709.57
US TREASURY N/B-1.5%-24/09/30	2,200,000.00	2,079,945.31
US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	1,090,000.00	1,043,675.00
US TREASURY N/B-1.5%-24/10/31	2,140,000.00	2,018,036.71
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	4,650,000.00	4,448,197.25
US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,400,000.00	1,334,375.00
US TREASURY N/B-1.5%-24/11/30	3,470,000.00	3,264,375.39
US TREASURY N/B-1.0%-24/12/15	1,800,000.00	1,674,210.94
US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	1,812,867.17
US TREASURY N/B-1.75%-24/12/31	1,300,000.00	1,228,220.70
US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,436,308.59
US TREASURY N/B-1.375%-25/01/31	3,510,000.00	3,279,724.80
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,530,000.00	4,285,273.81
US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	1,981,784.37
US TREASURY N/B-1.125%-25/02/28	1,540,000.00	1,426,425.00
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	2,010,000.00	1,926,694.92
US TREASURY N/B-0.5%-25/03/31	3,470,000.00	3,160,410.93
US TREASURY N/B-2.625%-25/04/15	2,600,000.00	2,488,179.69
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,116,640.63
US TREASURY N/B-0.375%-25/04/30	2,150,000.00	1,943,398.43
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	3,800,000.00	3,585,656.25
US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,420,000.00	1,364,531.24
US TREASURY N/B-0.25%-25/05/31	3,820,000.00	3,428,226.17
US TREASURY N/B-2.875%-25/06/15	5,000,000.00	4,803,906.25
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	1,370,000.00	1,311,935.55
US TREASURY N/B-3.0%-25/07/15	5,000,000.00	4,813,183.60
US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	1,440,000.00	1,381,218.75

US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	3,000,000.00	2,674,687.50
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	4,730,000.00	4,423,843.37
US TREASURY N/B-2.75%-25/08/31	3,000,000.00	2,862,656.25
US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	4,200,000.00	4,033,476.55
US TREASURY N/B-0.25%-25/09/30	320,000.00	283,600.00
US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,342,796.86
US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	1,800,000.00	1,588,500.00
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	3,440,000.00	3,223,925.00
US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,259,671.88
US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	3,420,000.00	3,020,153.91
US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	1,892,812.50
US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	1,748,466.80
US TREASURY N/B-0.375%-26/01/31	3,000,000.00	2,632,031.25
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	1,885,007.70
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,310,000.00	3,025,288.29
US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,682,809.77
US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	3,650,000.00	3,205,869.13
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	1,928,738.66
US TREASURY N/B-0.75%-26/03/31	2,400,000.00	2,121,281.25
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	320,000.00	299,137.50
US TREASURY N/B-0.75%-26/04/30	2,740,000.00	2,415,160.14
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	4,840,000.00	4,400,807.80
US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	2,740,000.00	2,534,285.95
US TREASURY N/B-0.75%-26/05/31	2,800,000.00	2,461,593.73
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	1,830,781.24
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	960,000.00	877,350.00
US TREASURY N/B-0.625%-26/07/31	3,260,000.00	2,837,473.42
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,597,187.52
US TREASURY N/B-0.75%-26/08/31	3,000,000.00	2,617,265.64
US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,461,828.51
US TREASURY N/B-0.875%-26/09/30	3,000,000.00	2,624,472.66
US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	2,450,000.00	2,205,095.69
US TREASURY N/B-1.125%-26/10/31	4,950,000.00	4,364,024.39
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,040,000.00	2,774,415.62
US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,870,000.00	2,580,197.27
US TREASURY N/B-1.25%-26/11/30	2,210,000.00	1,955,332.02
US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	1,804,453.12
US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	4,000,000.00	3,562,812.48
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	2,060,000.00	1,892,222.66
US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,530,000.00	1,338,809.76
US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	3,310,000.00	2,822,421.47
US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	2,450,000.00	2,071,494.13
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,248,151.56

US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	1,600,000.00	1,348,875.00	
US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	3,100,000.00	2,607,027.33	
US TREASURY N/B-3.25%-27/06/30	5,000,000.00	4,782,226.55	
US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	7,000,000.00	5,838,437.50	
US TREASURY N/B-2.75%-27/07/31	930,000.00	868,968.75	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	2,700,132.80	
US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	2,100,000.00	1,756,617.19	
US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	4,090,000.00	3,387,670.31	
US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	3,860,000.00	3,208,021.87	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	1,400,000.00	1,513,804.60	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	2,743,481.25	
US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	220,000.00	183,605.46	
US TREASURY N/B-0.625%-27/12/31	3,960,000.00	3,295,462.50	
US TREASURY N/B-0.75%-28/01/31	2,850,000.00	2,379,527.35	
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	3,710,312.48	
US TREASURY N/B-1.125%-28/02/29	3,830,000.00	3,257,594.55	
US TREASURY N/B-1.25%-28/03/31	960,000.00	820,050.00	
US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	3,370,000.00	2,872,003.50	
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	2,440,000.00	2,270,439.05	
US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	4,300,000.00	3,657,519.54	
US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	3,300,000.00	2,801,132.79	
US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	2,920,000.00	2,435,576.55	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	3,899,765.60	
US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	3,900,000.00	3,269,906.25	
US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	4,000,000.00	3,372,187.52	
US TREASURY N/B-1.375%-28/10/31	4,000,000.00	3,391,250.00	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,124,252.31	
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	4,510,000.00	4,236,405.08	
US TREASURY N/B-1.5%-28/11/30	6,000,000.00	5,118,046.86	
US TREASURY N/B-1.375%-28/12/31	870,000.00	736,305.46	
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,370,000.00	3,977,382.81	
US TREASURY N/B-2.375%-29/03/31	4,630,000.00	4,145,206.45	
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	4,180,000.00	3,737,181.25	
US TREASURY N/B-3.25%-29/06/30	2,650,000.00	2,500,316.38	
US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	3,470,000.00	2,954,108.56	
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	1,390,000.00	1,191,870.70	
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	3,627,290.62	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,200,429.22	
US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	4,590,000.00	3,558,505.08	
US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	5,090,000.00	3,918,902.36	
US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	6,110,000.00	4,788,712.50	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	560,000.00	607,785.92	

US TREASURY N/B-1.125%-31/02/15	4,400,000.00	3,506,421.86
US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	7,480,000.00	6,159,020.33
US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	7,600,000.00	6,012,312.50
US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	6,830,000.00	5,426,915.21
US TREASURY N/B-1.875%-32/02/15	6,500,000.00	5,382,812.50
US TREASURY N/B-2.875%-32/05/15	4,600,000.00	4,152,937.50
US TREASURY N/B-2.75%-32/08/15	3,200,000.00	2,852,000.00
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	828,984.32
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	811,669.87
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	677,930.05
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	720,000.00	737,971.84
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	722,890.62
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	1,436,066.39
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	1,449,370.57
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	751,977.52
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	702,697.65
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	1,589,906.84
US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	2,187,335.95
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,344,487.50
US TREASURY N/B-1.125%-40/08/15	3,000,000.00	1,759,335.93
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	990,135.35
US TREASURY N/B-1.375%-40/11/15	3,100,000.00	1,897,054.67
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	1,569,316.35
US TREASURY N/B-1.875%-41/02/15	4,200,000.00	2,814,410.17
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	865,463.08
US TREASURY N/B-2.25%-41/05/15	4,900,000.00	3,505,126.94
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	873,487.49
US TREASURY N/B-1.75%-41/08/15	3,190,000.00	2,064,528.12
US TREASURY N/B-2.0%-41/11/15	3,000,000.00	2,029,335.93
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	411,894.53
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	613,062.49
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	1,528,046.88
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	1,765,000.00	1,433,579.87
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	1,591,632.81
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	1,950,000.00	1,715,238.29
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	1,870,468.36
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	1,080,000.00	945,084.36
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,200,000.00	1,843,703.13
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	2,150,000.00	1,724,619.14
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	2,300,000.00	1,801,996.08
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	2,820,000.00	2,009,910.95
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	1,400,000.00	1,093,968.75
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	1,390,000.00	1,060,417.96



		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	1,190,000.00	928,339.45
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	1,500,000.00	1,061,601.57
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	1,500,000.00	1,059,052.74
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	1,438,316.41
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	1,540,000.00	1,171,693.35
		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,000,000.00	1,556,835.94
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	1,780,000.00	1,385,966.40
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	1,483,984.38
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,740,000.00	1,291,746.08
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	2,148,115.22
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	1,925,906.25
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	3,216,738.27
		US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	2,491,597.67
		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	2,602,875.00
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	2,307,890.64
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,950,000.00	1,979,611.33
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	2,138,515.62
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	2,320,015.62
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	2,450,000.00	1,241,269.51
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,570,000.00	1,347,342.57
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	3,000,000.00	1,688,085.93
		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	4,750,000.00	2,857,421.87
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	4,100,000.00	2,792,804.70
		US TREASURY N/B-2.0%-51/08/15	2,000,000.00	1,238,671.88
		US TREASURY N/B-1.875%-51/11/15	1,400,000.00	838,031.25
米ドル小計			604,930,000.00	526,775,394.98 (78,083,916,797)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-23/11/01	500,000.00	481,278.50
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-24/02/01	590,000.00	564,912.02
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-24/03/01	790,000.00	770,076.99
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-24/04/01	1,450,000.00	1,372,211.85
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,010,000.00	984,436.90
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-24/08/01	650,000.00	634,585.90
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-24/09/01	795,000.00	758,468.95
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-24/10/01	800,000.00	750,556.00
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	610,000.00	571,607.82
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-25/04/01	520,000.00	489,049.08
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	950,000.00	909,314.35
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-25/09/01	1,925,000.00	1,743,693.87
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	995,000.00	882,442.61
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	770,000.00	711,067.28
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-26/09/01	1,090,000.00	981,345.53

		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	420,000.00	378,626.22	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	850,000.00	756,179.55	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-27/09/01	420,000.00	403,027.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	707,000.00	652,121.95	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	540,000.00	609,875.46	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	364,000.00	337,211.05	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	2,198,000.00	1,869,311.08	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-30/12/01	1,405,000.00	1,108,379.21	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	1,676,000.00	1,425,622.36	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/12/01	1,950,000.00	1,646,673.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-32/06/01	790,000.00	694,301.77	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	710,000.00	845,373.57	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	340,000.00	390,117.36	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	600,000.00	623,982.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	730,000.00	709,017.61	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	750,000.00	637,378.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	2,403,000.00	1,704,238.83	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-53/12/01	996,000.00	652,296.33	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	273,586.79	
加ドル小計			31,629,000.00	28,322,368.69	(3,078,358,252)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	12,100,000.00	11,767,250.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	18,900,000.00	18,155,812.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	16,700,000.00	16,606,062.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	24,250,000.00	21,347,578.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	3,950,000.00	3,332,812.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	20,600,000.00	18,803,937.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	17,670,000.00	16,499,362.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	21,200,000.00	18,603,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	5,300,000.00	4,496,718.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	3,900,000.00	3,909,750.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	12,970,000.00	11,421,706.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	13,200,000.00	10,638,375.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	13,570,000.00	11,097,715.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-53/07/31	2,100,000.00	1,702,968.75	
メキシコペソ小計			186,410,000.00	168,383,049.99	(1,255,043,063)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	270,000.00	123,079.50	
		BELGIUM KINGDOM-0.2%-23/10/22	495,000.00	486,628.06	

BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	845,000.00	852,927.79
BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	670,000.00	650,222.94
BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,265,000.00	1,224,043.41
BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	670,000.00	721,623.50
BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	977,000.00	937,497.93
BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	830,000.00	775,864.08
BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	495,000.00	440,484.66
BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,070,000.00	1,242,049.58
BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	965,000.00	884,697.52
BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	1,060,000.00	958,430.80
BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	800,000.00	666,897.32
BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	1,000,000.00	878,261.00
BELGIUM KINGDOM-0.0%-31/10/22	640,000.00	505,833.92
BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	600,000.00	663,897.60
BELGIUM KINGDOM-0.35%-32/06/22	330,000.00	263,094.01
BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	695,000.00	602,808.25
BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	543,000.00	547,422.84
BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,080,000.00	1,298,505.70
BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	425,000.00	343,256.77
BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	485,000.00	413,963.50
BELGIUM KINGDOM-2.75%-39/04/22	160,000.00	152,322.56
BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	330,000.00	207,515.44
BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,142,000.00	1,307,077.24
BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	455,000.00	495,717.95
BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	658,000.00	486,717.33
BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	650,000.00	479,785.80
BELGIUM KINGDOM-1.4%-53/06/22	485,000.00	323,293.24
BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	412,000.00	345,911.90
BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	486,000.00	396,280.02
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-71/10/31	345,000.00	171,607.48
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-23/10/31	995,000.00	1,017,619.33
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	1,105,000.00	1,140,878.24
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-24/04/30	1,250,000.00	1,279,555.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-24/05/31	1,000,000.00	966,126.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%-24/07/30	1,100,000.00	1,064,211.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%-24/10/31	1,520,000.00	1,536,587.76
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-25/01/31	1,350,000.00	1,283,593.50

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,350,000.00	1,327,491.45
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,490,000.00	1,584,182.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,455,000.00	1,448,790.06
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 26/01/31	1,315,000.00	1,215,776.67
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,055,000.00	1,038,513.51
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,360,000.00	1,530,262.48
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	1,720,000.00	1,644,347.52
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 27/01/31	225,000.00	201,411.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,475,000.00	1,407,032.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%- 27/07/30	1,315,000.00	1,208,115.48
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	1,400,000.00	1,320,422.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 28/01/31	1,010,000.00	875,239.74
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	1,270,000.00	1,183,305.99
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/07/30	1,275,000.00	1,183,308.37
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,095,000.00	1,235,160.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	1,545,000.00	1,836,155.25
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 29/04/30	1,445,000.00	1,328,989.62
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%- 29/10/31	1,140,000.00	977,690.85
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 30/04/30	1,400,000.00	1,174,915.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,330,000.00	1,238,429.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%- 30/10/31	1,530,000.00	1,342,538.28
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%- 31/04/30	1,155,000.00	902,873.31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 31/10/31	1,045,000.00	833,661.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.7%- 32/04/30	1,340,000.00	1,071,055.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,450,000.00	1,774,428.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.55%- 32/10/31	645,000.00	606,492.21

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%-33/07/30	1,235,000.00	1,135,078.62
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%-35/07/30	1,195,000.00	1,005,533.94
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	1,250,000.00	1,356,560.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.85%-37/07/30	670,000.00	462,601.61
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	1,045,000.00	1,239,158.91
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%-40/10/31	1,000,000.00	683,318.54
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	1,300,000.00	1,510,199.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-42/07/30	300,000.00	193,228.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	930,000.00	1,152,274.65
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	1,060,000.00	946,736.88
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	985,000.00	837,804.79
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-50/10/31	1,170,000.00	638,149.59
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.9%-52/10/31	560,000.00	378,049.28
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	848,000.00	798,943.20
BUNDESobligation-0.0%-23/10/13	1,105,000.00	1,085,121.05
BUNDESobligation-0.0%-24/04/05	1,300,000.00	1,265,073.05
BUNDESobligation-0.0%-24/10/18	1,360,000.00	1,309,334.56
BUNDESobligation-0.0%-25/04/11	1,300,000.00	1,240,368.83
BUNDESobligation-0.0%-25/10/10	1,045,000.00	987,764.30
BUNDESobligation-0.0%-26/04/10	1,600,000.00	1,498,291.20
BUNDESobligation-0.0%-27/04/16	1,250,000.00	1,142,928.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	790,000.00	830,066.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-24/02/15	1,230,000.00	1,228,199.28
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-24/05/15	1,575,000.00	1,566,198.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-24/08/15	1,790,000.00	1,762,487.14
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	870,000.00	842,438.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15	1,740,000.00	1,696,747.08
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	1,820,000.00	1,738,398.48
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-26/08/15	1,900,000.00	1,766,428.10

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	2,795,000.00	2,600,719.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	910,000.00	1,086,752.94	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	1,580,000.00	1,475,348.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 27/11/15	1,150,000.00	1,040,621.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	1,150,000.00	1,347,551.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	1,770,000.00	1,638,290.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	970,000.00	1,106,401.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 28/08/15	1,670,000.00	1,510,967.57	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 28/11/15	1,080,000.00	957,963.24	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 29/02/15	1,875,000.00	1,681,417.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 29/08/15	1,830,000.00	1,595,223.81	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	660,000.00	842,546.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/02/15	1,410,000.00	1,216,012.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/08/15	1,920,000.00	1,638,186.24	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/08/15	420,000.00	358,550.22	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,110,000.00	1,392,581.58	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/02/15	2,120,000.00	1,788,548.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/08/15	1,065,000.00	887,985.28	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/08/15	400,000.00	333,715.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 32/02/15	1,238,000.00	1,017,485.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.7%- 32/08/15	100,000.00	95,862.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,475,000.00	1,856,943.87	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 35/05/15	1,200,000.00	902,958.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 36/05/15	1,000,000.00	734,388.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	1,790,000.00	2,147,795.94	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,235,000.00	1,546,433.65	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,355,000.00	1,814,237.95
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	955,000.00	1,089,163.17
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,635,000.00	1,688,392.56
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	2,197,000.00	2,298,725.49
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	2,040,000.00	1,662,444.96
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	1,330,000.00	733,714.45
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	640,000.00	354,172.43
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 52/08/15	750,000.00	397,967.93
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-23/12/15	900,000.00	881,222.40
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-24/03/15	830,000.00	809,438.41
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.2%-24/06/14	760,000.00	739,184.36
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 72/03/01	300,000.00	177,973.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 23/10/01	920,000.00	920,380.42
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.65%- 23/10/15	1,160,000.00	1,140,768.36
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	860,000.00	915,446.78
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/01/15	1,110,000.00	1,075,986.27
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/01/30	250,000.00	242,173.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	1,650,000.00	1,690,908.45
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/04/15	1,360,000.00	1,309,102.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 24/05/15	1,075,000.00	1,060,936.85
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.75%- 24/07/01	1,180,000.00	1,161,356.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/08/15	200,000.00	190,489.98
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,250,000.00	1,272,035.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 24/11/15	1,260,000.00	1,227,018.21
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,080,000.00	1,072,352.52
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/12/15	650,000.00	612,163.89
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 25/02/01	1,485,000.00	1,401,972.16
	1,540,000.00	1,610,870.80

BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 25/05/15	855,000.00	821,560.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	1,300,000.00	1,250,002.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 25/07/01	1,000,000.00	967,281.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 25/11/15	1,100,000.00	1,079,474.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	1,085,000.00	1,048,101.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 26/02/01	850,000.00	777,240.34	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,330,000.00	1,384,061.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 26/04/01	1,220,000.00	1,089,153.78	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,330,000.00	1,254,256.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%- 26/07/15	1,220,000.00	1,168,657.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 26/08/01	600,000.00	529,023.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	720,000.00	828,388.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,080,000.00	993,242.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%- 27/01/15	1,180,000.00	1,062,510.94	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.1%- 27/04/01	410,000.00	369,874.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	1,160,000.00	1,097,795.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	995,000.00	931,334.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 27/09/15	1,275,000.00	1,127,508.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	1,560,000.00	1,774,370.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	1,530,000.00	1,410,387.66	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%- 28/03/15	1,230,000.00	1,023,740.07	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 28/07/15	1,330,000.00	1,110,049.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,330,000.00	1,400,962.15	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 28/12/01	1,415,000.00	1,344,204.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 29/02/15	1,125,000.00	914,025.89	



BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 29/08/01	1,655,000.00	1,572,574.38
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	1,750,000.00	1,908,802.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,465,000.00	1,430,187.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 30/04/01	975,000.00	813,373.26
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 30/08/01	1,167,000.00	930,089.66
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 30/12/01	1,367,000.00	1,142,652.11
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 31/04/01	1,375,000.00	1,064,182.62
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	1,515,000.00	1,730,145.15
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%- 31/08/01	1,245,000.00	923,503.65
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 31/12/01	1,010,000.00	764,766.95
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,610,000.00	1,300,329.38
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 32/06/01	950,000.00	707,860.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,475,000.00	1,650,474.85
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	1,140,000.00	952,090.38
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	1,580,000.00	1,673,899.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	980,000.00	882,487.06
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 36/03/01	900,000.00	644,601.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	965,000.00	760,236.65
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,005,000.00	1,940,025.97
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 37/03/01	400,000.00	259,180.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	1,200,000.00	1,001,853.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,500,000.00	1,602,891.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%- 40/03/01	610,000.00	513,152.13
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,070,000.00	1,143,052.11
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%- 41/03/01	830,000.00	560,375.33
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,165,000.00	1,220,662.53

BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 45/04/30	440,000.00	264,105.91
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,120,000.00	943,925.92
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	970,000.00	740,239.98
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	1,135,000.00	985,056.28
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 49/09/01	850,000.00	782,776.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 50/09/01	870,000.00	609,506.18
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%- 51/09/01	850,000.00	501,262.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 52/09/01	280,000.00	180,582.08
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	630,000.00	441,774.27
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	250,000.00	250,366.32
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-24/09/15	255,000.00	245,865.64
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	382,000.00	400,958.66
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	280,000.00	270,000.92
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	435,000.00	410,046.35
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-26/09/15	100,000.00	91,328.50
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-27/04/15	120,000.00	114,420.36
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	400,000.00	363,692.80
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	382,850.38
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	238,804.20
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	375,000.00	324,269.62
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-30/09/15	172,000.00	139,388.80
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	535,000.00	455,888.48
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-31/09/15	125,000.00	99,496.37
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-32/09/15	65,000.00	57,536.61
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	325,000.00	268,191.30
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	278,000.00	191,003.79
FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15	263,000.00	163,895.39
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	277,000.00	261,235.93
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-43/04/15	210,000.00	131,465.40
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	194,423.55
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-52/04/15	250,000.00	118,955.50
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	515,000.00	215,068.58
FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	2,620,000.00	2,676,684.48
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-24/02/25	1,140,000.00	1,110,182.16
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-24/03/25	2,390,000.00	2,323,983.42
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	2,439,000.00	2,445,517.00
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	2,758,000.00	2,736,283.50

FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/02/25	135,000.00	128,308.59
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/03/25	2,785,000.00	2,643,321.48
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	2,610,000.00	2,500,761.06
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,090,000.00	2,317,711.77
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	2,070,000.00	1,997,459.43
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-26/02/25	1,800,000.00	1,673,019.00
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	2,730,000.00	2,847,272.61
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,450,000.00	2,304,771.35
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	3,010,000.00	2,775,815.98
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-27/02/25	1,390,000.00	1,260,066.96
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	2,275,000.00	2,147,964.00
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,350,000.00	3,414,990.00
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	3,715,000.00	3,402,902.85
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	3,030,000.00	2,754,421.50
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	1,975,000.00	2,331,793.62
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	2,990,000.00	2,651,974.52
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-29/11/25	2,580,000.00	2,177,646.42
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	2,965,000.00	2,985,947.72
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-30/11/25	3,049,000.00	2,499,298.83
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	3,290,000.00	3,048,823.26
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-31/11/25	2,605,000.00	2,069,599.56
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-32/05/25	2,178,000.00	1,698,356.48
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	2,085,000.00	2,636,061.33
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-32/11/25	400,000.00	375,503.20
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	2,425,000.00	2,044,262.87
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	1,735,000.00	2,057,373.41
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	2,555,000.00	2,072,176.54
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	1,590,000.00	1,776,308.25
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	2,060,000.00	1,733,292.24
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	2,780,000.00	3,309,648.38
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-44/06/25	960,000.00	583,802.32
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	1,730,000.00	1,779,848.22
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	1,830,000.00	1,490,265.99
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-50/05/25	1,960,000.00	1,410,847.20
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-52/05/25	1,500,000.00	852,318.00
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-53/05/25	775,000.00	431,781.17
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,300,000.00	1,547,598.00
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,070,000.00	1,287,568.45
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	825,000.00	595,442.60
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	460,000.00	468,592.80
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	580,000.00	623,937.55
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	655,000.00	630,643.82
IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15	395,000.00	360,435.52

IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	520,000.00	480,884.56
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	600,000.00	554,574.60
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	546,000.00	545,182.31
IRISH TREASURY-0.2%-30/10/18	282,000.00	236,216.17
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	475,000.00	437,394.25
IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	485,000.00	386,871.40
IRISH TREASURY-0.35%-32/10/18	205,000.00	164,315.29
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	285,000.00	249,054.09
IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	310,000.00	232,172.64
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	390,000.00	333,297.90
IRISH TREASURY-0.55%-41/04/22	250,000.00	162,141.00
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	541,000.00	450,505.84
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	464,000.00	331,699.68
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	880,000.00	859,688.72
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	989,000.00	989,817.90
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,035,000.00	986,568.23
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-26/01/15	250,000.00	233,626.12
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,140,000.00	1,075,607.10
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	898,000.00	820,906.70
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	925,000.00	866,329.84
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	775,000.00	898,848.87
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	961,000.00	884,944.53
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	535,000.00	463,638.49
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	645,000.00	563,968.32
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-30/07/15	725,000.00	608,605.60
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-31/07/15	690,000.00	564,771.90
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-32/07/15	570,000.00	474,129.99
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	855,000.00	854,837.55
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,025,000.00	1,180,554.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-38/01/15	325,000.00	218,510.50
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	888,000.00	626,787.69
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,017,000.00	1,181,294.62
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,154,000.00	1,194,737.35
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	777,000.00	390,753.30
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.7%-71/04/20	200,000.00	90,341.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	173,000.00	105,726.35
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	403,000.00	302,787.19
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.85%-99/99/99	192,000.00	85,333.05
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.75%-23/10/20	750,000.00	749,130.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-24/07/15	555,000.00	537,050.74
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	705,000.00	700,676.94
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-25/04/20	400,000.00	379,234.00

		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	710,000.00	688,416.71
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	550,000.00	597,330.25
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.0%-26/07/15	140,000.00	138,329.30
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	963,000.00	904,958.06
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	627,625.08
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	540,000.00	631,024.02
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	660,000.00	602,057.28
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	885,000.00	774,910.42
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	680,000.00	557,285.16
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-31/02/20	665,000.00	528,202.85
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.9%-32/02/20	400,000.00	335,592.40
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	515,000.00	486,460.76
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-36/10/20	270,000.00	185,691.96
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	840,000.00	941,382.96
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	345,000.00	201,189.16
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	394,000.00	404,550.92
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	503,000.00	376,206.27
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.85%-49/05/23	170,000.00	136,339.15
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	405,000.00	237,626.86
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	190,000.00	223,341.20
ユーロ小計			367,546,000.00	344,989,878.28 (50,837,708,463)
英債券	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	650,000.00	398,860.80
		UK TREASURY-1.125%-73/10/22	473,000.00	232,739.65
		UK TREASURY-0.125%-24/01/31	1,230,000.00	1,182,460.50
		UK TREASURY-1.0%-24/04/22	1,030,000.00	995,598.00
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	875,000.00	865,707.85
		UK TREASURY-0.25%-25/01/31	930,000.00	862,336.17
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,205,000.00	1,245,186.26
		UK TREASURY-0.625%-25/06/07	813,000.00	756,483.65
		UK TREASURY-0.125%-26/01/30	710,000.00	635,201.50
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	820,000.00	759,943.20
		UK TREASURY-0.375%-26/10/22	710,000.00	623,380.00
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	840,000.00	750,024.24
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	850,000.00	866,524.00
		UK TREASURY-0.125%-28/01/31	745,000.00	617,016.45
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	720,000.00	640,108.80
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	710,000.00	793,925.55
		UK TREASURY-0.5%-29/01/31	565,000.00	461,944.00
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	856,000.00	707,740.80
		UK TREASURY-0.375%-30/10/22	920,000.00	711,252.00
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,005,000.00	1,084,113.60

		UK TREASURY-0.25%-31/07/31	1,365,000.00	1,016,652.00	
		UK TREASURY-1.0%-32/01/31	305,000.00	240,337.86	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,370,000.00	1,438,116.40	
		UK TREASURY-0.875%-33/07/31	370,000.00	276,020.00	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	849,000.00	909,558.83	
		UK TREASURY-0.625%-35/07/31	1,007,000.00	684,361.22	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	970,000.00	1,008,467.87	
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,350,000.00	1,019,790.00	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,060,000.00	1,162,498.60	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	970,000.00	1,003,916.05	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	935,000.00	972,203.65	
		UK TREASURY-1.25%-41/10/22	820,000.00	531,435.44	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,090,000.00	1,181,141.87	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,175,000.00	1,067,755.87	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,160,000.00	1,094,245.63	
		UK TREASURY-0.875%-46/01/31	435,000.00	239,418.95	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	920,000.00	977,132.00	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,340,000.00	853,285.20	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	675,000.00	453,465.00	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	895,000.00	967,821.13	
		UK TREASURY-0.625%-50/10/22	660,000.00	311,718.00	
		UK TREASURY-1.25%-51/07/31	300,000.00	171,489.00	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	872,000.00	882,376.80	
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	635,000.00	397,893.54	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	962,000.00	1,079,306.28	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	696,163.55	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	751,000.00	823,442.96	
		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	830,000.00	326,264.70	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	830,000.00	849,270.94	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	605,000.00	582,182.72	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	882,000.00	703,641.96	
		英ボンド小計	44,120,000.00	39,111,921.04 (6,630,252,854)	
スウェーデン デンク ローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	5,900,000.00	5,856,946.69	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,420,000.00	4,429,575.93	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	4,700,000.00	4,452,950.04	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,550,000.00	3,260,976.46	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	3,780,000.00	3,402,006.80	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	2,600,000.00	2,180,990.11	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,800,000.00	1,815,849.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	2,985,000.00	3,548,045.62	
			29,735,000.00	28,947,340.65	

スウェーデンクローナ小計				(390,499,625)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	3,820,000.00	3,793,214.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,190,000.00	3,058,779.35
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,750,000.00	2,570,359.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,400,000.00	2,221,212.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,340,000.00	2,148,213.60
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	2,250,000.00	1,993,311.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	3,150,000.00	2,667,735.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.25%-31/09/17	2,040,000.00	1,669,944.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.125%-32/05/18	1,900,000.00	1,670,480.00
ノルウェークローネ小計			23,840,000.00	21,793,247.95 (309,464,120)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.5%-23/11/15	3,190,000.00	3,175,003.81
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-24/11/15	1,260,000.00	1,205,404.20
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	3,370,000.00	3,319,157.48
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	4,310,000.00	3,926,556.54
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	2,830,000.00	2,472,007.40
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-31/11/15	1,150,000.00	915,228.65
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	9,450,000.00	11,731,094.86
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	1,300,000.00	692,471.00
デンマーククローネ小計			26,860,000.00	27,436,923.94 (543,525,463)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-4.0%-23/10/25	1,650,000.00	1,590,105.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	2,110,000.00	1,950,188.60
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-24/07/25	310,000.00	270,010.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	1,980,000.00	1,770,060.60
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	1,440,000.00	1,206,532.80
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,570,000.00	2,258,541.70
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,590,000.00	2,117,376.80
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,950,000.00	1,431,280.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	460,000.00	383,138.60
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,140,000.00	1,675,170.60
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,160,000.00	1,663,567.20
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	555,000.00	493,062.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	2,665,000.00	1,929,806.45
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	2,025,000.00	1,237,882.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-32/04/25	1,300,000.00	772,941.00
ポーランドズロチ小計			25,905,000.00	20,749,664.35 (641,714,494)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	755,000.00	748,891.07
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-24/11/21	1,715,000.00	1,605,949.53
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	1,000,000.00	994,311.50

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	950,000.00	859,366.52	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	1,130,000.00	1,154,118.38	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,310,000.00	1,161,499.25	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,170,000.00	1,221,406.29	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	980,000.00	935,561.99	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	850,000.00	784,700.47	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	720,000.00	678,245.78	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	930,000.00	897,157.87	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	890,000.00	826,352.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,300,000.00	1,176,790.61	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	1,180,000.00	934,851.67	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,378,000.00	1,125,122.58	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,790,000.00	1,378,820.85	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,580,000.00	1,230,613.13	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	1,270,000.00	1,028,191.57	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,035,000.00	1,072,164.98	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-33/11/21	790,000.00	712,046.52	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	530,000.00	453,899.63	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	750,000.00	705,143.13	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	582,000.00	504,595.57	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	790,000.00	622,267.86	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	720,000.00	565,449.45	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	1,020,000.00	579,656.33	
	豪ドル小計		27,115,000.00	23,957,175.23 (2,264,192,630)	
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-72/08/01	140,000.00	137,725.99	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-24/02/01	560,000.00	551,866.13	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	538,207.20	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	470,000.00	460,224.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-25/11/01	229,000.00	210,725.80	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	470,000.00	450,965.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-26/11/01	205,000.00	188,805.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	533,000.00	535,025.40	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	290,000.00	277,646.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	450,000.00	432,900.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	540,000.00	516,024.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-31/07/01	300,000.00	257,760.66	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-32/08/01	120,000.00	111,326.77	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	355,000.00	351,627.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	501,000.00	437,563.38	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	220,000.00	193,380.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	287,000.00	266,932.96	



		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	332,000.00	310,420.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	367,000.00	282,039.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-51/10/01	150,000.00	115,490.25	
シンガポールドル小計			7,059,000.00	6,626,655.54 (692,485,503)	
マレーシア リング ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.478%-24/06/14	775,000.00	773,760.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	830,000.00	836,598.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	530,000.00	529,496.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,550,000.00	1,549,535.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	780,000.00	774,150.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	1,070,000.00	1,058,979.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	920,000.00	905,280.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,320,000.00	1,274,460.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	985,000.00	852,025.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	694,872.01	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,100,000.00	1,009,800.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	960,000.00	912,000.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,170,000.00	1,177,605.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	590,000.00	592,279.17	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	1,490,000.00	1,285,870.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.696%-42/10/15	200,000.00	194,700.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	660,000.00	658,428.88	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	750,000.00	723,396.34	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	510,000.00	501,650.53	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	1,560,000.00	1,340,820.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	800,000.00	807,320.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	750,000.00	763,209.30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	330,000.00	326,046.57	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	920,550.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,620,000.00	1,566,054.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	910,000.00	906,870.49	
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,004,322.65			
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	912,025.30			
マレーシアリングギット小計			25,825,000.00	24,852,104.24 (778,544,354)	
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-23/10/18	7,000,000.00	7,109,756.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-23/11/05	12,000,000.00	12,131,310.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-24/04/11	14,000,000.00	14,277,277.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.47%-24/09/02	11,000,000.00	11,082,496.70	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.94%-24/10/17	8,000,000.00	8,141,272.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.99%-25/04/09	13,000,000.00	12,928,506.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-25/08/25	7,000,000.00	6,983,861.50	

		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	9,000,000.00	9,203,638.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	12,000,000.00	12,284,052.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	12,000,000.00	12,124,518.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-26/12/05	8,000,000.00	8,222,996.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	19,000,000.00	19,301,397.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.28%-27/12/03	5,000,000.00	5,195,460.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	12,000,000.00	12,280,212.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	8,000,000.00	8,130,912.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-29/05/23	14,000,000.00	14,607,040.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	11,000,000.00	10,949,976.95	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	8,000,000.00	8,326,365.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	5,000,000.00	5,098,235.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	8,000,000.00	7,986,770.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.76%-32/05/15	6,000,000.00	6,014,993.70	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	6,000,000.00	6,701,457.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	6,000,000.00	6,616,530.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.53%-51/10/18	7,000,000.00	7,484,060.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.32%-52/04/15	7,000,000.00	7,239,333.50	
中国元小計			235,000,000.00	240,422,428.75 (4,901,468,012)	
イスラエル シュケル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-1.5%-23/11/30	760,000.00	748,649.78	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-24/03/31	1,420,000.00	1,431,937.42	
		ISRAEL FIXED BOND-0.4%-24/10/31	280,000.00	265,005.96	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-25/04/30	1,360,000.00	1,273,547.62	
		ISRAEL FIXED BOND-1.75%-25/08/31	1,240,000.00	1,191,372.74	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-26/02/27	530,000.00	484,791.38	
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	950,000.00	1,056,427.32	
		ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,270,000.00	1,205,317.33	
		ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,040,000.00	982,168.67	
		ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	1,515,000.00	1,288,683.02	
		ISRAEL FIXED BOND-1.3%-32/04/30	150,000.00	125,641.76	
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	1,050,000.00	810,389.39	
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,160,000.00	1,470,582.58	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,300,000.00	1,305,926.45	
イスラエルシュケル小計			14,025,000.00	13,640,441.42 (574,169,828)	
合計				150,981,343,458 (150,981,343,458)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 217銘柄	100.0%	51.7%
加ドル	国債証券 34銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 341銘柄	100.0%	33.7%
英ポンド	国債証券 51銘柄	100.0%	4.4%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.4%
豪ドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリングgit	国債証券 28銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券 25銘柄	100.0%	3.2%
イスラエルシェケル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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。

## 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

	2021年10月26日現在	2022年10月26日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	94,822,487	92,356,279
コール・ローン	176,632,228	223,451,180
国債証券	25,084,499,464	21,165,170,810
派生商品評価勘定	5,845,123	4,960,875
未収入金	269,314,857	228,168,783
未収利息	205,713,414	209,204,786
前払費用	5,189,942	4,799,110
流動資産合計	25,842,017,515	21,928,111,823
資産合計	25,842,017,515	21,928,111,823
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	614,900,264	674,177,769
未払解約金	2,855,481	1,921,122
未払利息	70	363
流動負債合計	617,755,815	676,099,254
負債合計	617,755,815	676,099,254
<b>純資産の部</b>		

	2021年10月26日現在	2022年10月26日現在
元本等		
元本	15,760,382,772	15,845,617,925
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	9,463,878,928	5,406,394,644
元本等合計	25,224,261,700	21,252,012,569
純資産合計	25,224,261,700	21,252,012,569
負債純資産合計	25,842,017,515	21,928,111,823

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	2021年10月26日現在	2022年10月26日現在
1. 期首	2020年10月27日	2021年10月27日
期首元本額	15,326,314,880円	15,760,382,772円
期首からの追加設定元本額	1,464,475,775円	1,595,187,275円
期首からの一部解約元本額	1,030,407,883円	1,509,952,122円
元本の内訳		
インデックスファンド海外債券ヘッジあり(DC専用)	4,087,190,320円	4,491,168,325円
インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	1,238,549,893円	1,362,007,124円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	4,403,325円	-円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	5,297,362円	-円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	9,597,905円	-円

アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	16,573,076円	- 円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	9,387,722,617円	8,946,084,555円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	98,744,927円	115,914,160円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	140,965,478円	160,237,873円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	142,979,875円	162,007,452円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	102,372,497円	121,140,667円
インデックスファンド海外債券（ヘッジあり）1年決算型	525,985,497円	487,057,769円
計	15,760,382,772円	15,845,617,925円
2. 受益権の総数	15,760,382,772口	15,845,617,925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10月27日 至 2021年10月26日	自 2021年10月27日 至 2022年10月26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10月26日現在	2022年10月26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10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	1,304,668,146
合計	1,304,668,146

(2022年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	4,223,897,782
合計	4,223,897,782

(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10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	25,132,848,047	-	25,741,903,188	609,055,141
	米ドル	11,594,463,001	-	11,942,916,384	348,453,383
	加ドル	471,156,657	-	494,758,896	23,602,239
	メキシコペソ	192,913,775	-	197,272,283	4,358,508
	ユーロ	9,962,497,839	-	10,111,686,771	149,188,932
	英ポンド	1,535,343,385	-	1,576,508,117	41,164,732
	スウェーデンクローナ	120,576,900	-	124,494,300	3,917,400
	ノルウェークローネ	68,969,525	-	72,876,300	3,906,775
	デンマーククローネ	82,713,604	-	82,996,250	282,646
	ポーランドズロチ	160,471,648	-	161,254,720	783,072
	豪ドル	478,090,634	-	493,618,719	15,528,085
	シンガポールドル	105,685,309	-	107,989,902	2,304,593
	マレーシアリングット	256,755,119	-	267,948,028	11,192,909
	イスラエルシェケル	103,210,651	-	107,582,518	4,371,867
合計		25,132,848,047	-	25,741,903,188	609,055,141

(2022年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	21,107,740,915	-	21,776,957,809	669,216,894
	米ドル	10,872,337,615	-	11,289,746,910	417,409,295
	加ドル	429,141,508	-	433,345,113	4,203,605
	メキシコペソ	161,999,208	-	167,119,751	5,120,543
ユーロ	6,974,520,911	-	7,161,216,757	186,695,846	

英ポンド	869,964,569	-	903,363,190	33,398,621
スウェーデンク ローナ	76,983,624	-	78,332,605	1,348,981
ノルウェークロー ネ	50,761,227	-	51,492,584	731,357
デンマーククロー ネ	67,178,043	-	68,306,424	1,128,381
ポーランドズロチ	102,244,184	-	107,104,600	4,860,416
豪ドル	323,591,193	-	323,045,112	546,081
シンガポールドル	85,265,557	-	86,746,219	1,480,662
マレーシアリン ギット	306,688,270	-	305,791,936	896,334
中国元	677,750,740	-	688,090,904	10,340,164
イスラエルシケ ル	109,314,266	-	113,255,704	3,941,438
合計	21,107,740,915	-	21,776,957,809	669,216,894

## (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10月26日現在		2022年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.6005円	1口当たり純資産額	1.3412円
(1万口当たり純資産額)	(16,005円)	(1万口当たり純資産額)	(13,412円)



## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.875%-23/09/30	900,000.00	887,489.30	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/10/31	1,200,000.00	1,180,558.08	
		US TREASURY N/B-2.75%-23/11/15	1,440,000.00	1,413,578.57	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/11/30	1,300,000.00	1,277,427.73	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/01/31	1,700,000.00	1,656,537.10	
		US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	1,080,000.00	1,054,645.31	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,000,000.00	968,203.12	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	1,300,000.00	1,256,074.22	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	1,200,000.00	1,162,031.25	
		US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	1,700,000.00	1,629,675.77	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	2,830,000.00	2,722,990.62	
		US TREASURY N/B-1.5%-24/09/30	1,000,000.00	945,429.69	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	3,800,000.00	3,635,085.92	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	2,650,000.00	2,506,837.88	
		US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	1,500,000.00	1,415,390.62	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	700,000.00	670,332.03	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	2,300,000.00	2,151,128.91	
		US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	1,800,000.00	1,686,937.50	
		US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	1,500,000.00	1,324,628.91	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	900,000.00	851,765.62	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	1,600,000.00	1,462,375.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	2,100,000.00	1,909,441.40	
		US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	900,000.00	809,367.19	
		US TREASURY N/B-1.375%-26/08/31	500,000.00	447,324.22	
		US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	4,000,000.00	3,650,546.88	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	500,000.00	449,511.72	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	1,100,000.00	1,010,410.15	
		US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,000,000.00	875,039.06	
		US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	1,500,000.00	1,380,234.37	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	1,500,000.00	1,368,310.54	
		US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	500,000.00	414,140.62	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	1,100,000.00	914,203.12	

US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	530,000.00	573,083.17
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	600,000.00	545,062.50
US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	1,000,000.00	852,226.56
US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	1,000,000.00	848,828.12
US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	400,000.00	333,640.62
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	1,500,000.00	1,392,773.43
US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	1,400,000.00	1,173,812.50
US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	500,000.00	421,523.44
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	210,000.00	220,647.65
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	400,000.00	364,062.50
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	1,600,000.00	1,430,500.00
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	500,000.00	428,730.47
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	400,000.00	334,312.50
US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	800,000.00	620,218.75
US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	950,000.00	744,562.50
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	400,000.00	434,132.80
US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	600,000.00	494,039.06
US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	900,000.00	711,984.37
US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	3,450,000.00	2,741,267.56
US TREASURY N/B-2.875%-32/05/15	700,000.00	631,968.75
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	390,000.00	404,129.85
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	170,000.00	172,012.10
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	390,000.00	352,409.17
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	100,000.00	100,263.67
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	230,000.00	229,986.52
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	350,000.00	326,785.15
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	200,000.00	198,957.03
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	200,000.00	181,976.56
US TREASURY N/B-3.125%-41/11/15	350,000.00	288,285.15
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	300,000.00	229,207.03
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	100,000.00	81,222.65
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	250,000.00	194,101.56
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	140,000.00	123,145.31
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	200,000.00	178,992.18
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	550,000.00	481,292.96
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	120,000.00	100,565.62
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	600,000.00	470,085.93
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	900,000.00	641,460.94
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	450,000.00	351,632.81
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	700,000.00	534,023.43
US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	200,000.00	156,023.43
US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	1,250,000.00	884,667.97

		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	150,000.00	105,905.27
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	1,250,000.00	836,230.47
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	300,000.00	228,251.95
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	1,550,000.00	1,150,087.89
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,050,000.00	779,501.95
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	650,000.00	509,970.70
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	1,000,000.00	671,054.69
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	3,100,000.00	1,570,585.92
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	1,800,000.00	943,664.05
米ドル小計			84,930,000.00	73,861,509.58 (10,948,491,565)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-23/11/01	450,000.00	433,150.65
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-24/04/01	400,000.00	378,541.20
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	400,000.00	374,824.80
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	400,000.00	354,750.80
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	400,000.00	360,596.40
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	480,000.00	542,111.52
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	400,000.00	370,561.60
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	210,000.00	240,954.84
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	200,000.00	207,994.00
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	200,000.00	194,251.40
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	450,000.00	319,145.85
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	100,000.00	81,667.70
加ドル小計			4,090,000.00	3,858,550.76 (419,385,882)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	3,000,000.00	2,917,500.00
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	5,000,000.00	4,971,875.00
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	2,000,000.00	1,825,625.00
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	4,000,000.00	3,735,000.00
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	2,500,000.00	2,193,750.00
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	4,500,000.00	3,962,812.50
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	3,000,000.00	2,417,812.50
メキシコペソ小計			24,000,000.00	22,024,375.00 (164,158,679)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	200,000.00	201,876.40
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	150,000.00	143,935.20
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	100,000.00	93,477.60
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	130,000.00	150,903.22
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	200,000.00	183,357.00
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	400,000.00	333,448.66
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	550,000.00	483,043.55

BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	170,000.00	188,104.32
BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	260,000.00	312,603.22
BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	300,000.00	343,365.30
BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	220,000.00	239,687.80
BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	80,000.00	65,231.28
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.4%-23/10/31	200,000.00	204,546.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	300,000.00	309,740.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%-25/04/30	500,000.00	491,663.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	200,000.00	212,642.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-26/04/30	600,000.00	590,623.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	400,000.00	450,077.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/04/30	300,000.00	279,521.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/07/30	500,000.00	464,042.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-28/10/31	650,000.00	733,200.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	430,000.00	511,033.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%-29/10/31	150,000.00	128,643.53
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-30/07/30	150,000.00	139,672.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%-30/10/31	300,000.00	263,242.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%-31/04/30	300,000.00	234,512.55
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	200,000.00	244,748.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	430,000.00	466,656.64
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	400,000.00	464,676.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	150,000.00	185,850.75
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	400,000.00	357,259.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	250,000.00	212,640.81
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	100,000.00	94,215.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	570,000.00	598,908.74
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-24/02/15	400,000.00	399,414.40

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%- 24/05/15	500,000.00	497,206.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	250,000.00	246,157.42
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	500,000.00	484,160.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	500,000.00	487,571.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	250,000.00	238,791.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	400,000.00	372,196.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	300,000.00	280,129.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	260,000.00	304,663.84
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	500,000.00	462,794.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	200,000.00	228,124.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 29/02/15	500,000.00	448,378.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	350,000.00	446,804.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	470,000.00	589,651.66
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 32/02/15	150,000.00	123,281.77
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	300,000.00	377,683.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 35/05/15	250,000.00	188,116.25
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	260,000.00	311,970.36
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	150,000.00	187,825.95
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	270,000.00	361,508.67
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	200,000.00	228,097.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	250,000.00	258,164.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	550,000.00	575,466.10
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	300,000.00	165,499.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 52/08/15	200,000.00	106,124.78
BUONI POLIENNALI DEL TES-9.0%- 23/11/01	430,000.00	457,723.39
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 24/03/01	700,000.00	717,355.10

BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	200,000.00	203,525.64
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 25/02/01	200,000.00	188,817.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	450,000.00	470,709.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	400,000.00	384,616.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 25/11/15	300,000.00	294,402.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	650,000.00	676,421.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	550,000.00	632,797.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	500,000.00	468,007.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	600,000.00	682,450.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	550,000.00	579,345.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	450,000.00	490,834.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	500,000.00	488,118.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 31/04/01	150,000.00	116,092.65
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	650,000.00	742,306.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	300,000.00	242,297.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	250,000.00	279,741.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	250,000.00	264,857.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	260,000.00	251,574.44
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	450,000.00	480,867.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	300,000.00	320,481.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	150,000.00	157,166.85
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	650,000.00	547,814.15
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	400,000.00	347,156.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	250,000.00	175,307.25
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	200,000.00	209,926.00
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	300,000.00	302,250.30
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	150,000.00	123,780.60
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	100,000.00	94,309.00

FRANCE (GOVT OF)-4.25%-23/10/25	600,000.00	612,981.18
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	850,000.00	852,271.20
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	450,000.00	446,456.70
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	400,000.00	383,258.40
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	450,000.00	499,028.85
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	600,000.00	578,973.74
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	400,000.00	417,182.80
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	200,000.00	188,144.60
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	600,000.00	566,496.00
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	350,000.00	356,790.00
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	450,000.00	412,195.50
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	500,000.00	454,525.00
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	490,000.00	578,520.95
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	700,000.00	704,945.50
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	1,000,000.00	926,694.00
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	600,000.00	758,578.80
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	300,000.00	252,898.50
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	180,000.00	213,445.08
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	500,000.00	405,514.00
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	460,000.00	513,900.50
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	150,000.00	126,210.60
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-40/05/25	270,000.00	176,881.86
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	250,000.00	297,630.25
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	450,000.00	462,966.30
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	300,000.00	244,305.90
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-52/05/25	200,000.00	113,642.40
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	320,000.00	380,947.20
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	350,000.00	421,167.25
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	200,000.00	215,150.88
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	300,000.00	299,550.72
IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	300,000.00	239,301.90
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	200,000.00	170,922.00
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	100,000.00	83,272.80
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	100,000.00	100,082.70
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	150,000.00	142,980.90
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	250,000.00	235,878.75
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	420,000.00	487,118.10
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	400,000.00	346,645.60
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	230,000.00	229,956.30
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	300,000.00	345,528.00
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	200,000.00	141,168.40
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	200,000.00	207,060.20

		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	100,000.00	99,386.80
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	200,000.00	217,211.00
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	200,000.00	233,712.60
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	200,000.00	175,121.00
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	350,000.00	330,604.40
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	350,000.00	392,242.90
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	150,000.00	154,016.85
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	80,000.00	94,038.40
ユーロ小計			47,140,000.00	47,425,489.40 (6,988,620,117)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-0.125%-24/01/31	150,000.00	144,202.50
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	350,000.00	346,283.14
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	200,000.00	185,352.00
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	250,000.00	223,221.50
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	150,000.00	152,916.00
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	120,000.00	134,184.60
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	350,000.00	289,380.00
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	200,000.00	215,744.00
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	280,000.00	293,921.60
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	100,000.00	107,132.96
		UK TREASURY-0.625%-35/07/31	200,000.00	135,920.80
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	260,000.00	270,310.97
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	170,000.00	186,438.45
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	100,000.00	103,979.00
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	120,000.00	130,033.96
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	250,000.00	227,182.10
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	350,000.00	371,735.00
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	100,000.00	63,678.00
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	100,000.00	67,180.00
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	560,000.00	628,286.40
UK TREASURY-4.0%-60/01/22	400,000.00	438,584.80		
UK TREASURY-3.5%-68/07/22	300,000.00	306,965.40		
UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	300,000.00	288,685.65		
英ポンド小計			5,360,000.00	5,311,318.83 (900,374,768)
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.5%-23/11/13	1,500,000.00	1,489,054.24
		SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	250,000.00	250,541.62
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	1,500,000.00	1,421,154.27
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,750,000.00	1,765,408.75
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	700,000.00	832,037.50
スウェーデンクローナ小計			5,700,000.00	5,758,196.38 (77,678,069)
	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	450,000.00	446,844.58



ノルウェークローネ		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	1,000,000.00	958,865.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	1,000,000.00	934,676.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	1,300,000.00	1,193,452.00	
ノルウェークローネ小計			3,750,000.00	3,533,837.58 (50,180,493)	
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	500,000.00	492,456.60	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	2,300,000.00	2,855,187.11	
デンマーククローネ小計			2,800,000.00	3,347,643.71 (66,316,821)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	1,000,000.00	893,970.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	500,000.00	418,935.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,200,000.00	880,788.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	500,000.00	416,455.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	1,000,000.00	724,130.00	
ポーランドズロチ小計			4,200,000.00	3,334,278.00 (103,117,548)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	150,000.00	148,786.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	200,000.00	198,862.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	250,000.00	226,149.08	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	330,000.00	337,043.42	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	150,000.00	156,590.55	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	400,000.00	381,862.04	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	350,000.00	337,640.06	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	500,000.00	452,611.77	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	300,000.00	237,674.15	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	550,000.00	517,104.96	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	450,000.00	353,405.91	
豪ドル小計			3,630,000.00	3,347,730.54 (316,394,013)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	400,000.00	401,520.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	100,000.00	99,050.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	150,000.00	139,512.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	190,000.00	177,650.00	
シンガポールドル小計			840,000.00	817,732.00 (85,452,994)	
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,000,000.00	999,700.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,400,000.00	1,377,600.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,000,000.00	965,500.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,000,000.00	918,000.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	500,000.00	498,809.76	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	1,000,000.00	1,009,150.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	2,250,000.00	2,289,627.90	

マレーシアリングット小計			8,150,000.00	8,058,387.66 (252,445,916)
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-2.56%-23/10/21	1,000,000.00	1,007,448.10
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-23/11/05	1,000,000.00	1,010,942.50
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.84%-24/04/08	2,000,000.00	2,025,913.00
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-24/06/25	2,000,000.00	2,004,705.60
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.47%-24/09/02	1,000,000.00	1,007,499.70
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.26%-25/02/24	2,000,000.00	2,003,435.00
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	2,000,000.00	2,045,253.00
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	1,000,000.00	1,023,671.00
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	1,000,000.00	1,010,376.50
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-27/01/20	1,000,000.00	996,651.55
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.48%-27/04/15	3,000,000.00	2,998,206.00
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	1,000,000.00	1,023,351.00
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	1,000,000.00	1,016,364.00
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-29/03/24	4,000,000.00	4,027,860.00
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-29/06/15	1,000,000.00	1,003,277.50
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	2,000,000.00	2,039,294.00
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.89%-31/11/18	1,000,000.00	1,008,949.00
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	3,000,000.00	2,995,039.05
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	1,000,000.00	1,116,909.50
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	1,000,000.00	1,102,755.00
CHINA GOVERNMENT BOND-3.32%-52/04/15	1,000,000.00	1,034,190.50		
中国元小計			33,000,000.00	33,502,091.50 (683,003,789)
イスラエル シュケル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-3.75%-24/03/31	600,000.00	605,043.98
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-25/04/30	700,000.00	655,502.45
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	500,000.00	556,014.38
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	620,000.00	786,001.03
イスラエルシュケル小計			2,420,000.00	2,602,561.84 (109,550,156)
合計				21,165,170,810 (21,165,170,810)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 83銘柄	100.0%	51.7%
加ドル	国債証券 12銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.8%

ユーロ	国債証券	139銘柄	100.0%	33.0%
英ポンド	国債証券	23銘柄	100.0%	4.3%
スウェーデンクローナ	国債証券	5銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券	4銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券	5銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券	11銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	国債証券	4銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券	7銘柄	100.0%	1.2%
中国元	国債証券	21銘柄	100.0%	3.2%
イスラエルシェケル	国債証券	4銘柄	100.0%	0.5%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

**【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10月27日から2023年 4月26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。

## 【年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前計算期間末 2022年10月26日現在	当中間計算期間末 2023年 4月26日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	228,483,648	234,947,458
親投資信託受益証券	4,124,158,899	4,260,114,350
流動資産合計	4,352,642,547	4,495,061,808
資産合計	4,352,642,547	4,495,061,808
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,426,228	-
未払解約金	60,224	181,348
未払受託者報酬	964,597	961,241
未払委託者報酬	13,746,457	13,698,537
未払利息	371	189
その他未払費用	96,401	96,070
流動負債合計	17,294,278	14,937,385
負債合計	17,294,278	14,937,385
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,426,228,089	2,448,399,933
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,909,120,180	2,031,724,490
（分配準備積立金）	996,424,761	958,258,247
元本等合計	4,335,348,269	4,480,124,423
純資産合計	4,335,348,269	4,480,124,423
負債純資産合計	4,352,642,547	4,495,061,808

## （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10月27日	2022年4月26日	2022年10月27日	2023年4月26日
営業収益				
有価証券売買等損益		124,872,459		119,278,710
営業収益合計		124,872,459		119,278,710
営業費用				
支払利息		12,024		32,995
受託者報酬		975,787		961,241
委託者報酬		13,905,777		13,698,537
その他費用		97,527		96,070
営業費用合計		14,991,115		14,788,843
営業利益又は営業損失（ ）		139,863,574		104,489,867
経常利益又は経常損失（ ）		139,863,574		104,489,867
中間純利益又は中間純損失（ ）		139,863,574		104,489,867
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（ ）		3,794,560		1,059,290
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,102,945,343		1,909,120,180
剰余金増加額又は欠損金減少額		120,887,874		94,406,177
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		120,887,874		94,406,177
剰余金減少額又は欠損金増加額		135,689,970		75,232,444
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		135,689,970		75,232,444
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（ ）		1,952,074,233		2,031,724,490

## (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	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10月26日現在	当中間計算期間末 2023年 4月26日現在
1. 期首元本額	2,438,244,210円	2,426,228,089円
期中追加設定元本額	300,139,209円	118,164,895円
期中一部解約元本額	312,155,330円	95,993,051円
2. 受益権の総数	2,426,228,089口	2,448,399,933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10月27日 至 2022年 4月26日	当中間計算期間 自 2022年10月27日 至 2023年 4月26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10月26日現在	当中間計算期間末 2023年 4月26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ぬ。	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ぬ。
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10月26日現在		当中間計算期間末 2023年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	1.7869円	1口当たり純資産額	1.8298円
(1万口当たり純資産額)	(17,869円)	(1万口当たり純資産額)	(18,298円)

当ファンドは、「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」「海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」「海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」「日本債券インデックスマザーファンド」「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」「海外債券インデックス（ヘッジあり）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）

## 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

	2022年10月26日現在	2023年 4月26日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	148,573,517	98,979,743
株式	43,156,227,610	45,862,379,670
派生商品評価勘定	21,683,500	14,505,300
未収入金	-	224,917,500
未収配当金	453,000,178	546,604,978
流動資産合計	43,779,484,805	46,747,387,191
資産合計	43,779,484,805	46,747,387,191
<b>負債の部</b>		
流動負債		
前受金	18,700,000	20,062,900
未払解約金	9,624,321	46,201,145
未払利息	241	80
流動負債合計	28,324,562	66,264,125
負債合計	28,324,562	66,264,125
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	22,875,362,128	22,802,645,786
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	20,875,798,115	23,878,477,280
元本等合計	43,751,160,243	46,681,123,066



純資産合計	43,751,160,243	46,681,123,066
負債純資産合計	43,779,484,805	46,747,387,191

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2022年10月26日現在	2023年 4月26日現在
1.	期首	2021年10月27日	2022年10月27日
	期首元本額	21,309,131,563円	22,875,362,128円
	期首からの追加設定元本額	3,195,854,871円	886,634,553円
	期首からの一部解約元本額	1,629,624,306円	959,350,895円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	812,653,264円	805,951,549円
	DCインデックスバランス（株式40）	2,151,421,241円	2,188,113,783円
	DCインデックスバランス（株式60）	4,264,520,991円	4,432,314,438円
	DCインデックスバランス（株式80）	4,651,930,057円	4,895,954,561円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,697,661,452円	1,703,433,055円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	3,238,040,982円	3,155,775,429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）	600,774,622円	564,060,337円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	- 円	263,256円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	2,446,891,512円	2,109,553,594円

		2022年10月26日現在	2023年 4月26日現在
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	245,697,725円	236,827,151円
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	685,625,100円	663,326,008円
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,049,367,499円	1,026,881,141円
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,030,777,683円	1,020,191,484円
	計	22,875,362,128円	22,802,645,786円
2.	受益権の総数	22,875,362,128口	22,802,645,786口
3.	担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	530,690,000円	639,580,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2022年10月26日現在	2023年 4月26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10月26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	553,850,000	-	575,550,000	21,700,000
合計		553,850,000	-	575,550,000	21,700,000

(2023年 4月26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	633,157,100	-	647,680,000	14,522,900
合計		633,157,100	-	647,680,000	14,522,900

## (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。

## (1口当たり情報)

2022年10月26日現在		2023年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	1.9126円	1口当たり純資産額	2.0472円
(1万口当たり純資産額)	(19,126円)	(1万口当たり純資産額)	(20,472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

## 貸借対照表

(単位：円)

	2022年10月26日現在	2023年 4月26日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	128,867,914	739,923,873
コール・ローン	1,593,648,861	1,221,218,495
株式	248,313,230,169	259,565,488,430
投資証券	5,675,069,108	5,708,274,749
派生商品評価勘定	142,436,979	114,583,290
未収入金	64,092,962	3,404,166
未収配当金	187,388,237	367,920,304
差入委託証拠金	2,133,240,976	467,673,265
流動資産合計	258,237,975,206	268,188,486,572
資産合計	258,237,975,206	268,188,486,572
<b>負債の部</b>		

	2022年10月26日現在	2023年 4月26日現在
流動負債		
派生商品評価勘定	4,718,761	5,726,070
未払金	67,885,745	-
未払解約金	115,966,485	212,761,321
未払利息	2,591	987
流動負債合計	188,573,582	218,488,378
負債合計	188,573,582	218,488,378
純資産の部		
元本等		
元本	58,419,890,528	60,825,870,081
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	199,629,511,096	207,144,128,113
元本等合計	258,049,401,624	267,969,998,194
純資産合計	258,049,401,624	267,969,998,194
負債純資産合計	258,237,975,206	268,188,486,572

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	2022年10月26日現在	2023年 4月26日現在
1. 期首	2021年10月27日	2022年10月27日

	2022年10月26日現在	2023年 4月26日現在
期首元本額	61,697,952,086円	58,419,890,528円
期首からの追加設定元本額	10,737,486,481円	5,600,866,043円
期首からの一部解約元本額	14,015,548,039円	3,194,886,490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）	29,264,146,292円	31,356,989,387円
DCインデックスバランス（株式20）	122,426,648円	125,097,779円
DCインデックスバランス（株式40）	324,451,133円	339,700,119円
DCインデックスバランス（株式60）	642,259,230円	691,301,944円
DCインデックスバランス（株式80）	699,491,289円	756,412,561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	1,452,645,742円	1,430,789,437円
日興五大陸株式ファンド	3,657,320,915円	3,602,069,821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）	14,318,011円	14,006,450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）	90,192,400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）	5,927,380,507円	5,892,971,912円
グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	10,069,193,942円	10,600,506,984円
Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	- 円	2,109,588円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,821,226,129円	1,616,365,778円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	18,154,493円	18,321,546円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	51,457,152円	51,129,624円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	78,434,511円	79,926,647円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	76,968,989円	78,224,971円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,109,823,145円	4,083,749,068円
計	58,419,890,528円	60,825,870,081円
2. 受益権の総数	58,419,890,528口	60,825,870,081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10月26日現在	2023年 4月26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

	2022年10月26日現在	2023年 4月26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10月26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	4,791,256,524	-	4,904,733,499	113,476,975
	合計	4,791,256,524	-	4,904,733,499	113,476,975

（2023年 4月26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	2,578,985,064	-	2,666,946,696	87,961,632
	合計	2,578,985,064	-	2,666,946,696	87,961,632

（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10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,493,474,647	-	2,517,715,890	24,241,243
	米ドル	1,876,457,070	-	1,892,892,070	16,435,000
	ユーロ	617,017,577	-	624,823,820	7,806,243
	合計	2,493,474,647	-	2,517,715,890	24,241,243

(2023年 4月26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	1,643,306,565	-	1,662,384,460	19,077,895
	米ドル	1,329,375,590	-	1,340,993,510	11,617,920
	ユーロ	313,930,975	-	321,390,950	7,459,975
	売建	223,153,550	-	221,335,857	1,817,693
	米ドル	147,708,000	-	147,158,330	549,670
	ユーロ	25,256,900	-	24,948,639	308,261
	豪ドル	50,188,650	-	49,228,888	959,762
	合計	1,866,460,115	-	1,883,720,317	20,895,588

(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10月26日現在		2023年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	4.4171円	1口当たり純資産額	4.4055円
(1万口当たり純資産額)	(44,171円)	(1万口当たり純資産額)	(44,055円)

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

## 貸借対照表

(単位：円)

	2022年10月26日現在	2023年 4月26日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	68,117,184	86,342,661
コール・ローン	1,167,168,322	881,843,499
株式	16,378,481,161	18,289,116,910
投資証券	376,675,031	397,680,256
派生商品評価勘定	42,304,567	78,549,151
未収入金	4,150,883	883,010
未収配当金	12,390,369	25,691,874
差入委託証拠金	385,736,522	219,937,210
流動資産合計	18,435,024,039	19,980,044,571
資産合計	18,435,024,039	19,980,044,571
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	465,964,195	169,676,215
未払金	361,524,014	76,272,864
未払解約金	31,761,566	21,778,295
未払利息	1,898	712
流動負債合計	859,251,673	267,728,086
負債合計	859,251,673	267,728,086
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	8,061,313,419	8,551,361,050
剰余金		
剰余金又は欠損金 ( )	9,514,458,947	11,160,955,435
元本等合計	17,575,772,366	19,712,316,485
純資産合計	17,575,772,366	19,712,316,485
負債純資産合計	18,435,024,039	19,980,044,571

## 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。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券
--------------------	---



	<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10月26日現在	2023年 4月26日現在
1.	期首	2021年10月27日	2022年10月27日
	期首元本額	6,831,162,629円	8,061,313,419円
	期首からの追加設定元本額	1,837,477,067円	733,264,435円
	期首からの一部解約元本額	607,326,277円	243,216,804円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外株式ヘッジあり（DC専用）	6,553,093,225円	7,093,198,256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）	353,402,483円	333,433,312円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	36,886,955円	34,625,938円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	103,003,896円	96,406,551円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	155,066,780円	149,927,500円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	155,257,338円	149,539,178円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジあり）	704,602,742円	694,230,315円
	計	8,061,313,419円	8,551,361,050円
2.	受益権の総数	8,061,313,419口	8,551,361,050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10月26日現在	2023年 4月26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10月26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	935,552,532	-	947,120,951	11,568,419
合計		935,552,532	-	947,120,951	11,568,419

（2023年 4月26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	989,311,941	-	1,033,441,844	44,129,903
合計		989,311,941	-	1,033,441,844	44,129,903

（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10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	売建	16,648,919,002	-		17,084,147,049	435,228,047
	米ドル	12,465,226,169	-		12,786,033,348	320,807,179
	加ドル	597,933,013	-		610,981,665	13,048,652
	ユーロ	1,507,050,964	-		1,559,577,519	52,526,555
	英ポンド	697,749,185	-		721,896,836	24,147,651
	スイスフラン	488,239,847	-		497,278,664	9,038,817
	スウェーデンクローナ	159,512,748	-		162,456,634	2,943,886
	ノルウェークローネ	36,378,395	-		36,992,831	614,436
	デンマーククローネ	125,812,707	-		129,859,985	4,047,278
	豪ドル	372,019,375	-		375,132,165	3,112,790
	ニュージーランドドル	6,765,143	-		6,893,513	128,370
	香港ドル	111,683,012	-		113,846,601	2,163,589
	シンガポールドル	58,073,572	-		60,350,056	2,276,484
	イスラエルシケル	22,474,872	-		22,847,232	372,360
	合計		16,648,919,002	-		17,084,147,049

(2023年 4月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	売建	18,847,043,992	-		18,982,300,959	135,256,967
	米ドル	13,541,249,256	-		13,649,622,923	108,373,667
	加ドル	680,761,086	-		674,919,587	5,841,499
	ユーロ	2,058,303,499	-		2,080,214,358	21,910,859
	英ポンド	864,457,744	-		872,954,624	8,496,880
スイスフラン	591,491,433	-		597,961,229	6,469,796	

スウェーデンクローナ	192,034,611	-	193,644,668	1,610,057
ノルウェークローネ	39,031,683	-	38,083,184	948,499
デンマーククローネ	186,169,329	-	187,911,152	1,741,823
豪ドル	443,852,128	-	437,243,158	6,608,970
ニュージーランドドル	8,434,797	-	8,357,441	77,356
香港ドル	151,215,608	-	151,486,524	270,916
シンガポールドル	66,918,209	-	66,929,682	11,473
イスラエルシケル	23,124,609	-	22,972,429	152,180
合計	18,847,043,992	-	18,982,300,959	135,256,967

## (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10月26日現在		2023年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	2.1803円	1口当たり純資産額	2.3052円
(1万口当たり純資産額)	(21,803円)	(1万口当たり純資産額)	(23,052円)

## 日本債券インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

	2022年10月26日現在	2023年 4月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	38,142,474	73,540,007
国債証券	39,782,689,370	42,538,714,210
地方債証券	3,556,850,650	3,144,383,812
特殊債券	3,528,619,000	3,220,662,856
社債券	603,631,000	201,217,000

	2022年10月26日現在	2023年 4月26日現在
未収利息	81,611,164	82,459,015
前払費用	737,116	2,911,254
流動資産合計	47,592,280,774	49,263,888,154
資産合計	47,592,280,774	49,263,888,154
負債の部		
流動負債		
未払解約金	14,845,556	6,760,091
未払利息	62	59
流動負債合計	14,845,618	6,760,150
負債合計	14,845,618	6,760,150
純資産の部		
元本等		
元本	35,139,813,158	36,048,133,904
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	12,437,621,998	13,208,994,100
元本等合計	47,577,435,156	49,257,128,004
純資産合計	47,577,435,156	49,257,128,004
負債純資産合計	47,592,280,774	49,263,888,154

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	2022年10月26日現在	2023年 4月26日現在
1. 期首	2021年10月27日	2022年10月27日
期首元本額	34,479,945,047円	35,139,813,158円
期首からの追加設定元本額	4,247,701,412円	1,810,505,847円
期首からの一部解約元本額	3,587,833,301円	902,185,101円
元本の内訳		
DCインデックスバランス（株式20）	4,815,944,655円	5,118,008,195円

DCインデックスバランス(株式40)	4,446,314,480円	4,807,224,459円
DCインデックスバランス(株式60)	3,280,760,207円	3,644,137,180円
DCインデックスバランス(株式80)	537,618,854円	612,427,359円
インデックスファンド日本債券(DC専用)	2,209,280,459円	2,153,419,462円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	4,488,925,161円	4,478,668,281円
インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	1,615,057,133円	1,651,654,903円
Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	-円	3,623,581円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	3,381,046,243円	3,127,475,412円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,480,910,178円	1,518,556,730円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,423,718,543円	1,469,609,055円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	807,219,661円	837,385,290円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	119,043,599円	127,438,410円
インデックスファンド日本債券(1年決算型)	6,161,581,877円	6,103,293,039円
日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	372,392,108円	395,212,548円
計	35,139,813,158円	36,048,133,904円
2. 受益権の総数	35,139,813,158口	36,048,133,904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10月26日現在	2023年 4月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等による場合、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10月26日現在		2023年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	1.3539円	1口当たり純資産額	1.3664円
(1万口当たり純資産額)	(13,539円)	(1万口当たり純資産額)	(13,664円)

## 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

	2022年10月26日現在	2023年 4月26日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	117,967,036	190,286,274
コール・ローン	69,590,695	51,641,112
国債証券	150,981,343,458	148,698,271,659
派生商品評価勘定	7,491	99,940
未収入金	74,008,274	-
未収利息	1,091,775,551	1,118,227,377
前払費用	46,505,846	59,599,232
流動資産合計	152,381,198,351	150,118,125,594
資産合計	152,381,198,351	150,118,125,594
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	72,386	-
未払解約金	106,989,541	57,669,561
未払利息	113	41
流動負債合計	107,062,040	57,669,602
負債合計	107,062,040	57,669,602
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	57,575,300,165	58,247,056,213
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	94,698,836,146	91,813,399,779
元本等合計	152,274,136,311	150,060,455,992
純資産合計	152,274,136,311	150,060,455,992
負債純資産合計	152,381,198,351	150,118,125,594

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の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）金融商品取引所等の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10月26日現在	2023年 4月26日現在
1.	期首	2021年10月27日	2022年10月27日
	期首元本額	61,672,878,643円	57,575,300,165円
	期首からの追加設定元本額	3,281,227,327円	1,913,911,816円
	期首からの一部解約元本額	7,378,805,805円	1,242,155,768円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用）	16,794,261,878円	17,971,800,507円
	DCインデックスバランス（株式20）	389,007,488円	423,685,634円
	DCインデックスバランス（株式40）	515,032,949円	573,412,476円
	DCインデックスバランス（株式60）	682,975,875円	777,841,045円
	DCインデックスバランス（株式80）	560,018,801円	650,936,044円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	16,979,582,310円	16,547,338,573円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,355,333,711円	2,369,021,823円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	13,154,930,712円	12,736,662,162円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	835,698,012円	861,972,922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）	144,328,916円	145,733,134円
	財産3分法（適格機関投資家専用）	203,841,699円	258,339,113円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	173,659,188円	172,206,617円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	588,340,485円	558,696,766円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	58,797,064円	62,581,044円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	82,606,618円	87,091,784円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	84,495,854円	89,723,114円



		2022年10月26日現在	2023年 4月26日現在
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	62,113,777円	67,690,532円
	インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）1年決算型	3,607,947,517円	3,569,909,134円
	海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	302,327,311円	322,413,789円
	計	57,575,300,165円	58,247,056,213円
2.	受益権の総数	57,575,300,165口	58,247,056,213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10月26日現在	2023年 4月26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10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	54,085,544	-	54,150,439	64,895
	ユーロ	31,099,290	-	31,091,799	7,491
	英ポンド	10,623,129	-	10,678,865	55,736

	豪ドル	12,363,125	-	12,379,775	16,650
	合計	54,085,544	-	54,150,439	64,895

(2023年 4月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	26,856,000	-	26,756,060	99,940
	米ドル	26,856,000	-	26,756,060	99,940
	合計	26,856,000	-	26,756,060	99,940

## (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10月26日現在		2023年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	2.6448円	1口当たり純資産額	2.5763円
(1万口当たり純資産額)	(26,448円)	(1万口当たり純資産額)	(25,763円)

## 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

	2022年10月26日現在	2023年 4月26日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	92,356,279	82,616,884
コール・ローン	223,451,180	93,722,696
国債証券	21,165,170,810	21,712,468,977
派生商品評価勘定	4,960,875	27,715,756
未収入金	228,168,783	-

	2022年10月26日現在	2023年 4月26日現在
未収利息	209,204,786	187,920,422
前払費用	4,799,110	16,597,551
流動資産合計	21,928,111,823	22,121,042,286
資産合計	21,928,111,823	22,121,042,286
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	674,177,769	278,003,306
未払解約金	1,921,122	4,312,875
未払利息	363	75
流動負債合計	676,099,254	282,316,256
負債合計	676,099,254	282,316,256
純資産の部		
元本等		
元本	15,845,617,925	16,065,447,093
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,406,394,644	5,773,278,937
元本等合計	21,252,012,569	21,838,726,030
純資産合計	21,252,012,569	21,838,726,030
負債純資産合計	21,928,111,823	22,121,042,286

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2022年10月26日現在	2023年 4月26日現在
1.	期首	2021年10月27日	2022年10月27日
	期首元本額	15,760,382,772円	15,845,617,925円
	期首からの追加設定元本額	1,595,187,275円	953,779,781円
	期首からの一部解約元本額	1,509,952,122円	733,950,613円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外債券ヘッジあり（DC専用）	4,491,168,325円	5,246,585,277円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,362,007,124円	1,379,604,624円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	- 円	23,596,478円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	8,946,084,555円	8,383,021,350円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	115,914,160円	117,226,912円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	160,237,873円	163,466,995円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	162,007,452円	167,979,440円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	121,140,667円	128,158,468円
	インデックスファンド海外債券（ヘッジあり）1年決算型	487,057,769円	455,807,549円
	計	15,845,617,925円	16,065,447,093円
2.	受益権の総数	15,845,617,925口	16,065,447,093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10月26日現在	2023年 4月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1)有価証券            売買目的有価証券            重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引            「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品            短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1)有価証券            同左</p> <p>(2)デリバティブ取引            同左</p> <p>(3)上記以外の金融商品            同左</p>

	2022年10月26日現在	2023年 4月26日現在
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10月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	21,107,740,915	-	21,776,957,809	669,216,894
	米ドル	10,872,337,615	-	11,289,746,910	417,409,295
	加ドル	429,141,508	-	433,345,113	4,203,605
	メキシコペソ	161,999,208	-	167,119,751	5,120,543
	ユーロ	6,974,520,911	-	7,161,216,757	186,695,846
	英ポンド	869,964,569	-	903,363,190	33,398,621
	スウェーデンクローナ	76,983,624	-	78,332,605	1,348,981
	ノルウェークローネ	50,761,227	-	51,492,584	731,357
	デンマーククローネ	67,178,043	-	68,306,424	1,128,381
	ポーランドズロチ	102,244,184	-	107,104,600	4,860,416
	豪ドル	323,591,193	-	323,045,112	546,081
	シンガポールドル	85,265,557	-	86,746,219	1,480,662
	マレーシアリンギット	306,688,270	-	305,791,936	896,334
	中国元	677,750,740	-	688,090,904	10,340,164
	イスラエルシケル	109,314,266	-	113,255,704	3,941,438
合計		21,107,740,915	-	21,776,957,809	669,216,894

（2023年 4月26日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	21,568,169,463	-	21,818,457,013	250,287,550
	米ドル	10,592,125,613	-	10,727,979,993	135,854,380

加ドル	438,222,564	-	433,909,820	4,312,744
メキシコペソ	173,977,425	-	174,967,735	990,310
ユーロ	7,143,901,206	-	7,252,863,658	108,962,452
英ポンド	1,014,952,382	-	1,037,432,242	22,479,860
スウェーデンク ローナ	55,035,419	-	55,284,896	249,477
ノルウェークロー ネ	41,297,998	-	39,920,801	1,377,197
デンマーククロー ネ	65,771,201	-	66,285,535	514,334
ポーランドズロチ	110,569,831	-	116,900,821	6,330,990
豪ドル	350,802,153	-	344,249,177	6,552,976
ニュージーランド ドル	35,408,699	-	35,129,415	279,284
シンガポールドル	86,438,330	-	85,994,579	443,751
マレーシアリン ギット	301,299,432	-	298,408,588	2,890,844
中国元	1,062,101,084	-	1,054,725,351	7,375,733
イスラエルシケ ル	96,266,126	-	94,404,402	1,861,724
合計	21,568,169,463	-	21,818,457,013	250,287,550

## (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10月26日現在		2023年 4月26日現在	
1口当たり純資産額	1.3412円	1口当たり純資産額	1.3594円
(1万口当たり純資産額)	(13,412円)	(1万口当たり純資産額)	(13,594円)

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2023年 4月28日現在です。

### 【年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）】

#### 【純資産額計算書】

資産総額	4,524,836,350円
負債総額	3,988,311円
純資産総額（ - ）	4,520,848,039円
発行済口数	2,449,740,696口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8454円

（参考）

日本株式インデックスT O P I Xマザーファンド

#### 純資産額計算書

資産総額	47,661,010,368円
負債総額	228,560,415円
純資産総額（ - ）	47,432,449,953円
発行済口数	22,790,907,669口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0812円

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

#### 純資産額計算書

資産総額	272,302,826,453円
負債総額	47,546,924円
純資産総額（ - ）	272,255,279,529円
発行済口数	60,952,556,032口
1口当たり純資産額（ / ）	4.4667円

海外株式インデックスM S C I - K O K U S A I（ヘッジあり）マザーファンド

#### 純資産額計算書

資産総額	20,214,719,341円
負債総額	228,850,781円
純資産総額（ - ）	19,985,868,560円
発行済口数	8,583,936,465口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3283円

#### 日本債券インデックスマザーファンド

##### 純資産額計算書

資産総額	49,914,542,021円
負債総額	172,165,317円
純資産総額（ - ）	49,742,376,704円
発行済口数	36,184,955,175口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3747円

#### 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

##### 純資産額計算書

資産総額	150,348,690,749円
負債総額	258,231,117円
純資産総額（ - ）	150,090,459,632円
発行済口数	58,322,123,251口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5735円

#### 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

##### 純資産額計算書

資産総額	22,126,383,057円
負債総額	402,070,431円
純資産総額（ - ）	21,724,312,626円
発行済口数	16,083,786,043口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3507円

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### （1）名義書換

該当事項はありません。

##### （2）受益者に対する特典



該当事項はありません。

( 3 ) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

( 4 ) 受益証券の再発行

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

( 5 ) 受益権の再分割

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

( 6 ) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額

2023年4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4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4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4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	244,946
株式投資信託	799	209,711
単位型	313	9,639
追加型	486	200,072
公社債投資信託	56	35,234
単位型	43	1,065
追加型	13	34,169

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第64期事業年度（2022年4月1日から2023年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第63期 (2022年3月31日)		第64期 (2023年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		42,427		42,036
有価証券		170		1,025
前払費用		932		908
未収入金		96	4	410
未収委託者報酬		25,193		21,336
未収収益	3	1,048	3	589
関係会社短期貸付金		5,005		3,318
立替金		1,056		1,015
その他	2	998	2	1,233
流動資産合計		76,928		71,875
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	244	1	245
器具備品	1	153	1	122
有形固定資産合計		397		367
無形固定資産				
ソフトウェア		335		390
無形固定資産合計		335		390
投資その他の資産				
投資有価証券		23,969		23,274
関係会社株式		22,366		22,366
長期差入保証金		652		375
繰延税金資産		3,678		448

投資その他の資産合計	50,667	46,465
固定資産合計	51,399	47,224
資産合計	128,328	119,099

(単位：百万円)

	第63期 (2022年3月31日)	第64期 (2023年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	651	433
未払金	9,693	7,557
未払収益分配金	7	7
未払償還金	71	71
未払手数料	8,783	6,586
その他未払金	831	892
未払費用	3 5,572	3 4,227
未払法人税等	2,354	-
未払消費税等	4 3,669	-
賞与引当金	3,958	2,563
役員賞与引当金	5	218
訴訟損失引当金	7,847	-
その他	1,330	647
流動負債合計	35,083	15,648
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	1,395	1,424
賞与引当金	423	437
役員賞与引当金	-	16
その他	390	181
固定負債合計	2,209	2,059
負債合計	37,292	17,708
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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	68,901	79,307
利益剰余金合計	68,901	79,307
自己株式	2,067	2,067
株主資本合計	89,417	99,823
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	2,350	2,056
繰延ヘッジ損益	731	488
評価・換算差額等合計	1,618	1,567
純資産合計	91,035	101,391
負債純資産合計	128,328	119,099

## (2) 【損益計算書】

	(単位：百万円)	
	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	94,938	73,998
その他営業収益	4,743	3,479
営業収益合計	99,682	77,477
営業費用		
支払手数料	42,026	30,699
広告宣伝費	987	755
公告費	1	3
調査費	23,000	17,479
調査費	1,042	1,170
委託調査費	21,932	16,282
図書費	25	26
委託計算費	598	581
営業雑経費	1,014	948
通信費	143	139
印刷費	308	309
協会費	52	56
諸会費	13	16
その他	494	427
営業費用計	67,628	50,469
一般管理費		
給料	11,759	9,818
役員報酬	156	314
役員賞与引当金繰入額	5	234
給料・手当	7,229	6,544
賞与	143	147
賞与引当金繰入額	4,225	2,577
交際費	22	56
寄付金	29	24
旅費交通費	66	205
租税公課	429	433
不動産賃借料	937	938
退職給付費用	394	383
退職金	169	155
固定資産減価償却費	172	183
福利費	1,171	1,097
諸経費	3,888	4,291
一般管理費計	19,042	17,588
営業利益	13,010	9,420

	(単位：百万円)	
	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
受取利息	71	107
受取配当金	1 5,257	1 9,255
時効成立分配金・償還金	1	1
為替差益	1,548	-

その他		58	236
営業外収益合計		6,936	9,601
営業外費用			
支払利息		177	407
デリバティブ費用		49	389
有価証券償還損		-	6
時効成立後支払分配金・償還金		9	1
為替差損		-	342
その他		39	15
営業外費用合計		275	1,163
経常利益		19,672	17,858
特別利益			
投資有価証券売却益		253	427
子会社有償減資払戻益		1,445	-
訴訟損失引当金戻入額		-	4,481
特別利益合計		1,699	4,909
特別損失			
投資有価証券売却損		132	347
固定資産処分損		0	0
訴訟損失引当金繰入額		7,847	-
特別損失合計		7,980	347
税引前当期純利益		13,391	22,420
法人税、住民税及び事業税		3,435	1,340
法人税等還付税額	2	329	-
法人税等調整額		1,851	3,252
法人税等合計		1,255	4,593
当期純利益		12,136	17,826

### （ 3 ）【株主資本等変動計算書】

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						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	61,956	61,956	2,067	82,472
当期変動額							
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

第64期（自 2022年4月1日 至 2023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 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
当期変動額							
剰余金の配当				7,420	7,420		7,420
当期純利益				17,826	17,826		17,826
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	-	-	-	10,406	10,406	-	10,406
当期末残高	17,363	5,220	5,220	79,307	79,307	2,067	99,823

	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
当期変動額				
剰余金の配当				7,420
当期純利益				17,826
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	294	242	51	51
当期変動額合計	294	242	51	10,355
当期末残高	2,056	488	1,567	101,391

[注記事項]

（重要な会計方針）

項目	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023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</p> <p>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 border="0" data-bbox="518 757 1029 828"> <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義務の内容及び当該履行義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 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
6 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

## (会計方針の変更)

第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
<p>(時価の算定に関する会計基準の適用) 「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準第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。)を当事業年度の期首から適用し、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。本会計基準適用指針の適用が当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)

第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
<p>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、前事業年度において、「為替差損益」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事業年度よりヘッジ対象の損益区分と同一区分である投資有価証券売却益あるいは投資有価証券売却損として表示することとしております。</p>

## (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。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

## （貸借対照表関係）

第63期 (2022年3月31日)	第64期 (2023年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,390百万円</p> <p>器具備品 823百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>未収収益 233百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払費用 2,314百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>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。</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,437百万円</p> <p>器具備品 879百万円</p> <p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p> <p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>未収収益 263百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払費用 1,778百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未収入金」に含めて表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>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448百万円(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。</p>

## （損益計算書関係）

第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 5,194百万円</p> <p>2 法人税等還付税額</p> <p>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。</p>	<p>1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 9,241百万円</p> <p>3 訴訟損失引当金戻入額</p> <p>原告との和解が成立したことにより、前事業年度に計上した訴訟損失引当金から、和解金を控除した額を計上しております。</p>

## （株主資本等変動計算書関係）

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

第64期（自 2022年4月1日 至 2023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	
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	-	784,000	752,000	-

合計	2,440,000	-	1,391,800	969,000	-
----	-----------	---	-----------	---------	---

(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(2)217,000株及び2017年度ストックオプション(1)752,000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。

#### 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
2023年5月26日 取締役会	普通株式	利益剰余金	5,092	26.23	2023年3月31日	2023年6月27日

##### (リース取引関係)

第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		第64期 (自 2022年4月1日 至 2023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	899百万円
1年超	4,324百万円	1年超	3,425百万円
合計	5,236百万円	合計	4,324百万円

##### (金融商品関係)

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

##### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

営業債務である未払金(未払手数料)、未払費用に関しては、すべてが1年以内の支払期日でありま

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

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

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

#### 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

#### 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

### (1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

通貨関連 (*3)	-	1,066	-	1,066
デリバティブ取引計	262	1,066	-	1,329

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

## (2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

## (注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

### デリバティブ取引

#### 株式関連

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

#### 通貨関連

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

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

(単位:百万円)

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

## 3 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

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

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

### 1 金融商品の状況に関する事項

#### (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

#### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

#### 市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

#### 流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

## 2 金融商品の時価等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、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			
	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	6,238	18,045	-	24,283
資産計	6,238	18,045	-	24,283
デリバティブ取引(*1) 株式関連(*2)	246	-	-	246
通貨関連(*3)	-	352	-	352
デリバティブ取引計	246	352	-	599

- ( 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 246百万円は、貸借対照表上流動資産及び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 352百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。

(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

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	42,036			
未収委託者報酬	21,336			
未収収益	589			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	1,025	204	4,520	10
合計	64,987	204	4,520	10

(有価証券関係)

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

第64期(自 2022年4月1日 至 2023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	17,219	13,860	3,359
	小計	17,219	13,860	3,359
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	7,063	7,459	395
	小計	7,063	7,459	395
合計		24,283	21,319	2,963

(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	11,194	1,349	221
合計	11,194	1,349	221

(デリバティブ取引関係)

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。

第64期(2023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	10,970	-	246	246
合計		10,970	-	246	246

(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 シンガポール ドル	3,275	-	24	24
合計		3,275	-	24	24

(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		6,132	-	280
	豪ドル		105	-	0
	香港ドル		699	-	34
	人民元		5,822	-	1
	ユーロ		234	-	10
合計			12,994	-	328

## (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63期 (自 2021年 4月 1日 至 2022年 3月31日)	第64期 (自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日)
(単位：百万円)	(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	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	(1) 関連会社に対する投資の金額
5,312	5,326
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額
15,942	16,722
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額
1,964	2,185

## (退職給付関係)

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。

第64期(自 2022年 4月 1日 至 2023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	1,352
勤務費用	133
利息費用	4
数理計算上の差異の発生額	16
退職給付の支払額	107
退職給付債務の期末残高	1,366

## (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	1,366
未積立退職給付債務	1,366
未認識数理計算上の差異	58
貸借対照表に計上された負債の額	1,424

退職給付引当金	1,424
貸借対照表に計上された負債の額	1,424

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	133
利息費用	4
数理計算上の差異の費用処理額	1
確定給付制度に係る退職給付費用	136

## (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	0.6%
-----	------

## 3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、247百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

## (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日

権利確定条件	2013年10月7日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の2分の1、4分の1、4分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2018年7月15日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2013年10月7日から 2021年10月6日まで	2018年7月15日から 2026年7月31日まで

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

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

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

#### 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

##### (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2016年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31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 4,437,000株	普通株式 4,409,000株

付与日	2016年7月15日	2017年4月27日
権利確定条件	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。	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。
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	2018年7月15日から 2026年7月31日まで	2019年4月27日から 2027年4月30日まで

	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 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 4,422,000株
付与日	2018年4月27日
権利確定条件	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
権利行使期間	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

	2016年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2016年7月15日	2017年4月27日
権利確定前(株)		
期首	88,000	816,000
付与	0	0
失効	88,000	539,000
権利確定	0	0
権利未確定残	-	217,000
権利確定後(株)		



期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

2017年度ストックオプション(1)	
付与日	2018年4月27日
権利確定前(株)	
期首	1,536,000
付与	0
失効	784,000
権利確定	0
権利未確定残	752,000
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

2016年度ストックオプション(1)		2016年度ストックオプション(2)
付与日	2016年7月15日	2017年4月27日
権利行使価格(円)	558	553
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	0	0

2017年度ストックオプション(1)	
付与日	2018年4月27日
権利行使価格(円)	694
付与日における公正な評価単価(円) (注) 1	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 344百万円

(税効果会計関係)

第63期 (2022年3月31日)	第64期 (2023年3月31日)
----------------------	----------------------

1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	(単位：百万円)	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	(単位：百万円)
繰延税金資産		繰延税金資産	
賞与引当金	1,341	賞与引当金	918
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	52	関係会社株式評価損	52
退職給付引当金	427	退職給付引当金	436
固定資産減価償却費	87	固定資産減価償却費	83
繰延ヘッジ損益	322	繰延ヘッジ損益	215
訴訟損失引当金	2,403	その他	672
その他	1,039	繰延税金資産小計	2,478
繰延税金資産小計	5,772	評価性引当金	52
評価性引当金(注)	52	繰延税金資産合計	2,425
繰延税金資産合計	5,719		
		繰延税金負債	
繰延税金負債		その他有価証券評価差額金	1,028
その他有価証券評価差額金	1,092	その他	948
その他	948	繰延税金負債合計	1,977
繰延税金負債合計	2,041	繰延税金資産の純額	448
繰延税金資産の純額	3,678		
(注)関係会社株式評価損に係る繰延税金資産から控除した評価性引当金が、在外子会社の減資により1,377百万円減少しております。			
2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳		2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	30.6%	法定実効税率	30.6%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%	交際費等永久に損金に算入されない項目	1.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	10.9%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	12.0%
評価性引当金の減少	10.3%	その他	0.8%
その他	0.1%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	20.5%
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)
							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)

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	-	貸付金利息 (米国ドル貨建) (注1)	44 (USD 397千)	未収収益	10 (USD 86千)
							資金の返済 (円貨建) (注1)	577	関係会社 短期 貸付金	-
							貸付金利息 (円貨建) (注1)	3	未収収益	-
							資金の貸付 (シンガポール ドル貨建) (注1)	2,788 (SGD 33,000千)	関係会社 短期 貸付金	2,985 (SGD 33,000千)
							貸付金利息 (シンガポール ドル貨建) (注1)	23 (SGD 266千)	未収収益	23 (SGD 266千)
							減資 (注2)	9,149 (SGD 110,000千)	-	-
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注3)	アセットマネジメント業	直接 100.00	-	配当の受取	3,788 (USD 34,000千)	-	-

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠5,300百万円(若しくは5,300百万円相当額の外国通貨)、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- Nikko Asset Management International Limitedの行った110,000千株の減資により、当社は資金の払戻を受けております。
- Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2021年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場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

第64期(自 2022年4月1日 至 2023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 (シンガポールド ル貸建) (注1)	-	関係会社 短期 貸付金	3,318 (SGD 33,000千)
							貸付金利息 (シンガポールド ル貸建) (注1)	103 (SGD 1,043千)	未収収益	55 (SGD 551千)
							資金の返済 (米国ドル貸建) (注2)	2,019 (USD 16,500千)	関係会社 短期 貸付金	-
							貸付金利息 (米国ドル貸建) (注2)	3 (USD 26千)	未収収益	-
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	7,795 (USD 58,000千)	-	-

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠55百万シンガポールドル、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。
- 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あります（決定方針等を2022年8月26日付にて上記1に変更してあります）。
- 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2022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	34,828百万円
負債合計	5,655百万円
純資産合計	29,173百万円

営業収益	15,864百万円
税引前当期純利益	4,191百万円
当期純利益	3,159百万円

## （セグメント情報等）

## セグメント情報

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。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023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63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

## 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

## 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

## 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第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。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023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。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023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。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023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。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023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63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	468円88銭	522円22銭
1株当たり当期純利益金額	62円50銭	91円81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63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益(百万円)	12,136	17,826
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)	12,136	17,826

普通株式の期中平均株式数(千株)	194,152	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	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	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) 752,000株

### 3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第63期 (2022年3月31日)	第64期 (2023年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	91,035	101,391
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)	91,035	101,391
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)

当社は2022年12月21日付け株式売買契約書に基づき、星州子会社の日興アセットマネジメントインターナショナルが保有する関連会社AHAMアセットマネジメントBerhadの20%の株式を、2023年4月19日に13,412百万円で取得しました。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

#### 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2022年3月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	50,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## (2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2022年3月末現在)	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	
株式会社紀陽銀行	80,096百万円	
株式会社きらやか銀行	24,200百万円	
株式会社山陰合同銀行	20,705百万円	
株式会社肥後銀行	18,128百万円	
株式会社百十四銀行	37,322百万円	
株式会社広島銀行	54,573百万円	
株式会社福岡銀行	82,329百万円	
株式会社宮崎銀行	14,697百万円	
株式会社横浜銀行	215,628百万円	
第一生命保険株式会社	60,000百万円	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
信金中央金庫	690,998百万円 (出資の総額)	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

## (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

## (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

## (1) 受託会社

該当事項はありません。

## (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【その他】



- (1) 目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」という名称を使用します。
- (2) 目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。
- 委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日
  - ファンドの基本的性格など
  - 委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など
  - 委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など
  - 目論見書の使用開始日
- (3) 目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
- 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
- 投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。
- 投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。
- 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。
- 「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。
- 請求目論見書の入手方法(ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど)についての記載。
- 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。
- 「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。
- 商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。
- 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。
- 有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。
- 委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。
- (4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
- ファンドの取引に関して、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用がない旨の記載。
- 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
- ファンドは、大量の解約が発生し、短期間で解約資金の手当てをする必要が生じた場合や、主たる取引市場において市場が急変した場合などに、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがある旨。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金の申込みの受付を中止する可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性がある旨の記載。
- 分配金は、投資信託の純資産から支払われるので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がる旨。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合がある旨。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合がある旨の記載。

## 独立監査人の監査報告書

2023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 秋 宗 勝 彦  
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2023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。

## 独立監査人の監査報告書

2023年1月18日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会御中P w C あらた有限責任監査法人  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太  
業務執行社員

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）の2021年10月27日から2022年10月26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、年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）の2022年10月26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、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注)1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2023年5月31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」に掲げられている年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）の2022年10月27日から2023年4月26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、年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）の2023年4月26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10月27日から2023年4月26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、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。