

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年9月15日提出
【計算期間】	第36特定期間(自 2022年12月16日至 2023年6月15日)
【ファンド名】	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 ステファニー・ドゥルーズ
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

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

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

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

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

年12回(毎月)

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

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色



1 主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行ないます。

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



2 国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

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



3 原則として、毎月、安定した収益分配を行なうことをめざします。

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

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

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



「財産3分法」とは?

財産を「不動産・現金(預金)・株式」の3つの資産に分けて保管・運用することを「財産3分法」といいます。

先達の知恵として、財産を3つの資産に分散することで、安定性・流動性・収益性を保ちながら資産形成が行なわれてきました。

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



主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行います。

【世界の財産3分法ファンド】 基本組入比率

国内の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

東証REIT指数(配当込み)

国内の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

TOPIX(東証株価指数)配当込み

海外の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

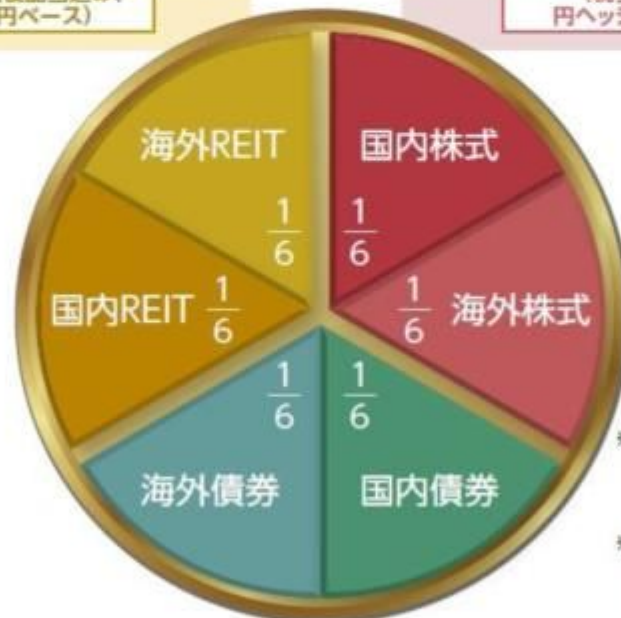
連動をめざす指数(インデックス)

S&P先進国REIT指数
(除く日本、税引後配当込み、
ヘッジなし・円ベース)

海外の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

MSCI-KOKUSAI インデックス
(税引後配当込み、
円ヘッジなし・円ベース)



※「基本組入比率」および「連動をめざす指数(インデックス)」は、2023年6月末現在のものであり、将来変更となる場合があります。
※市況動向および資金動向などにより左記のような運用ができない場合があります。

海外の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

FTSE世界国債インデックス
(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

国内の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

NOMURA-BPI総合

※海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンドのベンチマークが「税引後配当込み」の値動きであることを明確化するため、ベンチマーク表記を「S&P先進国REIT指数(除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース)」に変更いたしました。

※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、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。



国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

それぞれの資産は、異なる値動きをする傾向があります。

各資産の値動きの特徴

	REIT(不動産投資)	債券	株式
景気が良くなると	空室率や賃料水準が改善傾向 ↑ 価格は上がる傾向	金利が上がる傾向 ↓ 債券価格は下がる傾向	企業業績が改善する傾向 ↑ 株価は上がる傾向
景気が悪くなると	空室率や賃料水準が悪化の傾向 ↓ 価格は下がる傾向	金利が下がる傾向 ↑ 債券価格は上がる傾向	企業業績が悪化する傾向 ↓ 株価は下がる傾向

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

ご参考: 設定来のファンドと各資産の推移 (マザーファンドベース)

(2005年9月(設定月)~2023年6月, 月末値)



※基準価額は信託報酬(後述の「手続・手数料等」参照)控除後の値です。

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

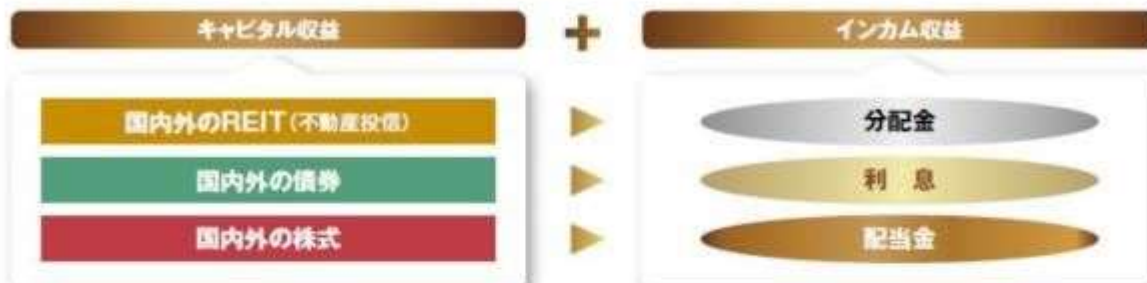
※各資産の値動きは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの値動きを示しています。

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



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

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



ご参考:各指数の利回り

(2023年6月末現在)



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

各指数(インデックス)の著作権などの権利について

- **東証REIT指数** 同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)に帰属します。また、JPXは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- **S&P先進国REIT指数** 同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービス シーズ エル エル シー(S&P)社に帰属します。また、S&P社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- **NOMURA-BPI総合** 同指数は、野村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** 同指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- **TOPIX(東証株価指数)** 同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)に帰属します。また、JPXは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- **MSCI-KOKUSAI インデックス** 同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

■ ファンドの仕組み

- 当ファンドは、主にマザーファンドに投資するファミリーファンド方式で運用を行いません。



(主な投資制限)

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

(分配方針)

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

収益分配金に関する留意事項

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

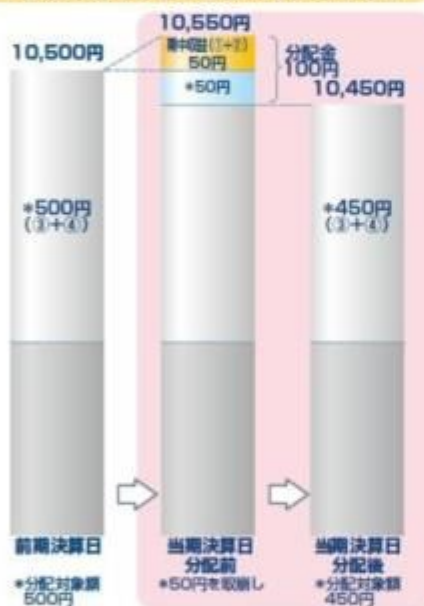
投資信託で分配金が支払われるイメージ



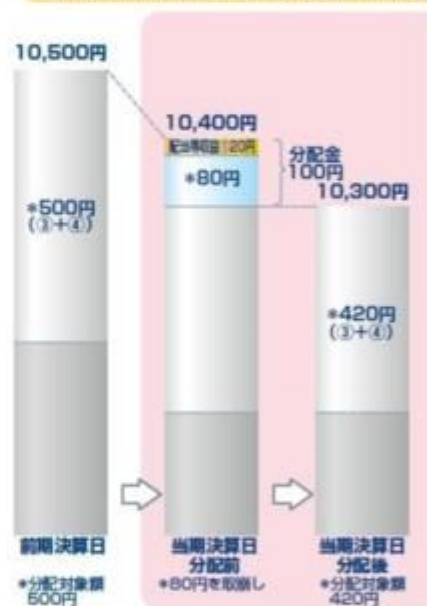
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算から基準価額が上昇した場合



前期決算から基準価額が下落した場合



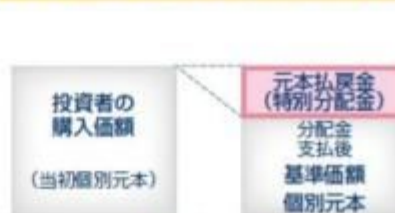
(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。
※ 上記はイメージであり、将来の分配金の支払いおよび金額ならびに基準価額について示唆、保証するものではありません。

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

信託金限度額

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

(2) 【ファンドの沿革】

2005年 9月29日

- ・ ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2006年3月9日

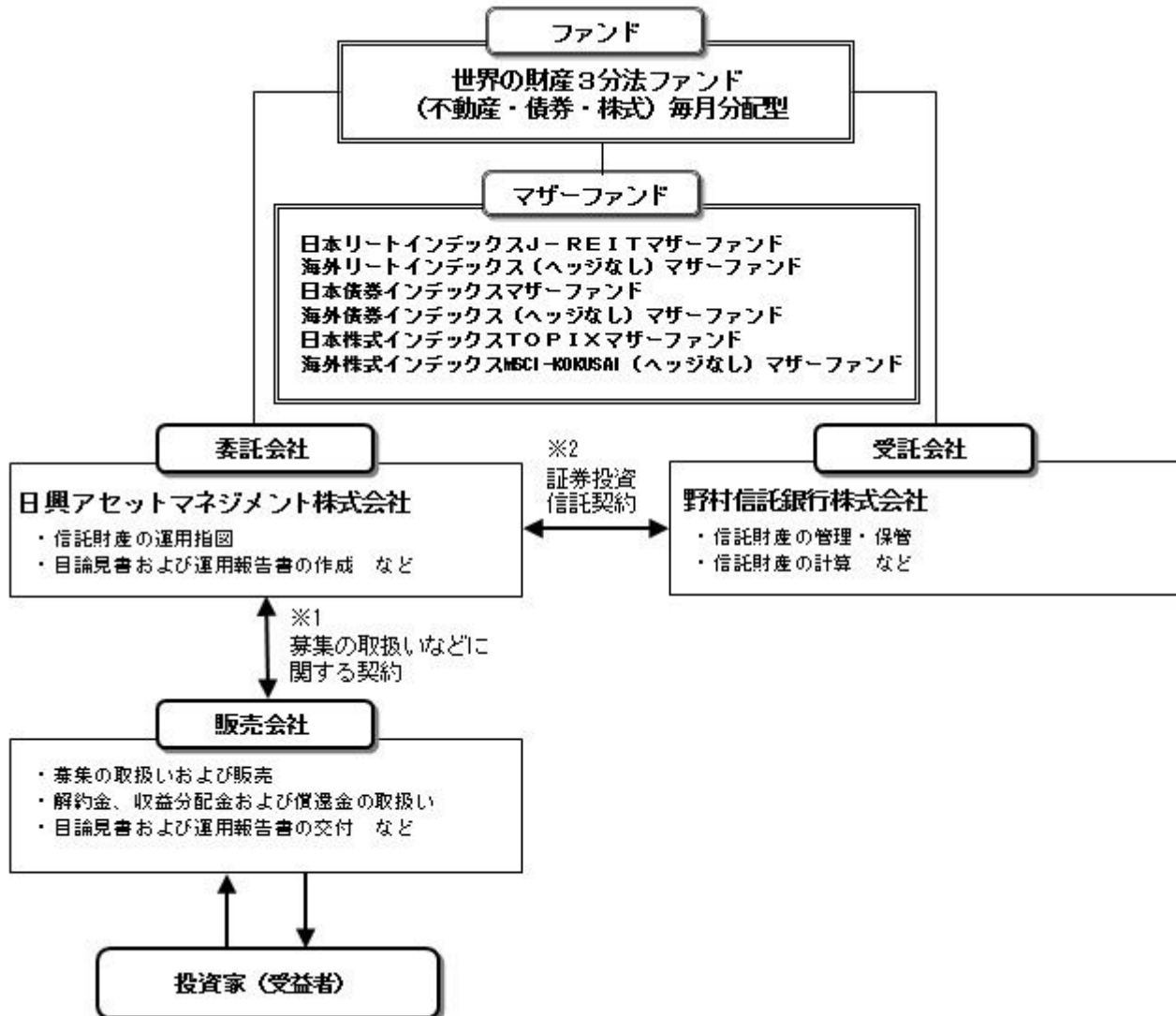
・ファンド名称変更

新名称：世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型

旧名称：世界の財産3分法ファンド（バランス重視）毎月分配型

（3）【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（2023年6月末現在）

1) 資本金

17,363百万円

2) 沿革

1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

3) 大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

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

（2）【投資対象】

<世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型>

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

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

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

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

次の取引ができます。

1) 外国為替予約取引

2) 資金の借入

<日本リートインデックスJ-REITマザーファンド>

わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1) 有価証券

2) 金銭債権

3) 約束手形

4) 為替手形

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

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

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

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

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

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

1) 預金

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

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

<海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

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

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1) 有価証券

2) 金銭債権

3) 約束手形

4) 為替手形

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

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

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

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

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

以外のもの

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

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

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

次の取引ができます。

- 1) 外国為替予約取引

<日本債券インデックスマザーファンド>

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

次の取引ができます。

- 1) 先物取引等
- 2) スワップ取引

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

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

- 6) 公社債の空売
- 7) 公社債の借入
- 8) 外国為替予約取引

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

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

< 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ます。)
- 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。))により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引

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

投資対象とする投資信託証券の概要

<日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド>

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

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

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

< 海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド >

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

その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2005年6月30日設定）
決算日	毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、NOMURA-BPI総合 [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 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。 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。 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。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は行ないません。 外貨建資産への投資は行ないません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（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） [*] 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"> 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。 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。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ただし、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。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は行ないません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入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。

<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 [*] 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"> 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。 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。 株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資は行ないません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

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

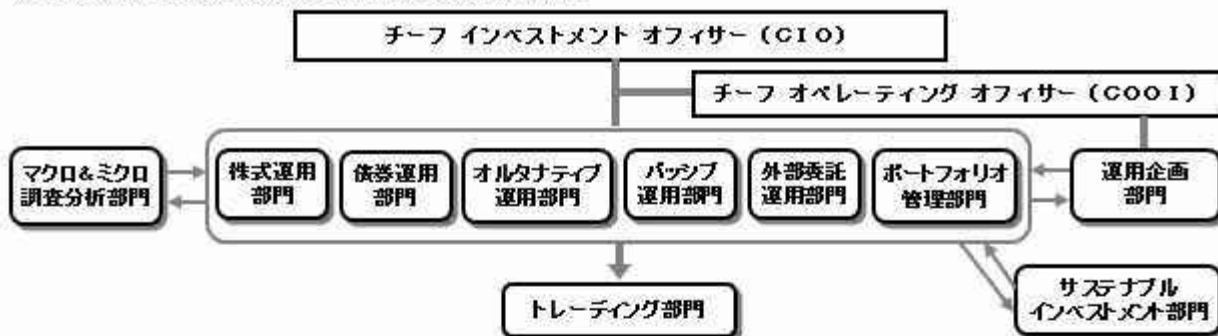
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%(1口当たり)
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限(2000年5月17日設定)
決算日	毎年10月26日(休業日の場合は翌営業日)

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

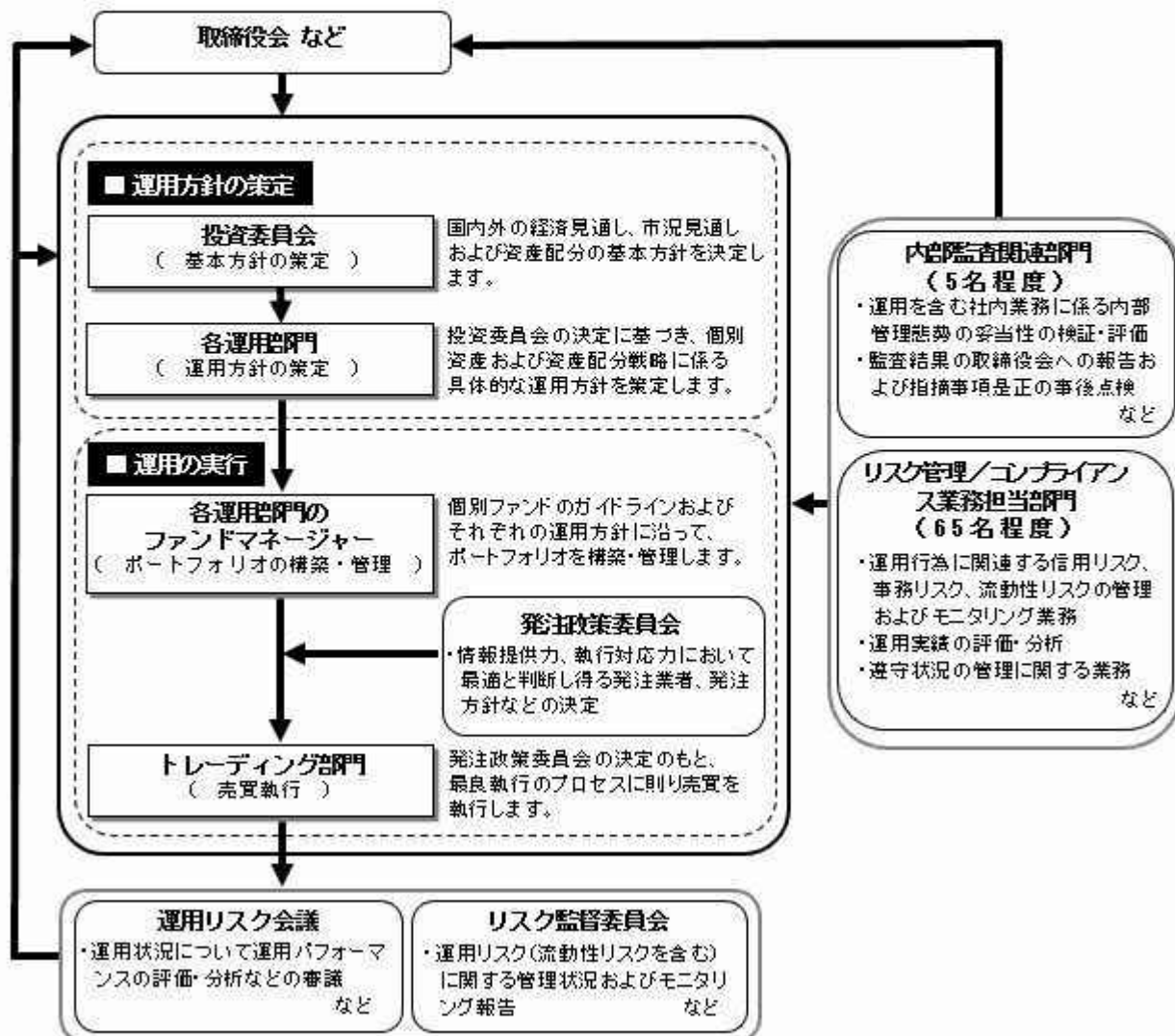
同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



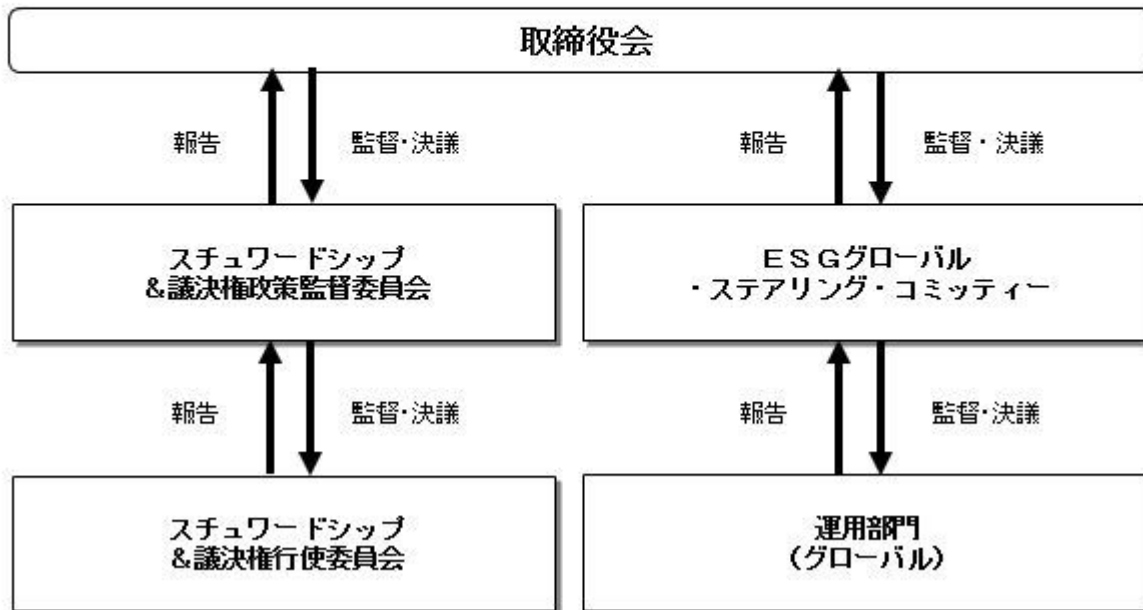
委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

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

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



上記体制は2023年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

収益分配金の支払い

<分配金再投資コース>

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

<分配金受取りコース>

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

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

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

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

ん。

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

<日本リートインデックスJ - REITマザーファンド>

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

<海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

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

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 3) 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。

<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。

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。

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

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

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

信用リスク

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

為替変動リスク

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

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

< その他の留意事項 >

・ システムリスク・市場リスクなどに関する事項

証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由によ

り基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

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

・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。

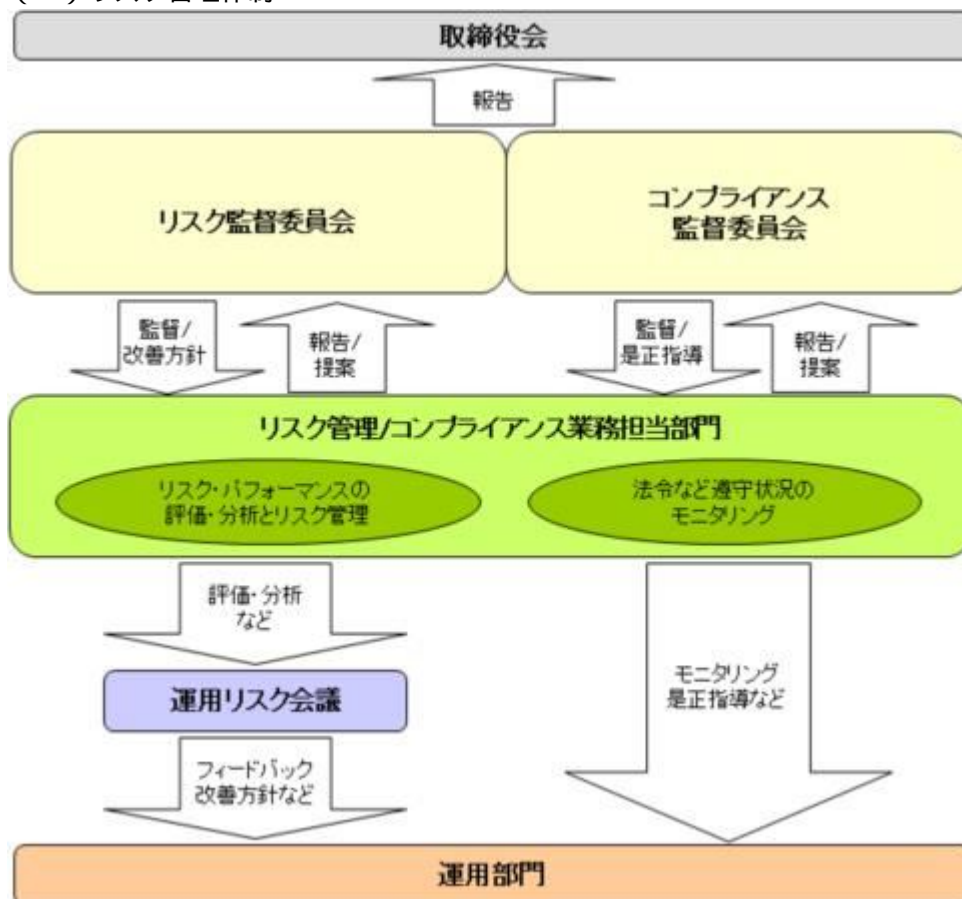
・運用制限や規制上の制限に関する事項

関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。

・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

（２）リスク管理体制



全社的なリスク管理

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。

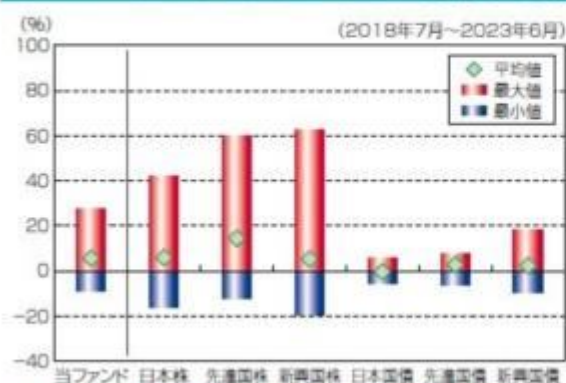
法令など遵守状況のモニタリング

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6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（参考情報）

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	5.6%	6.0%	14.5%	5.3%	-0.4%	2.8%	2.3%
最大値	27.4%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	7.9%	18.5%
最小値	-8.7%	-16.0%	-12.4%	-19.4%	-5.5%	-6.1%	-9.4%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

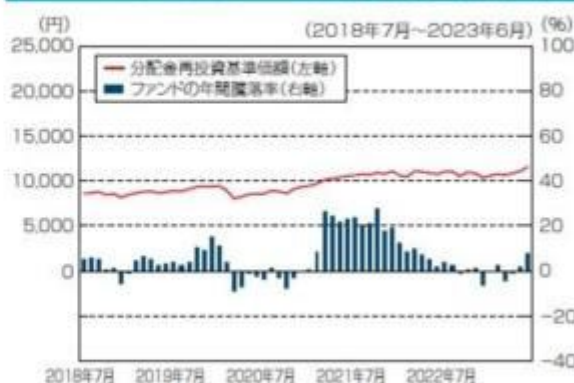
※上記は2018年7月から2023年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大-最小-平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株 ……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7月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

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

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

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

(2)【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

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

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

(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1.045%（税抜0.95%）の率を乗じて得た額とします。

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

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

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

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

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

格付の取得に要する費用。

ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

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

ファンドの主要投資対象の1つである「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」の運用の基本方針に規定する「S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジな

し・円ベース）」その他これに類する標章の使用料。

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

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料。

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

<投資対象とする投資信託証券に係る費用>

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）*については譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

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

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

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

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

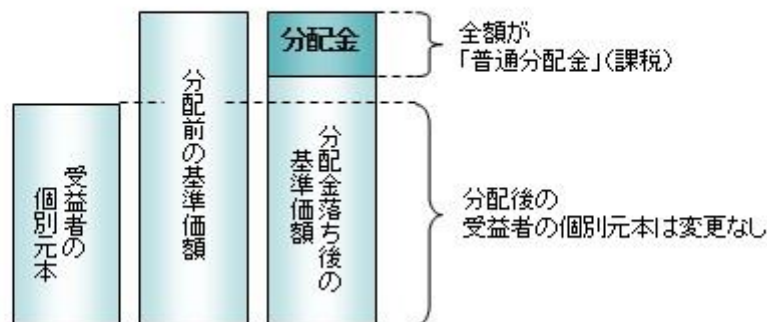
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

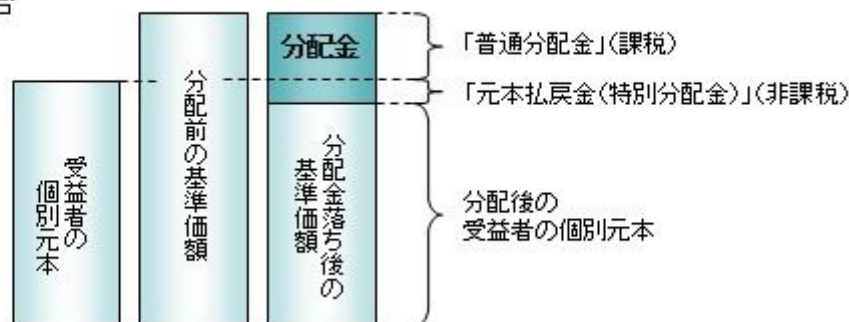
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は2023年9月15日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

以下の運用状況は2023年 6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	39,003,709,385	98.24
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		697,787,715	1.76
合計（純資産総額）		39,701,497,100	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	1,326,360,693	4.8778	6,469,722,189	5.0451	6,691,622,332	16.85
日本	親投資信託受益証券	海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	2,262,698,199	2.8616	6,474,937,167	2.9405	6,653,464,054	16.76
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	2,387,571,460	2.6578	6,345,687,427	2.7452	6,554,361,171	16.51
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	2,814,501,445	2.3221	6,535,553,806	2.3197	6,528,799,001	16.44
日本	親投資信託受益証券	日本リートインデックスJ - REITマザーファンド	2,493,894,999	2.5260	6,299,578,767	2.5243	6,295,339,145	15.86
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	4,563,048,523	1.3746	6,272,366,499	1.3763	6,280,123,682	15.82

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	98.24
合計	98.24

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

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17特定期間末（2013年12月16日）	55,238	55,317	0.6910	0.6920
第18特定期間末（2014年 6月16日）	52,281	52,353	0.7290	0.7300
第19特定期間末（2014年12月15日）	52,113	52,176	0.8237	0.8247
第20特定期間末（2015年 6月15日）	48,576	48,632	0.8576	0.8586
第21特定期間末（2015年12月15日）	42,709	42,762	0.8131	0.8141
第22特定期間末（2016年 6月15日）	39,155	39,206	0.7769	0.7779
第23特定期間末（2016年12月15日）	39,745	39,793	0.8277	0.8287
第24特定期間末（2017年 6月15日）	36,443	36,487	0.8278	0.8288
第25特定期間末（2017年12月15日）	34,568	34,608	0.8629	0.8639
第26特定期間末（2018年 6月15日）	32,895	32,934	0.8573	0.8583
第27特定期間末（2018年12月17日）	31,635	31,672	0.8421	0.8431
第28特定期間末（2019年 6月17日）	31,844	31,881	0.8638	0.8648
第29特定期間末（2019年12月16日）	32,740	32,776	0.9108	0.9118
第30特定期間末（2020年 6月15日）	29,571	29,607	0.8310	0.8320
第31特定期間末（2020年12月15日）	31,006	31,041	0.8907	0.8917
第32特定期間末（2021年 6月15日）	34,941	34,975	1.0217	1.0227
第33特定期間末（2021年12月15日）	36,248	36,283	1.0365	1.0375
第34特定期間末（2022年 6月15日）	35,426	35,462	0.9906	0.9916
第35特定期間末（2022年12月15日）	37,443	37,480	1.0208	1.0218
第36特定期間末（2023年 6月15日）	39,363	39,400	1.0678	1.0688
2022年 6月末日	36,719		1.0198	
7月末日	37,975		1.0470	
8月末日	38,024		1.0442	
9月末日	36,404		0.9956	
10月末日	38,079		1.0386	
11月末日	37,645		1.0267	
12月末日	36,013		0.9801	
2023年 1月末日	36,744		0.9981	
2月末日	37,302		1.0118	
3月末日	36,854		1.0002	
4月末日	37,744		1.0209	
5月末日	38,502		1.0411	
6月末日	39,701		1.0839	

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

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	0.0060
第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	0.0060
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	0.0060
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	0.0060
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	0.0060
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	0.0060
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	0.0060
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	0.0060
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	0.0060
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	0.0060
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	0.0060
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	0.0060
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	0.0060
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	0.0060
第31特定期間	2020年 6月16日～2020年12月15日	0.0060
第32特定期間	2020年12月16日～2021年 6月15日	0.0060
第33特定期間	2021年 6月16日～2021年12月15日	0.0060
第34特定期間	2021年12月16日～2022年 6月15日	0.0060
第35特定期間	2022年 6月16日～2022年12月15日	0.0060
第36特定期間	2022年12月16日～2023年 6月15日	0.0060

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	9.28
第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	6.37
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	13.81
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	4.84
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	4.49
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	3.71
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	7.31
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	0.74
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	4.96
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	0.05
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	1.07
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	3.29
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	6.14

第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	8.10
第31特定期間	2020年 6月16日～2020年12月15日	7.91
第32特定期間	2020年12月16日～2021年 6月15日	15.38
第33特定期間	2021年 6月16日～2021年12月15日	2.04
第34特定期間	2021年12月16日～2022年 6月15日	3.85
第35特定期間	2022年 6月16日～2022年12月15日	3.65
第36特定期間	2022年12月16日～2023年 6月15日	5.19

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第17特定期間	2013年 6月18日～2013年12月16日	381,538,280	11,009,976,725
第18特定期間	2013年12月17日～2014年 6月16日	548,220,875	8,763,039,619
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	848,123,250	9,300,633,130
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	1,077,889,968	7,702,577,651
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	822,766,387	4,936,873,357
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	559,222,913	2,691,021,175
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	788,561,373	3,167,580,874
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	535,316,706	4,530,717,126
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	675,282,245	4,636,099,733
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	900,474,282	2,591,559,940
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	1,657,593,437	2,463,297,514
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	1,553,018,779	2,252,941,131
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	1,375,802,750	2,295,826,563
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	1,727,094,985	2,087,383,750
第31特定期間	2020年 6月16日～2020年12月15日	1,154,110,398	1,927,320,256
第32特定期間	2020年12月16日～2021年 6月15日	2,277,192,099	2,890,774,812
第33特定期間	2021年 6月16日～2021年12月15日	2,642,144,579	1,866,998,446
第34特定期間	2021年12月16日～2022年 6月15日	2,197,942,225	1,407,308,080
第35特定期間	2022年 6月16日～2022年12月15日	2,127,865,577	1,212,529,506
第36特定期間	2022年12月16日～2023年 6月15日	1,533,696,702	1,347,087,591

（参考）

日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド

以下の運用状況は2023年 6月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	59,774,707,900	98.96
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		628,310,098	1.04
合計(純資産総額)		60,403,017,998	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	6,631	564,048.86	3,740,208,000	566,000	3,753,146,000	6.21
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	5,829	541,050.6	3,153,784,000	548,000	3,194,292,000	5.29
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	18,383	161,512.65	2,969,087,100	166,100	3,053,416,300	5.06
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	9,884	297,067.29	2,936,213,100	289,300	2,859,441,200	4.73
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	28,682	97,391.22	2,793,375,200	96,300	2,762,076,600	4.57
日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	19,165	145,596.43	2,790,355,600	142,100	2,723,346,500	4.51
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	8,569	287,253.21	2,461,472,800	276,200	2,366,757,800	3.92
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	11,326	180,490.29	2,044,233,100	177,400	2,009,232,400	3.33
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,684	359,479.41	2,043,281,000	344,000	1,955,296,000	3.24
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	12,716	147,296.22	1,873,018,800	145,400	1,848,906,400	3.06
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	17,082	79,812.86	1,363,363,400	83,900	1,433,179,800	2.37
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	25,020	56,803.91	1,421,234,000	57,200	1,431,144,000	2.37
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	3,888	352,012.47	1,368,624,500	348,500	1,354,968,000	2.24
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	18,332	72,603.08	1,330,959,700	73,500	1,347,402,000	2.23
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	8,673	156,890.08	1,360,707,700	151,600	1,314,826,800	2.18
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,963	663,011.71	1,301,492,000	649,000	1,273,987,000	2.11
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,987	406,000	1,212,722,000	402,500	1,202,267,500	1.99
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	3,833	319,992.95	1,226,533,000	312,500	1,197,812,500	1.98
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	3,308	324,528.71	1,073,541,000	346,500	1,146,222,000	1.90
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,246	513,953.69	1,154,340,000	500,000	1,123,000,000	1.86
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	6,959	161,478.01	1,123,725,500	151,100	1,051,504,900	1.74
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	6,526	155,993.94	1,018,016,500	155,400	1,014,140,400	1.68

日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,109	489,467.99	1,032,288,000	468,000	987,012,000	1.63
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	6,685	151,083.38	1,009,992,400	147,400	985,369,000	1.63
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	4,169	215,822.85	899,765,500	234,300	976,796,700	1.62
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,718	350,509.19	952,684,000	345,000	937,710,000	1.55
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	7,877	113,901.9	897,205,300	114,400	901,128,800	1.49
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,318	156,001.35	829,615,200	161,000	856,198,000	1.42
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,953	423,465.18	827,027,500	413,000	806,589,000	1.34
日本	投資証券	森トラストリート投資法人 投資証券	10,580	70,801.9	749,084,200	72,000	761,760,000	1.26

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.96
合計	98.96

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2023年 6月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	44,700,628,439	77.45
	カナダ	963,802,476	1.67
	ドイツ	26,171,787	0.05
	イタリア	5,886,422	0.01
	フランス	975,594,653	1.69
	オランダ	105,495,948	0.18
	スペイン	224,058,153	0.39
	ベルギー	550,149,795	0.95
	アイルランド	22,486,220	0.04
	イギリス	2,481,859,794	4.30

	オーストラリア	3,744,977,282	6.49
	ニュージーランド	160,368,504	0.28
	香港	773,631,057	1.34
	シンガポール	2,097,223,213	3.63
	韓国	133,742,215	0.23
	イスラエル	73,621,452	0.13
	ガーンジー	114,713,075	0.20
	小計	57,154,410,485	99.03
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		560,895,513	0.97
合計（純資産総額）		57,715,305,998	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	287,059	17,727.92	5,088,961,083	17,616.28	5,056,913,156	8.76
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	29,078	112,480.34	3,270,703,391	112,661.57	3,275,973,415	5.68
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	49,197	41,194.55	2,026,648,710	41,842.66	2,058,533,546	3.57
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	209,397	8,871.93	1,857,757,222	8,731.29	1,828,307,565	3.17
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	154,497	11,815.23	1,825,418,377	11,655.74	1,800,777,805	3.12
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	101,656	16,079.39	1,634,566,572	16,639.05	1,691,459,511	2.93
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	90,585	15,293.54	1,385,365,791	16,221.48	1,469,422,874	2.55
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	312,108	4,694.77	1,465,277,210	4,549.78	1,420,024,671	2.46
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	44,168	27,571.29	1,217,769,108	27,263.91	1,204,192,801	2.09
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	532,185	1,885.71	1,003,547,268	1,926.89	1,025,463,232	1.78
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	106,083	9,622.98	1,020,835,255	9,485.24	1,006,223,330	1.74
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	41,979	20,779.96	872,322,226	21,454.17	900,624,615	1.56
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	180,772	4,935.45	892,192,903	4,948.50	894,551,815	1.55
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	124,347	6,715.93	835,106,593	6,904.42	858,544,386	1.49
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	48,932	17,677.18	864,979,811	16,437.51	804,320,548	1.39
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	36,279	22,241.46	806,898,145	22,048.62	799,902,222	1.39
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	90,640	8,223.83	745,408,205	8,142.63	738,048,745	1.28
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	38,688	19,396.76	750,421,936	18,641.36	721,197,102	1.25
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	19,970	33,839.21	675,769,145	33,792.81	674,842,601	1.17
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	66,580	10,137.70	674,968,119	9,794.07	652,089,480	1.13
香港	投資証券	LINK REIT	794,480	864.87	687,125,890	807.52	641,562,462	1.11
アメリカ	投資証券	UDR INC	96,339	6,250.51	602,168,740	6,217.17	598,956,056	1.04
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	81,721	7,266.89	593,858,236	7,040.71	575,374,221	1.00
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	192,437	2,798.30	538,497,804	2,856.30	549,658,380	0.95
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	221,057	2,531.52	559,611,410	2,419.88	534,932,098	0.93
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	54,467	9,807.12	534,164,602	9,624.43	524,214,167	0.91
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	33,197	16,204.08	537,926,923	15,747.36	522,765,239	0.91

アメリカ	投資証券	LIFE STORAGE INC	26,438	18,554.37	490,540,442	19,177.82	507,023,398	0.88
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	97,695	5,050.00	493,359,916	5,115.24	499,734,075	0.87
イギリス	投資証券	SEGR0 PLC	380,609	1,381.27	525,724,745	1,300.77	495,086,482	0.86

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	99.03
合計	99.03

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

日本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 6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	44,880,372,040	86.92
地方債証券	日本	2,844,520,775	5.51
特殊債券	日本	2,824,387,000	5.47
社債券	日本	1,002,076,000	1.94
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		82,401,917	0.16
合計（純資産総額）		51,633,757,732	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	100.95	706,657,000	0.300	2025/12/20	1.37
日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	700,000,000	100.30	702,136,000	100.51	703,605,000	0.100	2026/9/20	1.36
日本	国債証券	第347回利付国債（10年）	680,000,000	100.14	681,005,400	100.49	683,372,800	0.100	2027/6/20	1.32

日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	660,000,000	100.23	661,547,700	100.52	663,432,000	0.100	2026/12/20	1.28
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	660,000,000	100.17	661,122,000	100.52	663,432,000	0.100	2027/3/20	1.28
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	645,000,000	100.33	647,173,700	100.50	648,250,800	0.100	2026/6/20	1.26
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	630,000,000	100.36	632,294,900	100.48	633,080,700	0.100	2026/3/20	1.23
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	626,677,400	0.400	2025/9/20	1.21
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	590,000,000	99.94	589,646,000	100.35	592,100,400	0.100	2027/12/20	1.15
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	590,000,000	98.91	583,569,000	99.60	587,645,900	0.100	2030/3/20	1.14
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	580,000,000	98.53	571,485,600	99.25	575,667,400	0.100	2030/9/20	1.11
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	570,000,000	101.11	576,338,400	100.95	575,437,800	0.400	2025/6/20	1.11
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	560,000,000	99.12	555,072,000	99.71	558,381,600	0.100	2029/12/20	1.08
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	540,000,000	99.83	539,082,000	100.23	541,269,000	0.100	2028/3/20	1.05
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	535,000,000	99.74	533,646,450	100.17	535,925,550	0.100	2028/6/20	1.04
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	520,000,000	99.64	518,128,000	100.10	520,535,600	0.100	2028/9/20	1.01
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	500,000,000	100.04	500,240,000	100.44	502,210,000	0.100	2027/9/20	0.97
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	490,000,000	101.00	494,929,400	100.75	493,699,500	0.500	2024/9/20	0.96
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	500,000,000	97.74	488,735,500	98.67	493,370,000	0.100	2031/6/20	0.96
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	500,000,000	97.55	487,764,000	98.51	492,570,000	0.100	2031/9/20	0.95
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	460,000,000	97.91	450,395,500	99.08	455,777,200	0.100	2030/12/20	0.88
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	420,000,000	98.68	414,493,800	99.44	417,685,800	0.100	2030/6/20	0.81
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	400,000,000	99.54	398,172,000	100.02	400,108,000	0.100	2028/12/20	0.77
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	400,000,000	100.00	400,000,000	99.02	396,096,000	0.200	2032/3/20	0.77
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	400,000,000	98.36	393,448,000	98.86	395,460,000	0.100	2031/3/20	0.77
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	390,000,000	100.62	392,433,000	101.23	394,816,500	0.500	2032/12/20	0.76
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	390,000,000	101.01	393,970,200	100.84	393,276,000	0.400	2025/3/20	0.76
日本	国債証券	第117回利付国債(20年)	343,000,000	113.55	389,493,650	112.95	387,445,940	2.100	2030/3/20	0.75
日本	国債証券	第144回利付国債(20年)	330,000,000	110.86	365,838,000	110.49	364,617,000	1.500	2033/3/20	0.71
日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	318,000,000	112.91	359,053,800	112.25	356,964,540	1.700	2032/9/20	0.69

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	86.92
地方債証券	5.51
特殊債券	5.47

社債券	1.94
合 計	99.84

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 6月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	78,219,056,647	48.73
	カナダ	3,262,885,830	2.03
	メキシコ	1,567,107,542	0.98
	ドイツ	10,477,039,423	6.53
	イタリア	12,115,939,873	7.55
	フランス	13,146,375,015	8.19
	オランダ	2,521,594,333	1.57
	スペイン	8,051,689,645	5.02
	ベルギー	3,049,514,609	1.90
	オーストリア	2,014,938,832	1.26
	フィンランド	838,587,296	0.52
	アイルランド	947,541,520	0.59
	イギリス	7,663,752,153	4.77
	スウェーデン	314,444,710	0.20
	ノルウェー	251,457,351	0.16
	デンマーク	501,752,394	0.31
	ポーランド	780,088,372	0.49
	オーストラリア	2,419,968,199	1.51
	ニュージーランド	333,268,749	0.21
	シンガポール	712,047,684	0.44
マレーシア	860,391,223	0.54	
中国	8,626,316,801	5.37	
イスラエル	469,490,020	0.29	
小計		159,145,248,221	99.15

コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		1,361,846,838	0.85
合計(純資産総額)		160,507,095,059	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		84,056,036	0.05
	売建		69,542,544	0.04

(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	12,320.27	997,941,990	12,428.64	1,006,720,223	0.500	2027/8/31	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,190,000	12,734.31	915,596,994	12,696.81	912,901,324	1.750	2029/11/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	14,986.12	915,651,967	14,770.85	902,499,317	4.125	2032/11/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	12,093.07	846,515,053	12,394.66	867,626,389	0.375	2027/7/31	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,930,000	11,937.02	827,235,950	12,294.98	852,042,257	1.625	2031/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,130,000	11,468.70	817,718,952	11,868.22	846,204,402	1.250	2031/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	13,421.76	805,306,173	13,658.22	819,493,676	0.375	2024/9/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,830,000	11,520.47	786,848,436	11,921.74	814,255,255	1.375	2031/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,740,000	13,630.52	782,392,284	13,586.86	779,886,084	1.125	2025/2/28	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,240,000	12,006.62	749,213,206	12,381.91	772,631,778	1.875	2032/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,190,000	13,918.41	722,365,699	13,931.21	723,030,153	2.250	2024/10/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	11,363.59	694,315,425	11,704.54	715,147,651	0.875	2030/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,957.26	697,863,490	13,973.12	698,656,404	3.000	2025/7/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,930.36	696,518,367	13,945.65	697,282,965	2.875	2025/6/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,867.50	693,375,027	13,939.71	696,985,619	3.250	2027/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,980,000	13,693.02	681,912,433	13,855.04	689,981,019	3.250	2029/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,457.45	672,872,535	13,710.05	685,502,527	0.375	2024/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	13,071.88	666,666,002	13,249.31	675,714,847	2.750	2032/8/15	0.42
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	2,033.75	650,801,351	2,036.00	651,520,005	3.020	2025/10/22	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	13,515.78	635,241,969	13,799.04	648,555,229	0.250	2024/6/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,620,000	13,950.75	644,524,953	14,021.55	647,795,722	2.375	2024/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,650,000	13,869.76	644,944,120	13,920.17	647,288,028	2.250	2024/11/15	0.40
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	2,024.49	647,839,229	2,022.75	647,280,221	2.940	2024/10/17	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	13,183.32	638,073,123	13,370.79	647,146,554	1.625	2026/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,730,000	13,560.52	641,413,051	13,675.78	646,864,647	2.000	2025/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,640,000	13,813.12	640,929,198	13,940.56	646,842,077	1.750	2024/7/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	13,114.60	629,501,136	13,403.07	643,347,813	2.875	2032/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	12,971.49	623,928,964	13,201.73	635,003,496	2.375	2029/5/15	0.40

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,530,000	13,715.71	621,321,850	13,797.83	625,042,031	2.000	2025/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,930,000	12,367.64	609,724,997	12,666.80	624,473,344	1.500	2028/11/30	0.39

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.15
合計	99.15

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	580,000.00	83,682,400	84,056,036	0.05
	米ドル	売建	480,000.00	69,528,000	69,542,544	0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2023年6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	49,944,411,190	98.46
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		781,163,310	1.54
合計(純資産総額)		50,725,574,500	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	777,920,000	1.53

(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	838,200	2,015.25	1,689,187,743	2,308.50	1,934,984,700	3.81
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	108,000	9,932.66	1,072,727,820	12,965.00	1,400,220,000	2.76
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,300	51,482.27	787,678,800	67,850.00	1,038,105,000	2.05
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	941,600	714.82	673,078,600	1,065.00	1,002,804,000	1.98
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4,905,000	163.92	804,065,544	170.50	836,302,500	1.65
日本	株式	三菱商事	卸売業	99,400	4,116.71	409,200,974	6,930.00	688,842,000	1.36
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	109,900	4,251.66	467,257,838	6,159.00	676,874,100	1.33
日本	株式	日立製作所	電気機器	75,000	6,562.19	492,164,566	8,896.00	667,200,000	1.32
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	32,300	13,130.33	424,109,659	20,560.00	664,088,000	1.31
日本	株式	任天堂	その他製品	96,400	6,054.13	583,618,674	6,542.00	630,648,800	1.24
日本	株式	三井物産	卸売業	114,600	3,322.02	380,703,905	5,411.00	620,100,600	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	135,500	3,839.66	520,274,062	4,527.00	613,408,500	1.21
日本	株式	第一三共	医薬品	133,400	4,542.97	606,032,344	4,550.00	606,970,000	1.20
日本	株式	信越化学工業	化学	127,100	3,105.35	394,690,445	4,768.00	606,012,800	1.19
日本	株式	HOYA	精密機器	32,600	14,670.90	478,271,340	17,075.00	556,645,000	1.10
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	97,300	3,916.85	381,110,176	5,687.00	553,345,100	1.09
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	124,100	3,360.01	416,977,877	4,341.00	538,718,100	1.06
日本	株式	ダイキン工業	機械	18,400	21,880.80	402,606,720	29,265.00	538,476,000	1.06
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	116,200	4,601.61	534,708,080	4,563.00	530,220,600	1.05
日本	株式	KDDI	情報・通信業	118,300	4,395.19	519,951,529	4,450.00	526,435,000	1.04
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	75,500	6,019.48	454,470,972	6,773.00	511,361,500	1.01
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	148,600	2,662.16	395,597,152	3,315.00	492,609,000	0.97
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	217,400	1,635.12	355,476,532	2,199.00	478,062,600	0.94
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	83,100	3,851.26	320,040,278	5,601.00	465,443,100	0.92
日本	株式	S M C	機械	5,000	58,451.15	292,255,750	79,480.00	397,400,000	0.78
日本	株式	村田製作所	電気機器	46,300	7,177.81	332,333,036	8,236.00	381,326,800	0.75
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	246,100	1,472.62	362,413,662	1,540.00	378,994,000	0.75
日本	株式	ファナック	電気機器	74,900	4,106.98	307,613,052	5,032.00	376,896,800	0.74
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	55,700	5,601.18	311,985,960	6,205.00	345,618,500	0.68
日本	株式	三菱電機	電気機器	159,400	1,397.79	222,809,252	2,027.00	323,103,800	0.64

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	0.08
		鉱業	0.29
		建設業	1.98
		食料品	3.34

繊維製品	0.42
パルプ・紙	0.16
化学	5.95
医薬品	5.10
石油・石炭製品	0.41
ゴム製品	0.75
ガラス・土石製品	0.67
鉄鋼	0.86
非鉄金属	0.65
金属製品	0.51
機械	5.50
電気機器	18.03
輸送用機器	7.84
精密機器	2.54
その他製品	2.31
電気・ガス業	1.26
陸運業	2.87
海運業	0.54
空運業	0.51
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	8.11
卸売業	6.75
小売業	4.26
銀行業	6.02
証券、商品先物取引業	0.70
保険業	2.26
その他金融業	1.12
不動産業	1.78
サービス業	4.77
合 計	98.46

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2023年09月	買建	34	日本円	763,946,700	777,920,000	1.53

(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 6月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	211,347,812,379	68.92
	カナダ	10,501,232,067	3.42
	ドイツ	7,583,588,100	2.47
	イタリア	1,621,089,272	0.53
	フランス	9,979,234,909	3.25
	オランダ	5,898,665,095	1.92
	スペイン	2,247,902,749	0.73
	ベルギー	645,832,131	0.21
	オーストリア	150,651,015	0.05
	ルクセンブルク	163,076,318	0.05
	フィンランド	981,537,064	0.32
	アイルランド	5,887,203,639	1.92
	ポルトガル	162,205,252	0.05
	イギリス	12,292,090,078	4.01
	スイス	9,807,883,452	3.20
	スウェーデン	2,646,791,199	0.86
	ノルウェー	558,333,577	0.18
	デンマーク	2,645,996,741	0.86
	ケイマン	510,879,854	0.17
	オーストラリア	5,975,014,545	1.95
	バミューダ	186,757,022	0.06
	ニュージーランド	240,026,984	0.08
	香港	1,802,758,215	0.59
	シンガポール	946,468,031	0.31
	イスラエル	638,935,337	0.21
	ジャージー	912,102,029	0.30
アラブ首長国連邦	0	0.00	
マン島	56,146,751	0.02	
小計		296,390,213,805	96.65
投資証券	アメリカ	5,415,256,962	1.77
	カナダ	15,209,631	0.00
	フランス	110,007,924	0.04
	ベルギー	30,163,820	0.01
	イギリス	103,170,633	0.03

	オーストラリア	364,968,558	0.12
	香港	84,111,804	0.03
	シンガポール	126,844,181	0.04
	小計	6,249,733,513	2.04
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		4,026,340,031	1.31
合計(純資産総額)		306,666,287,349	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,376,481,810	1.10
	買建	ドイツ	658,113,960	0.21

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		4,415,488,142	1.44
	売建		23,203,184	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	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	627,404	22,121.39	13,879,054,456	27,488.65	17,246,491,537	5.62
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	280,574	36,563.81	10,258,856,668	48,578.89	13,629,976,148	4.44
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	366,320	17,246.05	6,317,573,139	18,544.22	6,793,119,037	2.22
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	98,010	20,585.34	2,017,570,088	59,187.81	5,800,998,023	1.89
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	113,255	31,592.44	3,578,002,498	37,334.92	4,228,366,931	1.38
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	236,440	15,127.58	3,576,765,908	17,268.30	4,082,918,980	1.33
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	213,510	15,201.78	3,245,733,231	17,400.24	3,715,127,356	1.21
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	88,020	20,309.76	1,787,665,350	40,819.03	3,592,891,434	1.17
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	37,040	77,870.92	2,884,338,983	69,079.03	2,558,687,479	0.83

アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	51,505	42,287.74	2,178,030,500	48,848.58	2,515,946,159	0.82
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	160,791	15,382.44	2,473,357,927	15,470.43	2,487,506,393	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	103,181	24,705.07	2,549,093,854	23,792.85	2,454,970,984	0.80
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	116,120	17,927.42	2,081,732,263	20,795.91	2,414,821,731	0.79
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	64,492	28,501.41	1,838,113,329	33,974.05	2,191,054,871	0.71
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	32,094	51,261.71	1,645,193,554	67,346.40	2,161,415,525	0.70
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	16,560	69,305.41	1,147,697,647	125,064.02	2,071,060,242	0.68
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	93,709	19,142.14	1,793,791,047	21,658.60	2,029,606,328	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	33,815	45,702.39	1,545,426,489	56,208.27	1,900,682,762	0.62
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	109,240	17,458.41	1,907,157,355	17,234.43	1,882,689,658	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	40,095	42,235.40	1,693,428,682	44,630.82	1,789,472,800	0.58
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	16,017	79,541.02	1,274,008,661	105,339.83	1,687,228,217	0.55
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	100,833	14,318.47	1,443,774,606	16,462.16	1,659,929,443	0.54
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	71,251	25,330.72	1,804,839,839	22,653.23	1,614,065,832	0.53
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	65,795	17,380.97	1,143,581,571	22,573.48	1,485,222,643	0.48
フランス	株式	LVHM MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	耐久消費財・アパレル	10,974	105,304.26	1,155,609,021	134,748.00	1,478,724,552	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	54,741	25,896.17	1,417,582,370	26,660.76	1,459,436,729	0.48
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	163,352	8,576.47	1,400,983,677	8,702.29	1,421,538,077	0.46
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	17,609	72,393.45	1,274,776,266	77,089.73	1,357,473,110	0.44
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	70,126	21,734.58	1,524,159,311	19,317.01	1,354,625,183	0.44
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	58,732	20,389.13	1,197,494,900	22,369.05	1,313,779,467	0.43

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	4.76

	素材	4.05
	資本財	6.66
	商業・専門サービス	1.59
	運輸	1.85
	自動車・自動車部品	2.28
	耐久消費財・アパレル	1.71
	消費者サービス	2.12
	メディア・娯楽	5.68
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.35
	生活必需品流通・小売り	1.72
	食品・飲料・タバコ	3.93
	家庭用品・パーソナル用品	1.71
	ヘルスケア機器・サービス	4.58
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.29
	銀行	5.24
	金融サービス	6.41
	保険	3.01
	ソフトウェア・サービス	9.37
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.03
	電気通信サービス	1.22
	公益事業	2.85
	半導体・半導体製造装置	5.94
	不動産管理・開発	0.28
投資証券		2.04
合計		98.69

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 EMINI2309	買建	105	米ドル	23,090,330	3,347,866,946	23,287,687.5	3,376,481,810	1.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2309	買建	105	ユーロ	4,183,100	659,256,560	4,175,850	658,113,960	0.21

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
-------	----	----	----	---------	--------	-----------------

為替予約取引	米ドル	買建	26,300,000.00	3,675,326,320	3,792,687,560	1.24
	ユーロ	買建	3,550,000.00	540,270,290	556,897,895	0.18
	英ポンド	買建	159,000.00	29,067,267	29,076,425	0.01
	スイスフラン	買建	218,000.00	35,127,778	35,133,926	0.01
	デンマーククローネ	買建	80,000.00	1,691,992	1,692,336	0.00
	ノルウェークローネ	売建	730,000.00	9,770,320	9,800,396	0.00
	豪ドル	売建	140,000.00	13,323,800	13,402,788	0.00

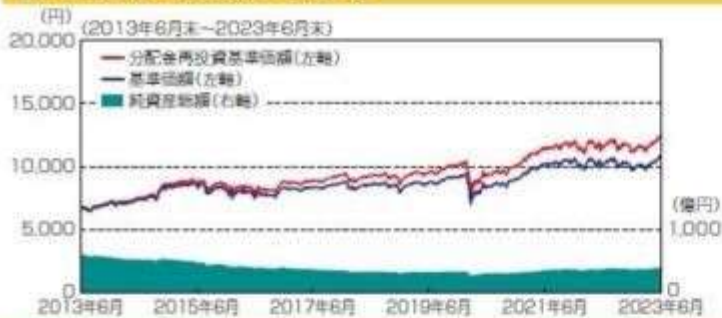
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報

運用実績

2023年6月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 10,839円

純資産総額…………… 397.01億円

※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6月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2023年2月	2023年3月	2023年4月	2023年5月	2023年6月	最近1年間累計	設定以来累計
10円	10円	10円	10円	10円	120円	5,360円

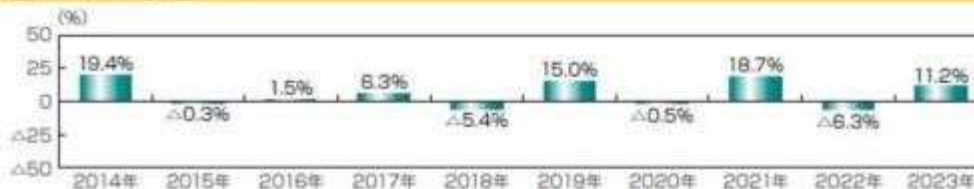
主要な資産の状況

組入資産	投資対象	比率*1	組入上位の銘柄名	国名	比率*2
日本リートインデックス J-REITマザーファンド	日本リート	15.9%	日本ビルファンド投資法人 投資証券	日本	6.2%
			ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	日本	5.3%
			野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	日本	5.1%
			日本プロロジスリート投資法人 投資証券	日本	4.7%
			日本都市ファンド投資法人 投資証券	日本	4.6%
海外リートインデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外リート	16.8%	PROLOGIS INC	アメリカ	8.8%
			EQUINIX INC	アメリカ	5.7%
			PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.6%
			REALTY INCOME CORP	アメリカ	3.2%
			WELLTOWER INC	アメリカ	3.1%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	15.8%	第341回利付国債(10年)	日本	1.4%
			第344回利付国債(10年)	日本	1.4%
			第347回利付国債(10年)	日本	1.3%
			第345回利付国債(10年)	日本	1.3%
			第346回利付国債(10年)	日本	1.3%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外債券	16.5%	US TREASURY N/B(0.5%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(1.75%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(4.125%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(0.375%)	アメリカ	0.5%
			US TREASURY N/B(1.625%)	アメリカ	0.5%
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	16.4%	トヨタ自動車	日本	3.8%
			ソニーグループ	日本	2.8%
			キーエンス	日本	2.0%
			三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	2.0%
			日本電信電話	日本	1.6%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	海外株式	16.9%	APPLE INC	アメリカ	5.6%
			MICROSOFT CORP	アメリカ	4.4%
			AMAZON.COM INC	アメリカ	2.2%
			NVIDIA CORP	アメリカ	1.9%
			TESLA INC	アメリカ	1.4%
現金その他		1.8%			

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

*2: 各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2023年は、2023年6月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

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

2【換金（解約）手続等】

＜解約請求による換金＞

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

(4) 解約制限

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

(5) 解約価額

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

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(7) 解約単位

1口単位

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

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<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^{*}における以下のいずれかの価額で評価します。

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

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

* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

国内上場不動産投信

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

海外上場不動産投信

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

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

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

（４）【計算期間】

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

（５）【その他】

信託の終了（繰上償還）

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

償還金について

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

信託約款の変更

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

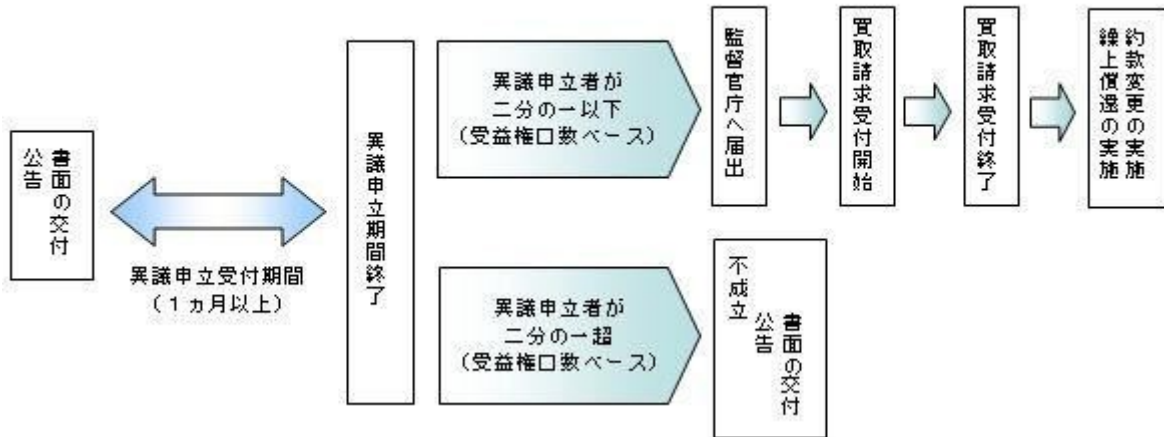
異議の申立て

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

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

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

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2022年12月16日から2023年6月15日までの特定期間の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2022年12月15日現在	当期 2023年 6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	664,141,270	815,533,330
親投資信託受益証券	36,867,115,693	38,660,635,437
未収入金	4,115,223	35,302,831
流動資産合計	37,535,372,186	39,511,471,598
資産合計	37,535,372,186	39,511,471,598
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	36,679,093	36,865,702
未払解約金	19,443,502	69,300,347
未払受託者報酬	1,699,401	1,803,533
未払委託者報酬	30,589,408	32,463,791
未払利息	1,084	1,504
その他未払費用	3,125,059	7,199,945
流動負債合計	91,537,547	147,634,822
負債合計	91,537,547	147,634,822
純資産の部		
元本等		
元本	36,679,093,259	36,865,702,370
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	764,741,380	2,498,134,406
(分配準備積立金)	6,412,654,432	6,617,799,400
元本等合計	37,443,834,639	39,363,836,776
純資産合計	37,443,834,639	39,363,836,776
負債純資産合計	37,535,372,186	39,511,471,598

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期		当期	
	自 至	2022年 6月16日 2022年12月15日	自 至	2022年12月16日 2023年 6月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		1,498,424,587		2,156,149,726
営業収益合計		1,498,424,587		2,156,149,726
営業費用				
支払利息		129,134		85,276
受託者報酬		10,320,389		10,192,653
委託者報酬		185,768,125		183,468,905
その他費用		3,814,684		4,882,573
営業費用合計		200,032,332		198,629,407
営業利益又は営業損失（ ）		1,298,392,255		1,957,520,319
経常利益又は経常損失（ ）		1,298,392,255		1,957,520,319
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,298,392,255		1,957,520,319
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（ ）		4,736,345		8,716,214
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		337,336,404		764,741,380
剰余金増加額又は欠損金減少額		61,007,789		30,385,099
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,622,523		4,691,813
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		58,385,266		25,693,286
剰余金減少額又は欠損金増加額		33,726,641		24,652,570
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		33,726,641		21,093,349
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		3,559,221
分配金		218,859,274		221,143,608
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		764,741,380		2,498,134,406

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針に係る事項に関する注記 ）

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

（ 貸借対照表に関する注記 ）

		前期 2022年12月15日現在	当期 2023年 6月15日現在
1.	期首元本額	35,763,757,188円	36,679,093,259円
	期中追加設定元本額	2,127,865,577円	1,533,696,702円
	期中一部解約元本額	1,212,529,506円	1,347,087,591円
2.	受益権の総数	36,679,093,259口	36,865,702,370口

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

前期 自 2022年 6月16日 至 2022年12月15日		当期 自 2022年12月16日 至 2023年 6月15日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
自 2022年 6月16日 至 2022年 7月15日		自 2022年12月16日 至 2023年 1月16日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	71,667,167円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 44,066,122円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円
C	信託約款に定める収益調整金	2,059,274,216円	C 信託約款に定める収益調整金 2,407,803,695円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,277,745,888円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 6,391,329,136円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	8,408,687,271円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 8,843,198,953円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,324円	F 分配対象収益(1万口当たり) 2,404円
G	分配金額	36,179,299円	G 分配金額 36,774,256円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり) 10円
自 2022年 7月16日 至 2022年 8月15日		自 2023年 1月17日 至 2023年 2月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	65,026,374円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 51,614,248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	192,093,097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	2,126,493,600円	C 信託約款に定める収益調整金 2,451,561,194円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,275,108,862円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 6,375,950,253円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	8,658,721,933円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 8,879,125,695円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,385円	F 分配対象収益(1万口当たり) 2,408円

G	分配金額	36,302,330円	G	分配金額	36,860,987円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2022年 8月16日			自 2023年 2月16日	
	至 2022年 9月15日			至 2023年 3月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	55,996,325円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	64,368,345円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	2,219,466,777円	C	信託約款に定める収益調整金	2,476,287,031円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,436,934,259円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,358,298,618円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	8,712,397,361円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	8,898,953,994円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,390円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,416円
G	分配金額	36,440,689円	G	分配金額	36,826,933円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2022年 9月16日			自 2023年 3月16日	
	至 2022年10月17日			至 2023年 4月17日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	84,453,714円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	133,304,946円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	2,289,299,364円	C	信託約款に定める収益調整金	2,508,631,918円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,429,611,633円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,360,907,032円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	8,803,364,711円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	9,002,843,896円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,404円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,442円
G	分配金額	36,617,407円	G	分配金額	36,855,503円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2022年10月18日			自 2023年 4月18日	
	至 2022年11月15日			至 2023年 5月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	39,788,352円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	52,907,524円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	2,320,611,516円	C	信託約款に定める収益調整金	2,574,817,052円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,451,957,499円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,417,258,177円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	8,812,357,367円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	9,044,982,753円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,405円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,447円
G	分配金額	36,640,456円	G	分配金額	36,960,227円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2022年11月16日			自 2023年 5月16日	
	至 2022年12月15日			至 2023年 6月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	27,142,772円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	67,809,078円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	243,165,850円
C	信託約款に定める収益調整金	2,363,280,670円	C	信託約款に定める収益調整金	2,642,555,179円

D 信託約款に定める分配準備積立金	6,422,190,753円	D 信託約款に定める分配準備積立金	6,343,690,174円
E 分配対象収益(A+B+C+D)	8,812,614,195円	E 分配対象収益(A+B+C+D)	9,297,220,281円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,402円	F 分配対象収益(1万口当たり)	2,521円
G 分配金額	36,679,093円	G 分配金額	36,865,702円
H 分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	10円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	前期 自 2022年 6月16日 至 2022年12月15日	当期 自 2022年12月16日 至 2023年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	前期 2022年12月15日現在	当期 2023年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品

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

(有価証券に関する注記)

前期(2022年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	27,145,297
合計	27,145,297

当期(2023年6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,361,007,222
合計	1,361,007,222

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

前期 2022年12月15日現在		当期 2023年6月15日現在	
1口当たり純資産額	1.0208円	1口当たり純資産額	1.0678円
(1万口当たり純資産額)	(10,208円)	(1万口当たり純資産額)	(10,678円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI (ヘッジなし) マザーファンド	1,348,115,199	6,575,836,317	
	日本債券インデックスマザーファンド	4,563,048,523	6,272,366,499	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	2,397,909,894	6,373,164,916	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	2,847,628,025	6,612,477,036	
	日本リートインデックスJ - REITマザーファンド	2,493,894,999	6,299,578,767	
	海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド	2,280,965,859	6,527,211,902	
合計		15,931,562,499	38,660,635,437	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(参考)

日本リートインデックスJ - REITマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	269,814,075	255,529,598
投資証券	59,014,113,500	59,748,471,000
未収入金	25,416,300	-
未収配当金	273,397,853	322,087,439
流動資産合計	59,582,741,728	60,326,088,037
資産合計	59,582,741,728	60,326,088,037
負債の部		
流動負債		
未払金	81,840,000	-
未払解約金	24,369	-
未払利息	440	471
流動負債合計	81,864,809	471
負債合計	81,864,809	471
純資産の部		
元本等		
元本	23,057,537,880	23,882,441,576
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	36,443,339,039	36,443,645,990
元本等合計	59,500,876,919	60,326,087,566
純資産合計	59,500,876,919	60,326,087,566
負債純資産合計	59,582,741,728	60,326,088,037

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
--	---------------	---------------

1.	期首	2022年 6月16日	2022年12月16日
	期首元本額	24,155,988,864円	23,057,537,880円
	期首からの追加設定元本額	4,906,856,121円	4,207,546,971円
	期首からの一部解約元本額	6,005,307,105円	3,382,643,275円
	元本の内訳		
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,382,153,384円	2,493,894,999円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	1,412,842,931円	1,509,151,180円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	146,673,427円	152,677,611円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	18,736,151,151円	19,253,210,679円
	財産3分法（適格機関投資家専用）	379,716,987円	473,107,791円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	- 円	399,316円
	計	23,057,537,880円	23,882,441,576円
2.	受益権の総数	23,057,537,880口	23,882,441,576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 2022年 6月16日 至 2022年12月15日	自 2022年12月16日 至 2023年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。当該有価証券の性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

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

（有価証券に関する注記）

（2022年12月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1,816,082,327
合計	1,816,082,327

（2023年 6月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	343,718,700
合計	343,718,700

(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）

2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
1口当たり純資産額	2.5805円
	1口当たり純資産額
	2.5260円

(1万口当たり純資産額)

(25,805円)

(1万口当たり純資産額)

(25,260円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	1,150	135,815,000	
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,813	159,725,300	
	S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	2,814	375,950,400	
	東海道リート投資法人 投資証券	941	114,143,300	
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,954	1,295,502,000	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	6,654	1,005,419,400	
	産業ファンド投資法人 投資証券	8,633	1,354,517,700	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,657	2,033,691,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	4,149	895,354,200	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,987	1,212,722,000	
	G L P 投資法人 投資証券	19,076	2,777,465,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,706	948,453,000	
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	9,839	2,923,166,900	
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	990	654,390,000	
	O n e リート投資法人 投資証券	987	237,373,500	
	イオンリート投資法人 投資証券	6,496	1,013,376,000	
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,294	825,864,000	
	日本リート投資法人 投資証券	1,838	618,487,000	
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	17,002	1,356,759,600	
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	1,255	164,781,500	
	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	2,460	665,676,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	1,395	229,617,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,471	174,166,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	18,297	2,954,965,500	
	いちごホテルリート投資法人 投資証券	937	94,543,300	
	ラサルロジポート投資法人 投資証券	6,927	1,118,710,500	
	スターアジア不動産投資法人 投資証券	7,065	422,487,000	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	864	114,480,000		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,235	1,148,790,000		

大江戸温泉リート投資法人 投資証券	913	59,618,900	
投資法人みらい 投資証券	6,874	317,235,100	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,944	823,284,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,424	461,287,200	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	918	102,265,200	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	2,667	250,698,000	
アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	2,466	337,348,800	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	6,601	3,722,964,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	5,802	3,138,882,000	
日本都市ファンド投資法人 投資証券	28,549	2,780,672,600	
オリックス不動産投資法人 投資証券	11,274	2,034,957,000	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	3,870	1,362,240,000	
N T T 都市開発リート投資法人 投資証券	5,439	715,772,400	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	3,794	713,651,400	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	4,164	455,125,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	12,657	1,864,376,100	
森トラストリート投資法人 投資証券	10,531	745,594,800	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	24,904	1,414,547,200	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,099	1,027,460,500	
平和不動産リート投資法人 投資証券	3,987	600,840,900	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	3,815	1,220,800,000	
福岡リート投資法人 投資証券	2,926	478,693,600	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	3,292	1,068,254,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	4,636	412,604,000	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,172	716,092,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	2,556	368,319,600	
スターツプロシード投資法人 投資証券	981	229,063,500	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	8,529	2,450,381,700	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	18,247	1,324,732,200	
大和証券リビング投資法人 投資証券	7,841	893,089,900	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	5,191	631,225,600	
合計	344,949	59,748,471,000	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	261,040,279	80,982,762
コール・ローン	33,553,753	21,972,843
投資証券	54,145,705,588	57,212,329,686
未収入金	1,509,867	2,106,554
未収配当金	139,135,228	152,006,629
流動資産合計	54,580,944,715	57,469,398,474
資産合計		
54,580,944,715		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,040	-
未払解約金	-	11,569,680
未払利息	54	40
流動負債合計	5,094	11,569,720
負債合計		
5,094		
純資産の部		
元本等		
元本	19,559,991,666	20,078,950,947
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	35,020,947,955	37,378,877,807
元本等合計	54,580,939,621	57,457,828,754
純資産合計		
54,580,939,621		
負債純資産合計		
54,580,944,715		

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3.その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
1.	期首	2022年 6月16日	2022年12月16日
	期首元本額	19,989,699,038円	19,559,991,666円
	期首からの追加設定元本額	3,169,382,941円	3,069,776,747円
	期首からの一部解約元本額	3,599,090,313円	2,550,817,466円
	元本の内訳		
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,143,651,380円	2,280,965,859円
	インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）	7,439,594円	7,247,382円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	17,177,981,811円	17,560,828,477円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	- 円	4,297,153円
	海外先進国REITインデックスファンド（適格機関投資家向け）	230,918,881円	225,612,076円
	計	19,559,991,666円	20,078,950,947円
2.	受益権の総数	19,559,991,666口	20,078,950,947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 2022年 6月16日 至 2022年12月15日	自 2022年12月16日 至 2023年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

	自 2022年 6月16日 至 2022年12月15日	自 2022年12月16日 至 2023年 6月15日
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、為替予約取引があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2022年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	58,908,355
合計	58,908,355

(2023年 6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1,487,263,996
合計	1,487,263,996

(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)

(2022年12月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	27,086,000	-	27,080,960	5,040
	米ドル	27,086,000	-	27,080,960	5,040
	合計	27,086,000	-	27,080,960	5,040

(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。

(2023年 6月15日現在)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2022年12月15日現在		2023年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	2.7904円	1口当たり純資産額	2.8616円
(1万口当たり純資産額)	(27,904円)	(1万口当たり純資産額)	(28,616円)

附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	30,497	434,582.25	
		AGREE REALTY CORPORATION	28,539	1,877,010.03	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	23,359	436,813.30	
		ALEXANDER'S INC	722	133,317.30	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	50,562	6,164,519.04	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	4,274	68,042.08	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	16,903	329,439.47	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	98,538	3,432,078.54	
		AMERICOLD REALTY TRUST INC	86,587	2,756,064.21	
		APARTMENT INCOME REIT CO	47,872	1,766,476.80	
		APARTMENT INVT&MGMT CO -A	48,569	407,493.91	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	68,189	1,035,109.02	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	21,195	253,704.15	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,534	51,389.40	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	44,944	8,546,551.04	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,014	16,244.28	
		BOSTON PROPERTIES INC	45,817	2,484,655.91	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	19,121	77,631.26	

BRANDYWINE REALTY TRUST	54,422	240,545.24	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	96,060	2,071,053.60	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	55,637	907,995.84	
BRT APARTMENTS CORP	4,170	81,982.20	
CAMDEN PROPERTY TRUST	35,361	3,951,945.36	
CARETRUST REIT INC	32,095	637,727.65	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	8,008	185,225.04	
CENTERSPACE	4,765	296,478.30	
CHATHAM LODGING TRUST	15,405	144,807.00	
CITY OFFICE REIT INC	11,825	64,801.00	
CLIPPER REALTY INC	5,351	29,323.48	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	7,590	262,234.50	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	36,311	868,922.23	
COUSINS PROPERTIES INC	48,600	1,058,022.00	
CTO REALTY GROWTH INC	6,938	116,211.50	
CUBESMART	72,101	3,153,697.74	
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	66,791	544,346.65	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	99,300	47,664.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	92,356	9,742,634.44	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	77,917	237,646.85	
DOUGLAS EMMETT INC	56,612	707,650.00	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	68,595.90	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	29,998	434,371.04	
EASTGROUP PROPERTIES INC	13,983	2,431,503.87	
ELME COMMUNITIES	28,439	447,914.25	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	41,824	291,513.28	
EPR PROPERTIES	24,069	1,100,193.99	
EQUINIX INC	29,720	23,056,181.60	
EQUITY COMMONWEALTH	35,461	755,319.30	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	56,245	3,804,411.80	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	109,435	7,263,200.95	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	45,562	1,123,103.30	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	20,763	4,845,876.57	
EXTRA SPACE STORAGE INC	42,999	6,162,616.68	
FARMLAND PARTNERS INC	16,202	201,228.84	

FEDERAL REALTY INVS TRUST	23,502	2,216,473.62	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	42,418	2,218,461.40	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	27,250	718,310.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	26,426	37,260.66	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	82,740	4,147,756.20	
GETTY REALTY CORPORATION	13,776	482,435.52	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	12,252	158,663.40	
GLADSTONE LAND CORP	10,188	175,233.60	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	19,349	182,654.56	
GLOBAL NET LEASE INC	33,648	359,360.64	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	122,512	2,396,334.72	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	175,861	3,640,322.70	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	11,024	66,474.72	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	33,638	756,182.24	
HOST HOTELS & RESORTS INC	229,502	4,007,104.92	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	40,730	195,504.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	71,469	1,323,605.88	
INDUS REALTY TRUST INC	1,721	115,203.74	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	22,244	57,167.08	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	8,884	645,511.44	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	21,653	508,628.97	
INVITATION HOMES INC	186,547	6,350,059.88	
IRON MOUNTAIN INC	93,321	5,293,167.12	
JBG SMITH PROPERTIES	32,271	493,100.88	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	265,800	82,398.00	
KILROY REALTY CORPORATION	33,819	1,032,494.07	
KIMCO REALTY CORP	198,312	3,827,421.60	
KITE REALTY GROUP TRUST	70,167	1,476,313.68	
LIFE STORAGE INC	27,271	3,489,869.87	
LTC PROPERTIES INC	13,161	448,132.05	
LXP INDUSTRIAL TRUST	88,596	910,766.88	
MACERICH CO/THE	69,743	782,516.46	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	602,247	101,779.74	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	192,265	1,745,766.20	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	37,085	5,688,839.00	

NATIONAL STORAGE AFFILIATES	27,073	951,345.22	
NATL HEALTH INVESTORS INC	13,925	749,722.00	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	42,451	299,704.06	
NETSTREIT CORP	17,712	324,129.60	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	9,913	115,387.32	
NEXPOINT RESIDENTIAL	7,127	322,211.67	
NNN REIT INC	58,384	2,485,990.72	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	15,503	121,543.52	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	75,381	2,351,887.20	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,324	111,484.56	
ORION OFFICE REIT INC	19,338	124,536.72	
PARAMOUNT GROUP INC	52,137	239,308.83	
PARK HOTELS & RESORTS INC	72,033	965,962.53	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	42,092	573,293.04	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	37,757	1,269,390.34	
PHYSICIANS REALTY TRUST	73,683	1,066,193.01	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	39,572	271,859.64	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	12,592	286,342.08	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	5,728	85,060.80	
PRIME US REIT	184,200	40,524.00	
PROLOGIS INC	296,391	36,239,727.57	
PUBLIC STORAGE	50,764	14,423,067.68	
REALTY INCOME CORP	201,523	12,329,177.14	
REGENCY CENTERS CORP	49,444	3,008,172.96	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	39,729	534,355.05	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	60,598	3,219,571.74	
RLJ LODGING TRUST	51,972	536,870.76	
RPT REALTY	27,271	281,982.14	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	17,684	1,658,228.68	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	74,182	879,798.52	
SAFEHOLD INC	12,902	306,809.56	
SAUL CENTERS INC	4,133	151,929.08	
SERVICE PROPERTIES TRUST	53,199	471,343.14	
SIMON PROPERTY GROUP INC	105,004	11,644,943.60	
SITE CENTERS CORP	58,231	768,066.89	

		SL GREEN REALTY CORP	20,710	539,495.50	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	44,836	1,788,508.04	
		STAG INDUSTRIAL INC	57,532	2,108,547.80	
		STAR HOLDINGS	4,193	59,582.53	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	34,272	225,509.76	
		SUN COMMUNITIES INC	39,798	5,324,176.44	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	67,090	680,963.50	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	33,546	722,245.38	
		TERRENO REALTY CORP	23,355	1,362,997.80	
		UDR INC	99,430	4,286,427.30	
		UMH PROPERTIES INC	17,055	276,291.00	
		UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	4,210	205,321.70	
		URBAN EDGE PROPERTIES	37,518	560,518.92	
		URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	9,608	200,615.04	
		VENTAS INC	128,494	5,951,842.08	
		VERIS RESIDENTIAL INC	25,599	434,671.02	
		VICI PROPERTIES INC	322,178	10,432,123.64	
		VORNADO REALTY TRUST	51,585	788,218.80	
		WELLTOWER INC	151,742	12,373,042.68	
		WHITESTONE REIT	15,152	145,307.68	
		WP CAREY INC	67,745	4,736,730.40	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	36,413	451,157.07	
米ドル小計			8,680,656	316,603,558.87	(44,447,973,629)
加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	20,353	463,234.28	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,810	135,432.00	
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	6,925	80,745.50	
		BOARDWALK EQUITIES INC	7,139	428,411.39	
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	5,270	87,692.80	
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	12,031	38,318.73	
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	27,035	1,350,127.90	
		CHOICE PROPERTIES REIT	52,246	698,006.56	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,470	253,664.40	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	16,654	248,977.30	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	40,108	557,902.28	

		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	6,850	101,106.00	
		EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	13,127	36,886.87	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	34,752	526,492.80	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	10,051	807,095.30	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	41,720	430,550.40	
		INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	7,702	24,723.42	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	21,919	279,248.06	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,130	322,895.30	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,756	87,548.76	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	5,901	97,484.52	
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	9,851	84,029.03	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	38,193	294,086.10	
		PRIMARIS REIT	16,018	204,710.04	
		PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	7,180	38,269.40	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	47,388	942,547.32	
		SLATE GROCERY REIT	9,526	124,314.30	
		SLATE OFFICE REIT	12,044	24,088.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	23,078	579,719.36	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	12,783	32,085.33	
加ドル小計			566,010	9,380,393.45	(987,755,430)
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	12,843	850,848.75	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	2,768	14,365.92	
		ALTAREA	1,522	156,766.00	
		CARE PROPERTY INVEST	12,243	163,076.76	
		CARMILA	18,680	273,101.60	
		COFINIMMO	9,907	747,978.50	
		COVIVIO	14,961	691,796.64	
		CROMWELL REIT EUR	119,560	188,904.80	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	13,509	302,871.78	
		GECINA SA	17,487	1,713,726.00	
		HAMBORNER REIT AG	23,984	166,688.80	
		ICADE	10,336	414,680.32	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	15,466	39,360.97	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	97,537	554,985.53	

		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	8,508	133,575.60	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	148,779	150,861.90	
		KLEPIERRE	62,529	1,395,021.99	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	19,678	104,293.40	
		MERCIALYS	24,638	199,444.61	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	107,784	850,954.68	
		MONTEA	4,282	330,570.40	
		NSI NV	5,548	112,347.00	
		RETAIL ESTATES	3,603	230,952.30	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	34,229	1,604,313.23	
		VASTNED RETAIL	5,856	118,291.20	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	49,759	1,312,642.42	
		WERELDHAVE NV	13,084	183,830.20	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	7,427	219,839.20	
			866,507	13,226,090.50	
				(2,012,349,669)	
ユーロ小計					
英債券	投資証券	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	136,620	69,402.96	
		AEW UK REIT PLC	45,713	46,627.26	
		ASSURA PLC	959,228	446,232.86	
		BALANCED COMM PROPERTY TRUST	263,699	203,839.32	
		BIG YELLOW GROUP PLC	55,973	626,897.60	
		BRITISH LAND COMPANY PLC	301,054	1,007,627.73	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	205,988	164,172.43	
		CLS HOLDINGS PLC	65,076	89,154.12	
		CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	145,337	131,675.32	
		DERWENT LONDON PLC	36,165	763,804.80	
		EDISTON PROPERTY INVESTMENT	76,805	47,619.10	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	188,560	163,858.64	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	81,648	376,723.87	
		HAMMERSON PLC	1,284,082	339,254.46	
		HOME REIT PLC	256,438	97,574.65	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	138,665	128,958.45	
		INTU PROPERTIES PLC	758,746		
		LAND SECURITIES GROUP PLC	241,057	1,431,396.46	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	312,753	556,700.34	

		LXI REIT PLC	550,748	544,414.39	
		NEWRIVER REIT PLC	104,390	93,011.49	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	178,755	136,211.31	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	434,401	431,360.19	
		PRS REIT PLC/THE	183,163	149,461.00	
		REGIONAL REIT LTD	147,696	73,183.36	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	69,370	633,694.95	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	181,830	82,278.07	
		SEGRO PLC	388,367	2,933,724.31	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	580,353	681,914.77	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	402,889	318,685.19	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	122,256	63,939.88	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	599,772	825,886.04	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	277,971	150,382.31	
		UNITE GROUP PLC	128,188	1,140,873.20	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	147,039	191,150.70	
		WAREHOUSE REIT PLC	133,669	119,500.08	
		WORKSPACE GROUP PLC	43,943	226,965.59	
			10,228,407	15,488,157.20	
		英bond小計		(2,752,555,297)	
豪ドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	134,724	347,587.92	
		ARENA REIT	111,547	412,723.90	
		BWP TRUST	159,304	576,680.48	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	219,440	352,201.20	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	175,393	534,948.65	
		CENTURIA OFFICE REIT	145,435	202,881.82	
		CHARTER HALL GROUP	151,785	1,651,420.80	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	211,787	859,855.22	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	169,868	616,620.84	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	106,144	308,879.04	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	463,054	243,103.35	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	70,496	190,339.20	
		DEXUS/AU	347,700	2,736,399.00	
		GDI PROPERTY GROUP	181,454	124,295.99	
		GOODMAN GROUP	549,629	10,822,195.01	

		GPT GROUP	618,719	2,487,250.38	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	98,916	284,878.08	
		HEALTHCO REIT	135,075	189,780.37	
		HMC CAPITAL LTD	63,267	287,864.85	
		HOMEKO DAILY NEEDS REIT	505,795	574,077.32	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	65,655	215,348.40	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	120,549	480,990.51	
		MIRVAC GROUP	1,273,685	2,776,633.30	
		NATIONAL STORAGE REIT	389,844	959,016.24	
		RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	132,547	86,818.28	
		REGION RE LTD	374,135	886,699.95	
		RURAL FUNDS GROUP	125,402	213,810.41	
		SCENTRE GROUP	1,673,884	4,335,359.56	
		STOCKLAND	768,929	3,129,541.03	
		VICINITY CENTRES	1,248,198	2,321,648.28	
		WAYPOINT REIT	220,218	596,790.78	
豪ドル小計			11,012,578	39,806,640.16	(3,796,359,272)
ニュー ジーラン ドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	428,056	924,600.96	
		STRIDE PROPERTY GROUP	324,784	435,210.56	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	229,956	531,198.36	
ニュージーランドドル小計			982,796	1,891,009.88	(164,385,488)
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	617,000	1,684,410.00	
		FORTUNE REIT	484,900	2,720,289.00	
		LINK REIT	812,880	38,002,140.00	
		PROSPERITY REIT	411,000	706,920.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	331,000	936,730.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	733,110	1,246,287.00	
香港ドル小計			3,389,890	45,296,776.00	(812,171,193)
シンガ ポールド ル	投資証券	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	171,225	202,045.50	
		AIMS APAC REIT-RIGHTS	5,992		
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,085,132	2,897,302.44	
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	714,492	757,361.52	

		CAPITALAND CHINA TRUST	374,585	378,330.85	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,620,692	3,192,763.24	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	267,100	323,191.00	
		DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	173,500	101,497.50	
		EC WORLD REIT	77,700	25,641.00	
		ESR-LOGOS REIT	1,938,319	610,570.48	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	355,700	213,420.00	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	428,740	111,472.40	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	347,005	756,470.90	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERC	928,360	1,151,166.40	
		KEPPEL DC REIT	431,277	875,492.31	
		KEPPEL REIT	649,000	577,610.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	602,552	403,709.84	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	646,408	1,441,489.84	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,038,387	1,723,722.42	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	742,831	1,233,099.46	
		QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	808,535	258,731.20	
		PARAGON REIT	360,200	338,588.00	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	125,800	465,460.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	169,400	116,039.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	467,500	238,425.00	
		SUNTEC REIT	730,000	927,100.00	
シンガポールドドル小計			15,260,432	19,320,700.30	(2,020,558,837)
韓国ウォ ン	投資証券	D&D PLATFORM REIT CO LTD	22,899	76,597,155.00	
		E KOCREF CR-REIT CO LTD	8,770	46,919,500.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	55,071	225,515,745.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,591	56,332,260.00	
		JR REIT XXVII	51,208	234,788,680.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	13,627	75,902,390.00	
		LOTTE REIT CO LTD	39,257	155,261,435.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	8,226	36,400,050.00	
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,699	47,176,785.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	23,648	147,563,520.00	
		SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	9,014	33,081,380.00	

		SK REITS CO LTD	29,394	151,085,160.00	
韓国ウォン小計			285,404	1,286,624,060.00	(141,785,971)
イスラエル シュケル	投資証券	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	231,039	400,390.58	
		REIT 1 LTD	60,560	981,677.60	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	71,314	568,871.77	
イスラエルシュケル小計			362,913	1,950,939.95	(76,434,900)
合計				57,212,329,686	(57,212,329,686)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 145銘柄	100.0%	77.9%
加ドル	投資証券 30銘柄	100.0%	1.7%
ユーロ	投資証券 28銘柄	100.0%	3.5%
英ポンド	投資証券 37銘柄	100.0%	4.8%
豪ドル	投資証券 31銘柄	100.0%	6.6%
ニュージーランドドル	投資証券 3銘柄	100.0%	0.3%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	1.4%
シンガポールドル	投資証券 26銘柄	100.0%	3.5%
韓国ウォン	投資証券 12銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシュケル	投資証券 3銘柄	100.0%	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	102,398,818	296,558,632
国債証券	40,988,778,100	44,440,267,790
地方債証券	3,452,622,710	2,843,860,300
特殊債券	3,524,854,000	2,923,300,000
社債券	301,100,000	701,132,000
未収利息	129,093,851	132,015,132
前払費用	1,656,426	7,368,092
流動資産合計	48,500,503,905	51,344,501,946
負債の部		
流動負債		
未払金	-	402,831,300
未払解約金	17,753,784	4,699,238
未払利息	167	547
流動負債合計	17,753,951	407,531,085
負債合計	17,753,951	407,531,085
純資産の部		
元本等		
元本	35,610,435,312	37,056,558,627
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	12,872,314,642	13,880,412,234
元本等合計	48,482,749,954	50,936,970,861
純資産合計	48,482,749,954	50,936,970,861
負債純資産合計	48,500,503,905	51,344,501,946

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</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。
--	--

(貸借対照表に関する注記)

		2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
1.	期首	2022年 6月16日	2022年12月16日
	期首元本額	34,912,052,752円	35,610,435,312円
	期首からの追加設定元本額	2,127,168,657円	2,431,462,731円
	期首からの一部解約元本額	1,428,786,097円	985,339,416円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス(株式20)	4,921,236,138円	5,276,352,595円
	DCインデックスバランス(株式40)	4,569,564,215円	5,091,284,567円
	DCインデックスバランス(株式60)	3,421,641,846円	3,960,723,790円
	DCインデックスバランス(株式80)	567,244,180円	660,838,148円
	インデックスファンド日本債券(DC専用)	2,204,984,670円	2,253,893,287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	4,491,558,627円	4,563,048,523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)	1,672,224,901円	1,669,721,425円
	Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	- 円	6,290,886円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	3,370,522,718円	3,121,256,326円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,487,476,623円	1,532,126,635円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,442,524,040円	1,520,578,323円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	820,184,428円	888,849,982円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	122,162,555円	128,873,086円
	インデックスファンド日本債券(1年決算型)	6,136,780,166円	5,984,700,943円
	日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	382,330,205円	398,020,111円
	計	35,610,435,312円	37,056,558,627円
2.	受益権の総数	35,610,435,312口	37,056,558,627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 2022年 6月16日 至 2022年12月15日	自 2022年12月16日 至 2023年 6月15日
--	--------------------------------	--------------------------------

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

金融商品の時価等に関する事項

	2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2022年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	218,936,230
地方債証券	3,531,940
特殊債券	3,765,000
社債券	233,000
合計	211,406,290

（2023年 6月15日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	503,576,350
地方債証券	3,033,700
特殊債券	440,000
社債券	786,000
合計	499,316,650

（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）

2022年12月15日現在		2023年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	1.3615円	1口当たり純資産額	1.3746円
(1万口当たり純資産額)	(13,615円)	(1万口当たり純資産額)	(13,746円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第149回利付国債（5年）	100,000,000	100,147,000	
	第150回利付国債（5年）	50,000,000	50,061,500	
	第152回利付国債（5年）	100,000,000	100,432,000	
	第153回利付国債（5年）	300,000,000	300,000,000	
	第157回利付国債（5年）	120,000,000	120,681,600	
	第1回利付国債（40年）	70,000,000	88,831,400	
	第2回利付国債（40年）	125,000,000	152,597,500	
	第3回利付国債（40年）	85,000,000	103,792,650	
	第4回利付国債（40年）	95,000,000	116,110,900	
	第5回利付国債（40年）	95,000,000	112,087,650	
	第6回利付国債（40年）	110,000,000	127,583,500	
	第7回利付国債（40年）	130,000,000	144,277,900	
	第8回利付国債（40年）	115,000,000	118,785,800	
	第9回利付国債（40年）	180,000,000	137,871,000	
	第10回利付国債（40年）	125,000,000	112,085,000	
	第11回利付国債（40年）	140,000,000	121,066,400	
	第12回利付国債（40年）	175,000,000	135,530,500	
	第13回利付国債（40年）	180,000,000	138,168,000	
	第14回利付国債（40年）	150,000,000	122,698,500	
	第15回利付国債（40年）	170,000,000	152,722,900	
	第16回利付国債（40年）	70,000,000	68,474,000	
	第334回利付国債（10年）	120,000,000	120,892,800	
	第335回利付国債（10年）	490,000,000	493,841,600	
	第336回利付国債（10年）	180,000,000	181,634,400	
	第337回利付国債（10年）	230,000,000	231,391,500	
	第338回利付国債（10年）	390,000,000	393,330,600	
	第339回利付国債（10年）	570,000,000	575,449,200	
	第340回利付国債（10年）	620,000,000	626,603,000	
	第341回利付国債（10年）	700,000,000	706,426,000	
	第342回利付国債（10年）	630,000,000	632,784,600	
	第343回利付国債（10年）	645,000,000	647,915,400	
	第344回利付国債（10年）	700,000,000	703,199,000	
	第345回利付国債（10年）	660,000,000	663,016,200	
	第346回利付国債（10年）	660,000,000	662,851,200	
	第347回利付国債（10年）	680,000,000	682,584,000	
	第348回利付国債（10年）	500,000,000	501,595,000	
	第349回利付国債（10年）	590,000,000	591,457,300	
	第350回利付国債（10年）	540,000,000	540,507,600	
	第351回利付国債（10年）	535,000,000	535,262,150	
	第352回利付国債（10年）	520,000,000	519,859,600	

第353回利付国債(10年)	400,000,000	399,560,000	
第354回利付国債(10年)	325,000,000	324,346,750	
第355回利付国債(10年)	350,000,000	349,058,500	
第356回利付国債(10年)	350,000,000	348,694,500	
第357回利付国債(10年)	560,000,000	557,116,000	
第358回利付国債(10年)	590,000,000	586,259,400	
第359回利付国債(10年)	420,000,000	416,661,000	
第360回利付国債(10年)	580,000,000	573,997,000	
第361回利付国債(10年)	460,000,000	454,240,800	
第362回利付国債(10年)	400,000,000	394,232,000	
第363回利付国債(10年)	500,000,000	491,790,000	
第364回利付国債(10年)	500,000,000	490,945,000	
第365回利付国債(10年)	350,000,000	343,049,000	
第366回利付国債(10年)	400,000,000	394,732,000	
第367回利付国債(10年)	260,000,000	256,144,200	
第368回利付国債(10年)	330,000,000	324,538,500	
第369回利付国債(10年)	240,000,000	242,308,800	
第370回利付国債(10年)	280,000,000	281,965,600	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	58,221,000	
第3回利付国債(30年)	70,000,000	80,069,500	
第5回利付国債(30年)	80,000,000	91,909,600	
第6回利付国債(30年)	50,000,000	58,585,000	
第8回利付国債(30年)	170,000,000	192,076,200	
第9回利付国債(30年)	70,000,000	76,519,100	
第11回利付国債(30年)	170,000,000	190,813,100	
第13回利付国債(30年)	180,000,000	207,795,600	
第14回利付国債(30年)	108,000,000	129,346,200	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	178,053,750	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	42,508,900	
第17回利付国債(30年)	50,000,000	60,275,500	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	131,623,800	
第19回利付国債(30年)	40,000,000	47,967,600	
第20回利付国債(30年)	40,000,000	48,988,800	
第21回利付国債(30年)	70,000,000	84,192,500	
第22回利付国債(30年)	70,000,000	86,068,500	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	67,734,150	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	83,872,560	
第25回利付国債(30年)	60,000,000	72,612,600	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	208,229,600	
第27回利付国債(30年)	89,000,000	110,490,830	
第28回利付国債(30年)	144,000,000	179,151,840	
第29回利付国債(30年)	176,000,000	216,958,720	

第30回利付国債(30年)	147,000,000	179,237,100	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	144,591,600	
第32回利付国債(30年)	160,000,000	195,321,600	
第33回利付国債(30年)	175,000,000	205,450,000	
第34回利付国債(30年)	160,000,000	193,179,200	
第35回利付国債(30年)	193,000,000	227,010,460	
第36回利付国債(30年)	155,000,000	182,509,400	
第37回利付国債(30年)	211,000,000	244,833,850	
第38回利付国債(30年)	165,000,000	188,174,250	
第39回利付国債(30年)	165,000,000	191,195,400	
第40回利付国債(30年)	130,000,000	148,271,500	
第41回利付国債(30年)	160,000,000	179,521,600	
第42回利付国債(30年)	135,000,000	151,505,100	
第43回利付国債(30年)	155,000,000	173,989,050	
第44回利付国債(30年)	150,000,000	168,411,000	
第45回利付国債(30年)	120,000,000	130,160,400	
第46回利付国債(30年)	120,000,000	130,140,000	
第47回利付国債(30年)	125,000,000	137,907,500	
第48回利付国債(30年)	85,000,000	90,367,750	
第49回利付国債(30年)	140,000,000	148,786,400	
第50回利付国債(30年)	95,000,000	89,405,450	
第51回利付国債(30年)	90,000,000	75,393,900	
第52回利付国債(30年)	130,000,000	113,864,400	
第53回利付国債(30年)	105,000,000	93,876,300	
第54回利付国債(30年)	110,000,000	102,719,100	
第55回利付国債(30年)	110,000,000	102,466,100	
第56回利付国債(30年)	90,000,000	83,627,100	
第57回利付国債(30年)	100,000,000	92,686,000	
第58回利付国債(30年)	100,000,000	92,453,000	
第59回利付国債(30年)	170,000,000	152,911,600	
第60回利付国債(30年)	120,000,000	112,801,200	
第61回利付国債(30年)	100,000,000	89,188,000	
第62回利付国債(30年)	120,000,000	101,376,000	
第63回利付国債(30年)	90,000,000	73,753,200	
第64回利付国債(30年)	100,000,000	81,659,000	
第65回利付国債(30年)	110,000,000	89,772,100	
第66回利付国債(30年)	180,000,000	145,954,800	
第67回利付国債(30年)	110,000,000	93,948,800	
第68回利付国債(30年)	140,000,000	119,193,200	
第69回利付国債(30年)	110,000,000	96,041,000	
第70回利付国債(30年)	110,000,000	95,852,900	
第71回利付国債(30年)	120,000,000	104,464,800	

第72回利付国債(30年)	160,000,000	139,008,000	
第73回利付国債(30年)	150,000,000	130,194,000	
第74回利付国債(30年)	130,000,000	122,090,800	
第75回利付国債(30年)	180,000,000	181,915,200	
第76回利付国債(30年)	150,000,000	155,319,000	
第77回利付国債(30年)	160,000,000	173,569,600	
第78回利付国債(30年)	120,000,000	124,308,000	
第70回利付国債(20年)	104,000,000	106,668,640	
第72回利付国債(20年)	112,000,000	115,144,960	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	116,593,400	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	121,931,760	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	10,384,800	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	21,734,160	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	41,468,800	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	166,686,400	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	62,950,800	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	138,118,500	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	321,258,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	17,170,880	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	269,112,500	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	64,493,400	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	64,546,800	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	53,977,000	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	89,546,460	
第96回利付国債(20年)	248,000,000	268,834,480	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	49,167,900	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	102,305,840	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	127,827,180	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	33,022,800	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	73,276,500	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	90,356,310	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	12,215,720	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	36,317,820	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	85,061,900	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,219,880	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	144,134,900	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	147,101,180	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	29,731,590	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	109,034,800	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	28,078,000	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	89,372,800	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	325,087,100	

第114回利付国債(20年)	52,000,000	58,464,120	
第115回利付国債(20年)	125,000,000	141,343,750	
第116回利付国債(20年)	135,000,000	153,158,850	
第117回利付国債(20年)	343,000,000	386,845,690	
第118回利付国債(20年)	70,000,000	78,684,200	
第119回利付国債(20年)	60,000,000	66,614,400	
第120回利付国債(20年)	170,000,000	186,389,700	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	24,624,380	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	18,906,550	
第123回利付国債(20年)	195,000,000	221,599,950	
第124回利付国債(20年)	90,000,000	101,613,600	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	57,333,500	
第126回利付国債(20年)	105,000,000	118,759,200	
第127回利付国債(20年)	50,000,000	56,172,000	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	73,192,600	
第129回利付国債(20年)	85,000,000	95,047,850	
第130回利付国債(20年)	150,000,000	168,073,500	
第131回利付国債(20年)	92,000,000	102,343,560	
第132回利付国債(20年)	135,000,000	150,437,250	
第133回利付国債(20年)	110,000,000	123,490,400	
第134回利付国債(20年)	120,000,000	134,959,200	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	33,484,500	
第136回利付国債(20年)	220,000,000	243,680,800	
第137回利付国債(20年)	200,000,000	223,584,000	
第138回利付国債(20年)	120,000,000	132,054,000	
第139回利付国債(20年)	230,000,000	255,113,700	
第140回利付国債(20年)	318,000,000	356,035,980	
第141回利付国債(20年)	235,000,000	263,477,300	
第142回利付国債(20年)	165,000,000	186,509,400	
第143回利付国債(20年)	94,000,000	104,496,040	
第144回利付国債(20年)	330,000,000	363,749,100	
第145回利付国債(20年)	315,000,000	353,565,450	
第146回利付国債(20年)	135,000,000	151,627,950	
第147回利付国債(20年)	98,000,000	109,147,500	
第148回利付国債(20年)	90,000,000	99,340,200	
第149回利付国債(20年)	115,000,000	127,001,400	
第150回利付国債(20年)	210,000,000	229,784,100	
第151回利付国債(20年)	140,000,000	150,095,400	
第152回利付国債(20年)	250,000,000	267,945,000	
第153回利付国債(20年)	270,000,000	292,482,900	
第154回利付国債(20年)	160,000,000	171,356,800	
第155回利付国債(20年)	270,000,000	282,568,500	

第156回利付国債(20年)	160,000,000	155,561,600	
第157回利付国債(20年)	150,000,000	141,732,000	
第158回利付国債(20年)	170,000,000	166,579,600	
第159回利付国債(20年)	150,000,000	148,606,500	
第160回利付国債(20年)	140,000,000	140,263,200	
第161回利付国債(20年)	120,000,000	118,393,200	
第162回利付国債(20年)	150,000,000	147,576,000	
第163回利付国債(20年)	165,000,000	161,972,250	
第164回利付国債(20年)	255,000,000	246,199,950	
第165回利付国債(20年)	170,000,000	163,602,900	
第166回利付国債(20年)	150,000,000	148,261,500	
第167回利付国債(20年)	160,000,000	153,059,200	
第168回利付国債(20年)	100,000,000	93,876,000	
第169回利付国債(20年)	160,000,000	147,286,400	
第170回利付国債(20年)	140,000,000	128,356,200	
第171回利付国債(20年)	170,000,000	155,223,600	
第172回利付国債(20年)	230,000,000	212,786,800	
第173回利付国債(20年)	150,000,000	138,322,500	
第174回利付国債(20年)	200,000,000	183,822,000	
第175回利付国債(20年)	180,000,000	167,837,400	
第176回利付国債(20年)	160,000,000	148,720,000	
第177回利付国債(20年)	200,000,000	182,102,000	
第178回利付国債(20年)	220,000,000	203,482,400	
第179回利付国債(20年)	190,000,000	175,295,900	
第180回利付国債(20年)	190,000,000	184,725,600	
第181回利付国債(20年)	190,000,000	187,562,300	
第182回利付国債(20年)	200,000,000	204,054,000	
第183回利付国債(20年)	190,000,000	203,569,800	
第184回利付国債(20年)	170,000,000	172,662,200	
国債証券 合計	43,233,000,000	44,440,267,790	
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	99,909,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,438,000	
第32回東京都公募公債(5年)	200,000,000	199,854,000	
第739回東京都公募公債	100,000,000	100,393,000	
第744回東京都公募公債	100,000,000	101,048,000	
令和2年度第2回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,911,000	
令和3年度第6回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,718,000	
第214回神奈川県公募公債	100,000,000	101,019,000	
平成27年度第10回静岡県公募公債	200,000,000	201,788,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	103,890,000	
平成26年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	100,655,000	
平成26年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	100,690,000	

	第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,693,000	
	第142回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,998,000	
	第144回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,746,000	
	第147回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,996,000	
	第165回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,244,000	
	平成28年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	100,029,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	101,007,000	
	平成29年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	100,044,000	
	平成27年度第2回熊本県公募公債(10年)	100,000,000	100,974,000	
	第2回名古屋市定時償還公募公債(10年)	25,000,000	25,035,300	
	平成27年度第5回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	100,915,000	
	令和元年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	99,973,000	
	令和2年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	99,893,000	
地方債証券 合計		2,825,000,000	2,843,860,300	
特殊債券	第5回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	100,190,000	
	第13回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	201,256,000	
	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	199,668,000	
	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,696,000	
	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	108,153,000	
	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	109,411,000	
	第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,594,000	
	第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,644,000	
	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	100,652,000	
	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	100,834,000	
	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	99,929,000	
	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	199,658,000	
	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	99,750,000	
	第69回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,356,000	
	第77回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,818,000	
	第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,064,000	
	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,098,000	
	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	200,248,000	
	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,596,000	
	第357回信金中金債(5年)	100,000,000	99,962,000	
	第363回信金中金債(5年)	100,000,000	99,864,000	
	第29回国際協力機構債券	100,000,000	101,009,000	
	第37回国際協力機構債券	100,000,000	99,850,000	

特殊債券 合計		2,900,000,000	2,923,300,000	
社債券	第25回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人日本高速道路保有・債務返済機構重畳的債務引受条項付）	100,000,000	100,671,000	
	第10回株式会社資生堂無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,849,000	
	第14回株式会社小松製作所無担保社債（社債間限定同順位特約付）（グリーンボンド）	100,000,000	99,873,000	
	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	100,569,000	
	第184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	99,965,000	
	第552回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,187,000	
	第31回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,018,000	
社債券 合計		700,000,000	701,132,000	
合計		49,658,000,000	50,908,560,090	

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）

	2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	125,912,949	99,870,012
コール・ローン	55,075,932	115,992,044
国債証券	148,467,081,975	153,679,818,554
派生商品評価勘定	41,100	88,849
未収利息	864,221,648	973,446,039
前払費用	48,155,622	62,937,415
流動資産合計	149,560,489,226	154,932,152,913
資産合計	149,560,489,226	154,932,152,913
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	12,210
未払金	-	86,521,240
未払解約金	65,651,019	71,316,388
未払利息	89	213
流動負債合計	65,651,108	157,850,051
負債合計	65,651,108	157,850,051
純資産の部		
元本等		

	2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
元本	57,789,894,452	58,234,773,394
剰余金		
剰余金又は欠損金()	91,704,943,666	96,539,529,468
元本等合計	149,494,838,118	154,774,302,862
純資産合計	149,494,838,118	154,774,302,862
負債純資産合計	149,560,489,226	154,932,152,913

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12月15日現在	2023年 6月15日現在
1. 期首	2022年 6月16日	2022年12月16日
期首元本額	59,214,530,778円	57,789,894,452円
期首からの追加設定元本額	2,103,900,729円	1,763,828,462円
期首からの一部解約元本額	3,528,537,055円	1,318,949,520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)	17,218,206,949円	18,107,486,656円
DCインデックスバランス(株式20)	397,085,254円	424,146,388円
DCインデックスバランス(株式40)	529,171,824円	587,133,502円
DCインデックスバランス(株式60)	716,103,266円	824,018,681円
DCインデックスバランス(株式80)	594,831,050円	689,692,157円

	2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	16,784,643,957円	16,425,921,543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	2,355,015,026円	2,397,909,894円
日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	13,054,433,780円	12,597,623,368円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	840,710,667円	868,786,172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)	145,733,134円	145,804,201円
財産3分法(適格機関投資家専用)	224,166,809円	269,545,966円
世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	172,500,884円	170,528,921円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	585,220,546円	547,947,381円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	59,962,366円	61,993,711円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	83,870,029円	88,020,645円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	85,847,452円	92,217,478円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	63,920,343円	68,072,457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	3,578,960,141円	3,545,827,443円
海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	299,510,975円	322,096,830円
計	57,789,894,452円	58,234,773,394円
2. 受益権の総数	57,789,894,452口	58,234,773,394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 2022年 6月16日 至 2022年12月15日	自 2022年12月16日 至 2023年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

	自 2022年 6月16日 至 2022年12月15日	自 2022年12月16日 至 2023年 6月15日
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

	2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2022年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	4,644,430,994
合計	4,644,430,994

(2023年 6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	979,686,290

合計	979,686,290
----	-------------

(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)

(2022年12月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	20,739,000	-	20,697,900	41,100
	メキシコペソ	20,739,000	-	20,697,900	41,100
合計		20,739,000	-	20,697,900	41,100

(2023年 6月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	89,760,524	-	89,837,163	76,639
	米ドル	64,471,300	-	64,549,707	78,407
	ユーロ	19,616,617	-	19,625,311	8,694
	中国元	5,672,607	-	5,662,145	10,462
合計		89,760,524	-	89,837,163	76,639

(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）

2022年12月15日現在		2023年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	2.5869円	1口当たり純資産額	2.6578円
(1万口当たり純資産額)	(25,869円)	(1万口当たり純資産額)	(26,578円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	3,870,000.00	3,750,899.82	
		US TREASURY N/B-0.25%-24/06/15	4,700,000.00	4,471,827.07	
		US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	2,300,000.00	2,224,373.97	
		US TREASURY N/B-1.75%-24/06/30	2,660,000.00	2,565,470.94	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	2,490,000.00	2,405,767.98	
		US TREASURY N/B-1.75%-24/07/31	4,640,000.00	4,464,731.23	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,471,203.52	
		US TREASURY N/B-0.375%-24/08/15	5,000,000.00	4,727,441.40	
		US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,364,753.12	
		US TREASURY N/B-1.25%-24/08/31	2,300,000.00	2,194,298.83	
		US TREASURY N/B-0.375%-24/09/15	6,000,000.00	5,654,414.04	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,015,000.00	1,939,594.91	
		US TREASURY N/B-1.5%-24/09/30	2,200,000.00	2,100,441.39	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	5,190,000.00	4,995,375.00	
		US TREASURY N/B-1.5%-24/10/31	2,140,000.00	2,038,475.38	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	4,650,000.00	4,472,355.49	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,400,000.00	1,343,207.02	
US TREASURY N/B-1.5%-24/11/30	3,470,000.00	3,298,939.82			

US TREASURY N/B-4.5%-24/11/30	2,150,000.00	2,132,951.16	
US TREASURY N/B-1.0%-24/12/15	2,450,000.00	2,308,742.18	
US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	1,823,035.16	
US TREASURY N/B-1.75%-24/12/31	1,300,000.00	1,238,123.04	
US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,443,222.66	
US TREASURY N/B-1.375%-25/01/31	3,510,000.00	3,316,401.56	
US TREASURY N/B-4.125%-25/01/31	1,190,000.00	1,174,636.90	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,530,000.00	4,321,460.72	
US TREASURY N/B-1.5%-25/02/15	3,000,000.00	2,836,992.18	
US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	1,989,147.26	
US TREASURY N/B-1.125%-25/02/28	5,740,000.00	5,390,442.95	
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	2,010,000.00	1,934,899.80	
US TREASURY N/B-0.5%-25/03/31	3,470,000.00	3,215,714.06	
US TREASURY N/B-2.625%-25/04/15	2,600,000.00	2,501,382.80	
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,125,277.35	
US TREASURY N/B-0.375%-25/04/30	2,150,000.00	1,982,493.15	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	3,800,000.00	3,619,722.64	
US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,420,000.00	1,371,381.64	
US TREASURY N/B-0.25%-25/05/31	3,820,000.00	3,504,103.91	
US TREASURY N/B-2.875%-25/06/15	5,000,000.00	4,826,855.45	
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	1,370,000.00	1,319,133.39	
US TREASURY N/B-3.0%-25/07/15	5,000,000.00	4,836,621.10	
US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	1,440,000.00	1,389,150.00	
US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	3,000,000.00	2,737,617.18	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	4,730,000.00	4,477,517.75	
US TREASURY N/B-2.75%-25/08/31	3,000,000.00	2,884,453.14	
US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	4,200,000.00	4,057,757.80	
US TREASURY N/B-0.25%-25/09/30	1,570,000.00	1,426,032.22	
US TREASURY N/B-4.25%-25/10/15	170,000.00	168,837.89	
US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,351,656.25	
US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	2,110,000.00	1,909,591.20	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	3,440,000.00	3,262,221.86	
US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,270,293.75	
US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	3,420,000.00	3,096,435.92	
US TREASURY N/B-4.0%-25/12/15	210,000.00	207,645.70	

US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	1,912,656.24	
US TREASURY N/B-3.875%-26/01/15	1,150,000.00	1,133,581.05	
US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	1,767,689.44	
US TREASURY N/B-0.375%-26/01/31	3,000,000.00	2,701,699.23	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	1,870,242.12	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,310,000.00	3,078,558.57	
US TREASURY N/B-4.0%-26/02/15	3,000,000.00	2,967,187.50	
US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,703,506.64	
US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	3,650,000.00	3,288,920.90	
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	1,955,583.97	
US TREASURY N/B-0.75%-26/03/31	2,400,000.00	2,176,218.74	
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	820,000.00	776,309.37	
US TREASURY N/B-0.75%-26/04/30	2,740,000.00	2,475,097.64	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	4,840,000.00	4,478,701.55	
US TREASURY N/B-3.625%-26/05/15	2,950,000.00	2,890,539.06	
US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	2,740,000.00	2,572,389.04	
US TREASURY N/B-0.75%-26/05/31	2,800,000.00	2,522,679.68	
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	1,863,125.00	
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	960,000.00	892,331.25	
US TREASURY N/B-0.625%-26/07/31	3,260,000.00	2,912,733.58	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,670,625.00	
US TREASURY N/B-0.75%-26/08/31	3,000,000.00	2,684,589.84	
US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,489,608.98	
US TREASURY N/B-0.875%-26/09/30	3,000,000.00	2,692,968.75	
US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	2,450,000.00	2,248,975.58	
US TREASURY N/B-1.125%-26/10/31	3,950,000.00	3,564,797.85	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,040,000.00	2,823,637.48	
US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,400,000.00	2,200,078.12	
US TREASURY N/B-1.25%-26/11/30	2,210,000.00	1,999,100.38	
US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	1,839,726.56	
US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	4,000,000.00	3,638,281.24	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	2,680,000.00	2,502,554.67	
US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,530,000.00	1,370,754.49	
US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	3,310,000.00	2,900,581.43	
US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	2,450,000.00	2,131,165.03	

US TREASURY N/B-2.75%-27/04/30	1,430,000.00	1,357,047.64	
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,302,342.56	
US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	2,100,000.00	1,821,093.75	
US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	3,100,000.00	2,681,560.54	
US TREASURY N/B-3.25%-27/06/30	5,000,000.00	4,831,640.60	
US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	7,000,000.00	6,007,558.62	
US TREASURY N/B-2.75%-27/07/31	930,000.00	880,920.70	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	2,749,446.88	
US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	8,100,000.00	6,973,435.55	
US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	4,090,000.00	3,492,955.86	
US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	3,860,000.00	3,306,557.40	
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	2,795,269.53	
US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	220,000.00	189,096.87	
US TREASURY N/B-3.875%-27/11/30	2,320,000.00	2,299,020.30	
US TREASURY N/B-0.625%-27/12/31	3,960,000.00	3,396,550.76	
US TREASURY N/B-0.75%-28/01/31	2,850,000.00	2,454,061.52	
US TREASURY N/B-3.5%-28/01/31	1,450,000.00	1,415,137.69	
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	3,775,781.24	
US TREASURY N/B-1.125%-28/02/29	3,830,000.00	3,350,277.52	
US TREASURY N/B-1.25%-28/03/31	960,000.00	843,318.74	
US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	3,370,000.00	2,955,266.19	
US TREASURY N/B-3.5%-28/04/30	3,000,000.00	2,928,984.36	
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	2,440,000.00	2,312,853.11	
US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	4,300,000.00	3,763,339.83	
US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	3,300,000.00	2,883,052.72	
US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	2,920,000.00	2,512,454.69	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	3,973,101.55	
US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	3,900,000.00	3,370,529.29	
US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	4,000,000.00	3,473,593.76	
US TREASURY N/B-1.375%-28/10/31	4,000,000.00	3,492,500.00	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,131,106.95	
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	4,210,000.00	4,026,963.68	
US TREASURY N/B-1.5%-28/11/30	5,580,000.00	4,897,212.89	
US TREASURY N/B-1.375%-28/12/31	870,000.00	757,035.93	

US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,590,000.00	4,268,968.92	
US TREASURY N/B-2.375%-29/03/31	4,630,000.00	4,243,865.22	
US TREASURY N/B-2.875%-29/04/30	2,000,000.00	1,883,281.24	
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	4,810,000.00	4,403,310.74	
US TREASURY N/B-3.25%-29/06/30	4,980,000.00	4,783,328.89	
US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	4,370,000.00	3,823,579.30	
US TREASURY N/B-4.0%-29/10/31	1,920,000.00	1,923,524.92	
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	7,190,000.00	6,328,885.19	
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	3,733,247.64	
US TREASURY N/B-4.0%-30/02/28	1,650,000.00	1,656,058.46	
US TREASURY N/B-3.625%-30/03/31	2,550,000.00	2,504,976.56	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,208,814.03	
US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	4,590,000.00	3,687,060.93	
US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	5,090,000.00	4,064,643.37	
US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	6,110,000.00	4,958,766.20	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	560,000.00	616,175.00	
US TREASURY N/B-1.125%-31/02/15	4,400,000.00	3,629,656.27	
US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	6,930,000.00	5,897,944.34	
US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	7,130,000.00	5,854,537.68	
US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	6,830,000.00	5,634,082.98	
US TREASURY N/B-1.875%-32/02/15	6,240,000.00	5,350,312.53	
US TREASURY N/B-2.875%-32/05/15	4,800,000.00	4,455,281.23	
US TREASURY N/B-2.75%-32/08/15	5,100,000.00	4,680,744.14	
US TREASURY N/B-4.125%-32/11/15	6,110,000.00	6,255,589.69	
US TREASURY N/B-3.5%-33/02/15	2,110,000.00	2,058,239.05	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	863,640.56	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	849,213.82	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	712,463.86	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	720,000.00	774,435.88	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	765,921.87	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	1,514,740.18	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	1,526,222.53	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	793,535.10	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	740,376.52	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	1,678,940.62	

US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	2,392,931.63	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,427,118.75	
US TREASURY N/B-1.125%-40/08/15	3,000,000.00	1,923,046.86	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	1,048,427.26	
US TREASURY N/B-1.375%-40/11/15	3,100,000.00	2,067,675.78	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	1,653,105.45	
US TREASURY N/B-1.875%-41/02/15	4,200,000.00	3,043,195.30	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	914,145.62	
US TREASURY N/B-2.25%-41/05/15	4,900,000.00	3,767,066.39	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	926,474.99	
US TREASURY N/B-1.75%-41/08/15	3,190,000.00	2,235,118.35	
US TREASURY N/B-2.0%-41/11/15	3,000,000.00	2,188,945.32	
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	438,183.59	
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	657,625.00	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	1,640,937.50	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	1,765,000.00	1,536,239.44	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	1,710,789.06	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	1,950,000.00	1,830,486.33	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	1,996,603.12	
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	1,080,000.00	1,011,023.43	
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,200,000.00	1,979,570.31	
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	2,150,000.00	1,855,466.79	
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	2,100,000.00	1,771,875.00	
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	2,820,000.00	2,174,484.37	
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	1,400,000.00	1,178,843.75	
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	1,390,000.00	1,143,519.33	
US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	1,190,000.00	1,000,529.68	
US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	1,500,000.00	1,150,839.84	
US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	1,500,000.00	1,149,550.78	
US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	1,565,888.66	
US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	1,540,000.00	1,265,386.72	
US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,000,000.00	1,679,453.12	
US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	1,780,000.00	1,495,130.47	
US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	1,603,750.00	
US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,740,000.00	1,395,806.25	

		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	2,310,429.68	
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	2,063,343.74	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	3,446,402.35	
		US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	2,656,382.81	
		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	2,779,476.54	
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	2,469,843.75	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,950,000.00	2,131,951.16	
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	2,303,082.03	
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	2,520,046.87	
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	2,450,000.00	1,367,454.09	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,920,000.00	1,682,821.07	
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	3,000,000.00	1,848,164.07	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	4,750,000.00	3,118,857.41	
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	4,100,000.00	3,027,593.75	
		US TREASURY N/B-2.0%-51/08/15	2,000,000.00	1,352,187.50	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/11/15	1,400,000.00	915,851.56	
		US TREASURY N/B-2.25%-52/02/15	2,000,000.00	1,433,867.18	
		US TREASURY N/B-2.875%-52/05/15	300,000.00	246,826.17	
		US TREASURY N/B-3.0%-52/08/15	1,100,000.00	928,919.92	
		US TREASURY N/B-4.0%-52/11/15	1,000,000.00	1,021,250.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-53/02/15	2,900,000.00	2,766,781.25	
		US TREASURY N/B-3.625%-53/05/15	1,000,000.00	955,156.25	
米ドル小計			604,740,000.00	539,837,881.29	(75,787,840,154)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	610,000.00	596,122.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-24/08/01	650,000.00	634,610.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-24/09/01	795,000.00	764,033.16	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-24/10/01	800,000.00	759,645.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-24/11/01	600,000.00	585,599.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-25/02/01	550,000.00	541,941.95	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	710,000.00	671,811.94	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-25/04/01	760,000.00	720,125.08	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-25/05/01	530,000.00	522,580.53	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	950,000.00	911,628.55	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-25/09/01	1,855,000.00	1,704,997.28	

		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	995,000.00	896,667.13	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	770,000.00	716,876.16	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-26/09/01	1,090,000.00	994,660.97	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	520,000.00	473,752.24	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	850,000.00	766,416.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-27/09/01	620,000.00	595,493.26	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-28/03/01	500,000.00	495,665.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	897,000.00	834,077.24	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	540,000.00	604,410.12	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	364,000.00	340,136.52	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	2,098,000.00	1,814,293.75	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-30/12/01	1,405,000.00	1,134,760.89	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	1,966,000.00	1,702,152.97	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/12/01	1,950,000.00	1,674,946.65	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-32/06/01	1,070,000.00	953,204.15	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-32/12/01	890,000.00	824,915.19	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	710,000.00	848,525.26	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	340,000.00	400,363.94	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	600,000.00	649,215.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	730,000.00	747,565.26	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	750,000.00	679,587.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	2,293,000.00	1,752,700.41	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-53/12/01	1,131,000.00	803,650.14	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-55/12/01	200,000.00	179,064.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	295,796.62	
		加ドル小計	32,424,000.00	29,591,992.76 (3,116,036,837)	
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	18,900,000.00	18,291,656.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	16,700,000.00	16,553,875.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-25/03/06	3,700,000.00	3,394,750.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	24,250,000.00	22,006,875.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	9,550,000.00	8,427,875.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	21,600,000.00	20,425,500.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	16,670,000.00	16,383,484.37	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	22,400,000.00	21,014,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-33/05/26	5,500,000.00	5,017,031.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	5,300,000.00	4,889,250.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	4,400,000.00	4,797,375.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	12,970,000.00	12,422,828.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	13,200,000.00	11,632,500.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	13,570,000.00	12,221,481.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-53/07/31	6,300,000.00	5,628,656.25	
		メキシコペソ小計	195,010,000.00	183,107,137.49 (1,498,786,852)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	270,000.00	104,347.98	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	810,000.00	803,843.59	
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	670,000.00	646,292.72	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,185,000.00	1,133,991.67	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	640,000.00	666,227.20	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	852,000.00	805,544.06	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	830,000.00	766,072.57	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	545,000.00	482,479.78	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,070,000.00	1,197,688.45	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	900,000.00	816,786.00	
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	1,060,000.00	949,191.57	
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	800,000.00	660,804.00	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	1,000,000.00	862,416.00	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-31/10/22	750,000.00	586,655.81	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	565,000.00	606,968.20	
		BELGIUM KINGDOM-0.35%-32/06/22	615,000.00	486,010.19	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	525,000.00	447,868.44	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-33/06/22	180,000.00	178,189.16	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	543,000.00	534,594.35	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,080,000.00	1,264,939.20	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	425,000.00	336,662.90	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	485,000.00	401,393.76	
		BELGIUM KINGDOM-2.75%-39/04/22	160,000.00	147,133.28	

BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	330,000.00	201,783.12	
BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,112,000.00	1,229,237.04	
BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	645,000.00	671,464.35	
BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	658,000.00	456,573.04	
BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	650,000.00	447,096.00	
BELGIUM KINGDOM-1.4%-53/06/22	485,000.00	297,558.65	
BELGIUM KINGDOM-3.3%-54/06/22	335,000.00	316,786.05	
BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	412,000.00	312,032.32	
BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	446,000.00	317,954.29	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 71/10/31	345,000.00	160,498.14	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 24/05/31	1,000,000.00	968,411.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%- 24/07/30	1,100,000.00	1,062,723.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%- 24/10/31	1,420,000.00	1,412,965.32	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 25/01/31	1,350,000.00	1,282,493.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	1,350,000.00	1,311,325.74	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	1,490,000.00	1,534,184.46	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,455,000.00	1,423,586.55	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 26/01/31	1,455,000.00	1,341,159.34	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,055,000.00	1,020,844.37	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.8%- 26/05/31	85,000.00	84,068.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,360,000.00	1,469,409.28	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	1,720,000.00	1,622,235.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 27/01/31	755,000.00	675,223.29	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,475,000.00	1,390,090.15	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%-	1,315,000.00	1,198,793.45	

27/07/30			
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	1,400,000.00	1,305,724.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 28/01/31	1,010,000.00	875,968.96	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	1,270,000.00	1,173,234.89	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/07/30	1,275,000.00	1,173,063.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,095,000.00	1,202,063.62	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	1,545,000.00	1,771,123.11	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 29/04/30	1,495,000.00	1,361,788.02	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%- 29/10/31	1,550,000.00	1,325,119.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 30/04/30	1,400,000.00	1,171,935.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,330,000.00	1,225,540.47	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%- 30/10/31	1,330,000.00	1,160,294.55	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%- 31/04/30	1,325,000.00	1,039,732.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 31/10/31	1,235,000.00	987,350.39	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.7%- 32/04/30	1,340,000.00	1,074,698.76	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,450,000.00	1,726,759.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.55%- 32/10/31	975,000.00	912,020.85	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%- 33/04/30	1,025,000.00	1,002,460.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	1,165,000.00	1,059,614.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%- 35/07/30	1,195,000.00	995,642.93	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%- 37/01/31	1,250,000.00	1,320,878.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.85%-	670,000.00	460,870.11	

37/07/30		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.9%- 39/07/30	200,000.00	201,552.26
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	1,045,000.00	1,187,730.28
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%- 40/10/31	1,000,000.00	669,380.19
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%- 41/07/30	1,265,000.00	1,405,788.17
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%- 42/07/30	390,000.00	241,062.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 43/07/30	300,000.00	280,024.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	930,000.00	1,097,372.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%- 46/10/31	1,060,000.00	899,446.04
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%- 48/10/31	985,000.00	793,432.27
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%- 50/10/31	1,170,000.00	606,656.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.9%- 52/10/31	560,000.00	359,079.28
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	848,000.00	747,646.01
BUNDESobligation-0.0%-24/10/18	1,360,000.00	1,304,483.78
BUNDESobligation-0.0%-25/04/11	1,300,000.00	1,231,947.60
BUNDESobligation-0.0%-25/10/10	2,045,000.00	1,915,087.28
BUNDESobligation-0.0%-26/04/10	1,600,000.00	1,482,073.60
BUNDESobligation-0.0%-27/04/16	1,250,000.00	1,133,481.25
BUNDESobligation-1.3%-27/10/15	1,130,000.00	1,073,290.94
BUNDESobligation-2.2%-28/04/13	225,000.00	221,801.85
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 24/08/15	1,790,000.00	1,746,095.77
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	1,990,000.00	1,908,933.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	2,070,000.00	1,988,137.71
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	1,820,000.00	1,715,092.16
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-	2,700,000.00	2,484,764.10

26/08/15		
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	2,795,000.00	2,569,426.73
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	910,000.00	1,045,967.65
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	1,770,000.00	1,629,968.22
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 27/11/15	1,565,000.00	1,402,795.57
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	650,000.00	737,129.25
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	1,690,000.00	1,544,127.65
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	970,000.00	1,074,563.09
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 28/08/15	1,670,000.00	1,492,958.29
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 28/11/15	1,180,000.00	1,035,332.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 29/02/15	1,875,000.00	1,660,513.12
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 29/08/15	1,830,000.00	1,579,227.78
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	660,000.00	811,613.22
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/02/15	1,490,000.00	1,271,610.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/08/15	1,920,000.00	1,620,965.76
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/08/15	740,000.00	625,779.52
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,110,000.00	1,342,989.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/02/15	2,000,000.00	1,668,272.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/08/15	1,565,000.00	1,290,624.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/08/15	400,000.00	330,270.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 32/02/15	1,623,000.00	1,322,013.02
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.7%-	1,680,000.00	1,582,182.00

32/08/15			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.3%- 33/02/15	1,260,000.00	1,243,538.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,475,000.00	1,794,122.15	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 35/05/15	1,200,000.00	890,799.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 36/05/15	1,000,000.00	719,538.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	1,790,000.00	2,076,120.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 38/05/15	50,000.00	40,038.45	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,235,000.00	1,492,034.37	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,355,000.00	1,743,318.61	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	955,000.00	1,041,172.51	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,635,000.00	1,607,221.35	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	2,197,000.00	2,172,767.09	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	2,040,000.00	1,560,375.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	1,580,000.00	807,838.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	640,000.00	328,439.68	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 52/08/15	750,000.00	363,356.28	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%- 53/08/15	740,000.00	618,881.98	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.2%-24/06/14	760,000.00	737,891.60	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.2%-24/12/12	240,000.00	236,849.28	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.5%-25/03/13	680,000.00	673,807.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 72/03/01	300,000.00	171,431.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.75%- 24/07/01	780,000.00	765,851.77	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/08/15	570,000.00	547,647.56	

BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%- 24/09/01	1,250,000.00	1,253,940.37	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 24/11/15	1,260,000.00	1,225,323.06	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01	1,080,000.00	1,065,222.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/12/15	870,000.00	826,393.86	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 25/02/01	1,485,000.00	1,412,249.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	1,540,000.00	1,578,747.94	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 25/05/15	855,000.00	823,625.77	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	1,300,000.00	1,251,793.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 25/07/01	1,000,000.00	968,551.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 25/11/15	1,100,000.00	1,076,285.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	1,085,000.00	1,047,966.78	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 26/01/15	600,000.00	600,036.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 26/02/01	850,000.00	786,637.88	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,330,000.00	1,364,687.73	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 26/04/01	1,220,000.00	1,107,813.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%- 26/04/15	950,000.00	957,077.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,330,000.00	1,260,283.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%- 26/07/15	1,220,000.00	1,171,494.02	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 26/08/01	870,000.00	781,220.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	720,000.00	806,144.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,080,000.00	1,003,038.12	

BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%- 27/01/15	1,180,000.00	1,076,990.81
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.1%- 27/04/01	410,000.00	375,549.24
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	1,160,000.00	1,105,663.28
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	995,000.00	940,291.91
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 27/09/15	1,275,000.00	1,148,713.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	1,560,000.00	1,750,626.54
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.65%- 27/12/01	950,000.00	915,994.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	1,650,000.00	1,543,357.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%- 28/03/15	1,230,000.00	1,054,817.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 28/07/15	1,130,000.00	970,137.77
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,330,000.00	1,403,326.89
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 28/12/01	1,030,000.00	989,799.10
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 29/02/15	1,125,000.00	942,379.65
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 29/08/01	2,025,000.00	1,952,547.52
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	1,750,000.00	1,909,281.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 29/12/15	535,000.00	538,068.69
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,620,000.00	1,601,112.42
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 30/04/01	1,075,000.00	922,469.32
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 30/08/01	1,167,000.00	963,415.68
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 30/12/01	1,287,000.00	1,108,800.69
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 31/04/01	1,375,000.00	1,107,954.37

BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	1,515,000.00	1,742,165.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%- 31/08/01	1,260,000.00	978,505.92
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 31/10/30	290,000.00	293,167.61
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 31/12/01	1,010,000.00	799,879.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,610,000.00	1,350,071.94
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 32/06/01	1,200,000.00	936,061.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 32/12/01	480,000.00	426,196.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,475,000.00	1,681,054.55
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.4%- 33/05/01	315,000.00	325,586.52
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	1,365,000.00	1,188,176.53
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	1,580,000.00	1,700,822.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	980,000.00	906,299.35
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 35/04/30	400,000.00	393,788.03
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 36/03/01	900,000.00	658,983.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	965,000.00	775,581.11
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	2,005,000.00	1,958,081.05
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 37/03/01	400,000.00	266,600.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	1,120,000.00	954,772.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,500,000.00	1,612,869.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%- 40/03/01	810,000.00	691,545.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,070,000.00	1,152,480.09

BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%- 41/03/01	830,000.00	574,307.71
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.45%- 43/09/01	300,000.00	300,018.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,165,000.00	1,215,663.52
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 45/04/30	440,000.00	266,494.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	1,020,000.00	856,653.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	970,000.00	738,622.02
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	1,135,000.00	977,799.09
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 49/09/01	850,000.00	776,861.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 50/09/01	870,000.00	607,870.74
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%- 51/09/01	850,000.00	497,057.05
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 52/09/01	280,000.00	178,829.61
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 53/10/01	200,000.00	199,930.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	630,000.00	437,230.08
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-24/09/15	255,000.00	245,151.13
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	332,000.00	338,193.46
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	280,000.00	267,310.12
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	335,000.00	313,355.98
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-26/09/15	100,000.00	91,111.10
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-27/04/15	170,000.00	160,820.34
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	400,000.00	362,601.64
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	378,631.62
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	239,336.64
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	375,000.00	324,425.10
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-30/09/15	172,000.00	139,592.44
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	535,000.00	453,861.90
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-31/09/15	150,000.00	119,211.07
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-32/09/15	230,000.00	202,379.76

FINNISH GOVERNMENT-3.0%-33/09/15	110,000.00	109,480.36	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	325,000.00	266,695.81	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	278,000.00	188,521.25	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-38/04/15	210,000.00	197,182.35	
FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15	263,000.00	160,166.31	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	277,000.00	254,231.15	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-43/04/15	235,000.00	141,904.75	
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	184,352.03	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-52/04/15	250,000.00	111,529.93	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	515,000.00	189,373.85	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	2,383,000.00	2,335,702.21	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/02/25	375,000.00	355,732.12	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/03/25	2,865,000.00	2,712,129.33	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	2,610,000.00	2,483,584.15	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	2,090,000.00	2,229,866.14	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	2,070,000.00	1,974,208.68	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-26/02/25	2,040,000.00	1,885,788.24	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	2,730,000.00	2,770,360.32	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,450,000.00	2,284,056.60	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-26/09/24	200,000.00	197,127.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,820,000.00	2,578,763.10	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-27/02/25	1,445,000.00	1,301,410.35	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	2,275,000.00	2,119,471.90	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,250,000.00	3,238,491.75	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/02/25	1,275,000.00	1,159,363.87	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	3,835,000.00	3,472,166.81	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	3,030,000.00	2,718,076.65	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	2,105,000.00	2,403,333.23	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	2,990,000.00	2,617,882.54	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-29/11/25	2,580,000.00	2,158,621.50	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	3,065,000.00	3,006,793.53	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-30/11/25	3,049,000.00	2,475,565.42	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	3,290,000.00	2,986,027.03	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-31/11/25	2,605,000.00	2,052,034.04	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-32/05/25	2,228,000.00	1,725,267.39	

FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	2,085,000.00	2,559,885.85	
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-32/11/25	1,895,000.00	1,750,389.39	
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-33/05/25	150,000.00	150,239.85	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-34/05/25	2,575,000.00	2,145,644.50	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	1,665,000.00	1,929,641.76	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-36/05/25	2,555,000.00	2,034,464.74	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	1,590,000.00	1,730,363.61	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-39/06/25	2,060,000.00	1,677,736.10	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	2,780,000.00	3,215,787.24	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-43/05/25	135,000.00	117,642.78	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-44/06/25	1,160,000.00	667,730.80	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	1,730,000.00	1,696,289.22	
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-48/05/25	1,830,000.00	1,407,295.62	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-50/05/25	1,960,000.00	1,317,488.48	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-52/05/25	1,500,000.00	785,148.00	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-53/05/25	1,020,000.00	520,123.50	
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-54/05/25	370,000.00	337,943.57	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	1,300,000.00	1,444,729.00	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	1,070,000.00	1,201,236.57	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-66/05/25	945,000.00	616,788.27	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	580,000.00	603,944.72	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	595,000.00	564,720.56	
IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15	327,000.00	295,979.08	
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	455,000.00	416,293.15	
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	600,000.00	546,161.40	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	546,000.00	535,033.04	
IRISH TREASURY-0.2%-30/10/18	282,000.00	234,466.64	
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	475,000.00	430,502.00	
IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	485,000.00	386,579.92	
IRISH TREASURY-0.35%-32/10/18	205,000.00	164,038.56	
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	285,000.00	246,071.10	
IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	310,000.00	231,191.80	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	390,000.00	326,970.15	
IRISH TREASURY-0.55%-41/04/22	185,000.00	118,066.63	
IRISH TREASURY-3.0%-43/10/18	170,000.00	164,112.13	

IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	541,000.00	430,098.24	
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	444,000.00	302,269.42	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	989,000.00	976,409.04	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,035,000.00	978,679.85	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-26/01/15	455,000.00	422,488.43	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,100,000.00	1,025,187.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	898,000.00	813,668.37	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	925,000.00	854,626.92	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	775,000.00	865,211.55	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	961,000.00	872,898.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	620,000.00	533,770.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	645,000.00	557,829.54	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-30/01/15	100,000.00	98,573.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-30/07/15	785,000.00	650,896.09	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-31/07/15	775,000.00	625,511.72	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-32/07/15	700,000.00	576,056.42	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	855,000.00	837,186.07	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/07/15	220,000.00	215,346.56	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,025,000.00	1,149,610.27	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-38/01/15	395,000.00	259,642.98	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	888,000.00	610,639.41	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,017,000.00	1,141,166.54	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,104,000.00	1,089,770.54	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	907,000.00	419,985.25	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-54/01/15	365,000.00	304,528.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.7%-71/04/20	200,000.00	85,843.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	173,000.00	99,165.33	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	403,000.00	282,802.02	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.85%-99/99/99	192,000.00	75,454.01	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-24/07/15	555,000.00	536,357.55	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	705,000.00	691,349.08	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-25/04/20	475,000.00	449,207.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	710,000.00	681,817.97	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	550,000.00	576,918.65	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.0%-26/07/15	140,000.00	136,237.01	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	963,000.00	897,604.59	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	626,359.26	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	540,000.00	608,355.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	660,000.00	598,559.28	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-28/10/20	230,000.00	197,266.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	885,000.00	773,514.18	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-29/05/23	150,000.00	149,825.10	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	680,000.00	559,312.46	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-31/02/20	745,000.00	593,550.44	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.9%-32/02/20	530,000.00	444,286.81	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-33/02/20	415,000.00	408,392.37	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	455,000.00	424,727.48	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-36/10/20	270,000.00	183,526.02	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	840,000.00	921,599.28	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	345,000.00	197,510.43	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	394,000.00	386,713.78	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	503,000.00	360,347.18	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.85%-49/05/23	200,000.00	151,913.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	455,000.00	253,294.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	245,000.00	275,655.13	
		ユーロ小計	364,539,000.00	334,987,533.88 (50,968,353,279)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	760,000.00	353,331.60	
		UK TREASURY-1.125%-73/10/22	513,000.00	186,087.67	
		UK TREASURY-2.75%-24/09/07	735,000.00	715,092.37	
		UK TREASURY-0.25%-25/01/31	1,590,000.00	1,470,988.50	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,205,000.00	1,204,093.84	
		UK TREASURY-0.625%-25/06/07	813,000.00	749,566.48	
		UK TREASURY-3.5%-25/10/22	810,000.00	779,498.58	
		UK TREASURY-0.125%-26/01/30	710,000.00	630,231.50	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	820,000.00	744,745.32	
		UK TREASURY-0.375%-26/10/22	1,260,000.00	1,087,821.00	
		UK TREASURY-4.125%-27/01/29	1,495,000.00	1,455,158.25	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	840,000.00	735,630.00	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	850,000.00	837,255.10	

UK TREASURY-0.125%-28/01/31	745,000.00	608,590.50	
UK TREASURY-1.625%-28/10/22	720,000.00	623,357.85	
UK TREASURY-6.0%-28/12/07	710,000.00	759,806.50	
UK TREASURY-0.5%-29/01/31	995,000.00	796,752.61	
UK TREASURY-0.875%-29/10/22	856,000.00	690,357.83	
UK TREASURY-0.375%-30/10/22	920,000.00	691,012.00	
UK TREASURY-4.75%-30/12/07	945,000.00	968,685.48	
UK TREASURY-0.25%-31/07/31	1,445,000.00	1,041,483.75	
UK TREASURY-1.0%-32/01/31	1,645,000.00	1,249,967.71	
UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,370,000.00	1,363,843.22	
UK TREASURY-3.25%-33/01/31	455,000.00	414,209.25	
UK TREASURY-0.875%-33/07/31	840,000.00	599,542.59	
UK TREASURY-4.5%-34/09/07	849,000.00	853,632.14	
UK TREASURY-0.625%-35/07/31	1,097,000.00	704,284.97	
UK TREASURY-4.25%-36/03/07	970,000.00	947,271.73	
UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,350,000.00	955,496.52	
UK TREASURY-3.75%-38/01/29	255,000.00	232,075.50	
UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,060,000.00	1,080,882.00	
UK TREASURY-1.125%-39/01/31	300,000.00	185,096.28	
UK TREASURY-4.25%-39/09/07	970,000.00	932,829.60	
UK TREASURY-4.25%-40/12/07	935,000.00	897,545.02	
UK TREASURY-1.25%-41/10/22	1,360,000.00	802,271.48	
UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,090,000.00	1,076,872.04	
UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,175,000.00	964,399.58	
UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,160,000.00	984,621.92	
UK TREASURY-0.875%-46/01/31	435,000.00	209,474.25	
UK TREASURY-4.25%-46/12/07	920,000.00	872,712.00	
UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,230,000.00	679,632.07	
UK TREASURY-1.75%-49/01/22	675,000.00	389,754.45	
UK TREASURY-4.25%-49/12/07	895,000.00	848,241.97	
UK TREASURY-0.625%-50/10/22	660,000.00	259,035.74	
UK TREASURY-1.25%-51/07/31	600,000.00	288,526.56	
UK TREASURY-3.75%-52/07/22	872,000.00	758,952.87	
UK TREASURY-1.5%-53/07/31	580,000.00	292,867.52	
UK TREASURY-3.75%-53/10/22	390,000.00	337,740.00	

		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	925,000.00	480,149.00	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	962,000.00	919,758.58	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	572,007.50	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	751,000.00	692,753.94	
		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	1,050,000.00	307,230.00	
		UK TREASURY-4.0%-63/10/22	210,000.00	193,637.11	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	830,000.00	689,167.26	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	605,000.00	567,878.41	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	882,000.00	567,126.00	
英ボンド小計			51,165,000.00	41,301,033.51	(7,340,019,675)
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,420,000.00	4,368,069.11	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	4,700,000.00	4,431,052.27	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,550,000.00	3,256,269.87	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	3,780,000.00	3,399,484.37	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	2,700,000.00	2,254,319.10	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,800,000.00	1,774,115.40	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.75%-33/11/11	1,200,000.00	1,129,701.01	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	2,785,000.00	3,114,298.40	
スウェーデンクローナ小計			24,935,000.00	23,727,309.53	(310,590,481)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,190,000.00	3,081,447.49	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,400,000.00	2,268,384.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,400,000.00	2,249,623.20	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,040,000.00	1,898,275.48	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	2,250,000.00	2,027,841.75	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	2,950,000.00	2,546,693.70	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.25%-31/09/17	2,040,000.00	1,704,940.20	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.125%-32/05/18	1,900,000.00	1,690,354.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-33/08/15	1,450,000.00	1,382,753.35	
ノルウェークローネ小計			20,620,000.00	18,850,313.17	(248,070,121)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-0.0%-24/11/15	1,930,000.00	1,845,017.90	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	3,170,000.00	3,079,664.82	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	4,160,000.00	3,784,593.28	

		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	3,130,000.00	2,735,046.58	
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-31/11/15	1,350,000.00	1,081,693.17	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	8,550,000.00	10,422,314.05	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	1,300,000.00	660,105.34	
デンマーククローネ小計			23,590,000.00	23,608,435.14	(482,084,245)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-24/07/25	310,000.00	290,665.09	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	2,520,000.00	2,398,309.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	1,440,000.00	1,313,064.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,570,000.00	2,437,413.70	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,590,000.00	2,349,026.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,950,000.00	1,624,291.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	960,000.00	892,780.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,140,000.00	1,887,822.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,160,000.00	1,884,621.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-7.5%-28/07/25	920,000.00	984,832.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	555,000.00	552,613.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	2,665,000.00	2,242,597.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	2,025,000.00	1,477,035.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-32/04/25	1,870,000.00	1,338,751.70	
POLAND GOVERNMENT BOND-6.0%-33/10/25	230,000.00	229,645.80			
ポーランドズロチ小計			24,905,000.00	21,903,470.59	(748,233,507)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-24/11/21	1,485,000.00	1,404,661.94	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	1,060,000.00	1,044,395.96	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	950,000.00	869,077.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	1,050,000.00	1,059,234.33	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,310,000.00	1,174,565.84	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,170,000.00	1,205,746.19	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	980,000.00	935,692.83	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	750,000.00	695,847.13	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	720,000.00	680,710.29	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,080,000.00	1,044,462.89	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	990,000.00	925,643.67	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,300,000.00	1,189,282.41	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	1,180,000.00	956,337.33	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,378,000.00	1,147,837.29	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,725,000.00	1,361,692.78	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,580,000.00	1,259,457.19	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	1,370,000.00	1,132,307.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,190,000.00	1,240,622.71	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-33/11/21	1,030,000.00	943,602.38	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-34/05/21	750,000.00	733,400.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.5%-34/12/21	740,000.00	704,381.53	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	530,000.00	464,967.95	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	550,000.00	527,837.07	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	582,000.00	516,915.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	790,000.00	640,595.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	720,000.00	581,164.88	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	1,020,000.00	599,687.55	
豪ドル小計			27,980,000.00	25,040,128.39	(2,388,077,044)
ニュー ジーラン ドル	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-25/04/15	590,000.00	566,003.62	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.5%-26/05/15	135,000.00	119,784.27	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-27/04/15	700,000.00	698,262.13	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.25%-28/05/15	370,000.00	301,475.61	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.0%-29/04/20	680,000.00	628,201.82	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.5%-31/05/15	350,000.00	280,739.35	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.0%-32/05/15	100,000.00	81,607.70	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.5%-33/04/14	300,000.00	275,363.02	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.25%-34/05/15	120,000.00	116,686.45	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-37/04/15	380,000.00	306,435.25	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.75%-41/05/15	115,000.00	73,801.08	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-51/05/15	500,000.00	353,120.32	
ニュージーランドドル小計			4,340,000.00	3,801,480.62	(330,462,710)
シンガ ポールド ル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-72/08/01	140,000.00	165,830.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	535,572.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	580,000.00	568,455.10	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-25/11/01	229,000.00	214,298.20	

		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	470,000.00	454,725.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-26/11/01	205,000.00	192,085.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	533,000.00	538,863.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-27/09/01	110,000.00	109,120.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	290,000.00	284,545.10	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	415,000.00	411,265.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	540,000.00	534,870.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-31/07/01	300,000.00	270,300.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-32/08/01	170,000.00	164,939.10	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	335,000.00	347,127.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	451,000.00	421,685.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	220,000.00	209,011.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	352,000.00	359,147.35	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	332,000.00	345,778.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	367,000.00	325,896.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-51/10/01	222,000.00	200,509.29	
		シンガポールドル小計	6,801,000.00	6,654,021.14	(695,877,530)
マレーシア アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.478%-24/06/14	775,000.00	776,588.75	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	830,000.00	837,926.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	770,000.00	776,968.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,550,000.00	1,569,607.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	680,000.00	689,078.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	1,170,000.00	1,186,965.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,200,000.00	1,217,400.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.504%-29/04/30	200,000.00	209,100.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,320,000.00	1,335,840.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	985,000.00	910,632.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	749,632.59	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,100,000.00	1,092,300.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	960,000.00	986,880.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,170,000.00	1,261,260.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	590,000.00	649,000.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	1,490,000.00	1,430,400.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.696%-42/10/15	500,000.00	539,500.00	

		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	660,000.00	729,301.71	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	620,000.00	669,251.99	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	510,000.00	568,140.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	1,560,000.00	1,529,580.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.457%-53/03/31	430,000.00	453,112.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	800,000.00	807,640.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	750,000.00	768,965.25	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	330,000.00	333,329.60	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	949,050.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,510,000.00	1,520,570.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	910,000.00	956,261.94	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,066,022.26	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	1,180,000.00	1,182,571.10	
		マレーシアリングット小計	27,235,000.00	27,752,875.69	(842,555,103)
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-2.47%-24/09/02	11,000,000.00	11,059,658.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.94%-24/10/17	32,000,000.00	32,398,576.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.26%-25/02/24	4,000,000.00	4,009,231.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.99%-25/04/09	22,000,000.00	21,954,417.10	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-25/08/25	15,000,000.00	14,997,855.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	32,000,000.00	32,641,936.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	17,000,000.00	17,381,500.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	16,000,000.00	16,194,696.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-26/12/05	23,000,000.00	23,635,306.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	25,000,000.00	25,470,725.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.28%-27/12/03	21,000,000.00	21,835,443.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	12,000,000.00	12,337,014.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	22,000,000.00	22,498,652.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-29/05/23	14,000,000.00	14,642,070.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-29/09/25	24,000,000.00	24,048,216.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	21,000,000.00	21,117,356.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	8,000,000.00	8,412,296.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	10,000,000.00	10,281,196.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	11,000,000.00	11,068,193.95	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.76%-32/05/15	9,000,000.00	9,060,642.00	

		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-32/08/15	9,000,000.00	9,007,731.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-32/09/01	13,000,000.00	12,914,024.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-32/11/15	6,000,000.00	6,065,109.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	8,000,000.00	9,078,812.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	7,000,000.00	7,834,606.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.53%-51/10/18	10,000,000.00	10,856,500.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.32%-52/04/15	10,000,000.00	10,479,320.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-52/10/25	8,000,000.00	8,139,280.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-53/04/15	2,000,000.00	2,076,549.00	
中国元小計			422,000,000.00	431,496,914.15 (8,454,448,488)	
イスラエル シュケ ル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-0.4%-24/10/31	800,000.00	758,522.63	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-25/04/30	1,360,000.00	1,269,317.67	
		ISRAEL FIXED BOND-1.75%-25/08/31	1,190,000.00	1,129,471.60	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-26/02/27	530,000.00	482,088.29	
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	950,000.00	1,016,128.52	
		ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,270,000.00	1,187,067.43	
		ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,160,000.00	1,073,870.00	
		ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	1,515,000.00	1,267,378.81	
		ISRAEL FIXED BOND-1.3%-32/04/30	230,000.00	187,919.23	
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	1,050,000.00	779,749.16	
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,160,000.00	1,385,236.48	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,300,000.00	1,233,562.34	
		ISRAEL FIXED BOND-2.8%-52/11/29	240,000.00	184,778.74	
イスラエルシュケル小計			12,755,000.00	11,955,090.90 (468,382,528)	
合計				153,679,818,554 (153,679,818,554)	

(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 215銘柄	100.0%	49.2%

加ドル	国債証券	36銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券	15銘柄	100.0%	1.0%
ユーロ	国債証券	351銘柄	100.0%	33.2%
英ポンド	国債証券	57銘柄	100.0%	4.8%
スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.2%
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	7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券	27銘柄	100.0%	1.6%
ニュージーランドドル	国債証券	12銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券	20銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリンギット	国債証券	30銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券	29銘柄	100.0%	5.5%
イスラエルシェケル	国債証券	13銘柄	100.0%	0.3%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	396,330,315	122,739,645
株式	44,307,234,410	50,071,963,440
派生商品評価勘定	3,505,650	16,600,450
未収入金	16,539,700	594,922,650
未収配当金	7,495,575	382,602,772
流動資産合計	44,731,105,650	51,188,828,957
資産合計	44,731,105,650	51,188,828,957
負債の部		
流動負債		
前受金	4,360,000	17,872,000

	2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
未払解約金	45,741,225	340,654,800
未払利息	646	226
流動負債合計	50,101,871	358,527,026
負債合計	50,101,871	358,527,026
純資産の部		
元本等		
元本	22,694,142,047	21,889,552,957
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	21,986,861,732	28,940,748,974
元本等合計	44,681,003,779	50,830,301,931
純資産合計	44,681,003,779	50,830,301,931
負債純資産合計	44,731,105,650	51,188,828,957

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12月15日現在	2023年 6月15日現在
1. 期首	2022年 6月16日	2022年12月16日
期首元本額	22,429,103,841円	22,694,142,047円
期首からの追加設定元本額	1,185,829,090円	870,681,557円
期首からの一部解約元本額	920,790,884円	1,675,270,647円
元本の内訳		
DCインデックスバランス（株式20）	783,480,641円	769,024,455円
DCインデックスバランス（株式40）	2,126,221,759円	2,076,629,419円
DCインデックスバランス（株式60）	4,281,088,994円	4,277,847,008円
DCインデックスバランス（株式80）	4,679,696,456円	4,951,606,936円

	2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,740,586,733円	1,655,172,124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	3,215,724,391円	2,847,628,025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）	566,179,113円	526,361,865円
Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	- 円	430,539円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	2,335,766,487円	1,990,867,816円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	236,743,507円	225,725,780円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	672,027,613円	614,384,448円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,030,656,811円	976,734,427円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,025,969,542円	977,140,115円
計	22,694,142,047円	21,889,552,957円
2. 受益権の総数	22,694,142,047口	21,889,552,957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	582,415,000円	727,360,000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 2022年 6月16日 至 2022年12月15日	自 2022年12月16日 至 2023年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

	自 2022年 6月16日 至 2022年12月15日	自 2022年12月16日 至 2023年 6月15日
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

	2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2022年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,262,989,709
合計	1,262,989,709

(2023年 6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	8,182,417,023

合計	8,182,417,023
----	---------------

(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)

(2022年12月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	330,875,000	-	334,390,000	3,515,000
合計		330,875,000	-	334,390,000	3,515,000

(2023年 6月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	464,708,000	-	481,320,000	16,612,000
合計		464,708,000	-	481,320,000	16,612,000

(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)

2022年12月15日現在		2023年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	1.9688円	1口当たり純資産額	2.3221円
(1万口当たり純資産額)	(19,688円)	(1万口当たり純資産額)	(23,221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	3,650.00	2,920,000	
ニッスイ	21,500	646.00	13,889,000	
マルハニチロ	3,200	2,489.00	7,964,800	
雪国まいたけ	1,800	951.00	1,711,800	
カネコ種苗	700	1,473.00	1,031,100	
サカタのタネ	2,400	4,060.00	9,744,000	
ホクト	1,900	1,861.00	3,535,900	
ホクリヨウ	300	831.00	249,300	
住石ホールディングス	2,400	368.00	883,200	
日鉄鉱業	900	4,125.00	3,712,500	
三井松島ホールディングス	1,000	2,532.00	2,532,000	
I N P E X	79,100	1,597.00	126,322,700	
石油資源開発	2,500	4,290.00	10,725,000	
K & O エナジーグループ	1,000	2,409.00	2,409,000	
ショーボンドホールディングス	2,900	5,825.00	16,892,500	
ミライト・ワン	7,100	1,801.50	12,790,650	
サンヨーホームズ	300	715.00	214,500	
日本アクア	800	863.00	690,400	
ファーストコーポレーション	500	761.00	380,500	
ベステラ	500	1,262.00	631,000	
キャンディル	500	570.00	285,000	
ダイセキ環境ソリューション	400	1,045.00	418,000	
第一カッター興業	600	1,386.00	831,600	
安藤・間	12,500	1,089.00	13,612,500	
東急建設	6,300	734.00	4,624,200	
コムシスホールディングス	7,300	2,813.00	20,534,900	
ピーアールホールディングス	3,600	388.00	1,396,800	
高松コンストラクショングループ	1,400	2,447.00	3,425,800	
東建コーポレーション	600	7,200.00	4,320,000	
ソネック	300	980.00	294,000	
ヤマウラ	1,200	1,177.00	1,412,400	
オリエンタル白石	8,100	305.00	2,470,500	
大成建設	14,000	4,739.00	66,346,000	
大林組	53,600	1,182.50	63,382,000	
清水建設	45,100	886.70	39,990,170	
飛鳥建設	1,700	1,270.00	2,159,000	
長谷工コーポレーション	15,500	1,714.00	26,567,000	
松井建設	1,500	684.00	1,026,000	

銭高組	200	3,065.00	613,000
鹿島建設	33,200	2,100.50	69,736,600
不動テトラ	1,100	1,807.00	1,987,700
大末建設	500	1,286.00	643,000
鉄建建設	1,100	1,998.00	2,197,800
西松建設	2,600	3,501.00	9,102,600
三井住友建設	12,400	366.00	4,538,400
大豊建設	600	3,825.00	2,295,000
ナカノフドー建設	1,100	372.00	409,200
奥村組	2,500	4,060.00	10,150,000
東鉄工業	2,100	2,549.00	5,352,900
イチケン	300	1,904.00	571,200
富士ピー・エス	700	442.00	309,400
浅沼組	1,200	3,215.00	3,858,000
戸田建設	18,500	811.90	15,020,150
熊谷組	2,500	3,155.00	7,887,500
北野建設	200	2,971.00	594,200
植木組	400	1,341.00	536,400
矢作建設工業	2,100	1,149.00	2,412,900
ピーエス三菱	2,000	740.00	1,480,000
日本ハウスホールディングス	3,200	378.00	1,209,600
新日本建設	2,200	1,130.00	2,486,000
東亜道路工業	600	4,405.00	2,643,000
日本道路	300	8,900.00	2,670,000
東亜建設工業	1,300	3,030.00	3,939,000
日本国土開発	4,700	593.00	2,787,100
若築建設	700	3,100.00	2,170,000
東洋建設	5,000	1,033.00	5,165,000
五洋建設	21,300	773.30	16,471,290
福田組	600	4,790.00	2,874,000
住友林業	11,500	3,409.00	39,203,500
日本基礎技術	900	514.00	462,600
巴コーポレーション	1,500	461.00	691,500
大和ハウス工業	41,900	3,763.00	157,669,700
ライト工業	2,800	1,940.00	5,432,000
積水ハウス	45,400	2,747.00	124,713,800
日特建設	1,500	1,016.00	1,524,000
北陸電気工事	1,100	892.00	981,200
ユアテック	3,400	849.00	2,886,600
日本リーテック	1,400	1,364.00	1,909,600
四電工	700	2,172.00	1,520,400
中電工	2,400	2,250.00	5,400,000

関電工	8,300	1,110.00	9,213,000
きんでん	10,600	1,954.00	20,712,400
東京エネシス	1,600	996.00	1,593,600
トーエネック	500	3,670.00	1,835,000
住友電設	1,500	2,995.00	4,492,500
日本電設工業	2,500	1,864.00	4,660,000
エクシオグループ	6,900	2,816.50	19,433,850
新日本空調	900	2,227.00	2,004,300
九電工	3,700	4,090.00	15,133,000
三機工業	3,400	1,507.00	5,123,800
日揮ホールディングス	14,800	1,870.50	27,683,400
中外炉工業	500	2,041.00	1,020,500
ヤマト	1,100	917.00	1,008,700
太平電業	1,000	4,390.00	4,390,000
高砂熱学工業	3,600	2,424.00	8,726,400
三晃金属工業	200	4,270.00	854,000
朝日工業社	700	2,277.00	1,593,900
明星工業	2,700	979.00	2,643,300
大気社	1,700	3,995.00	6,791,500
ダイダン	1,000	2,685.00	2,685,000
日比谷総合設備	1,300	2,184.00	2,839,200
フィル・カンパニー	400	903.00	361,200
テスホールディングス	1,700	1,034.00	1,757,800
インフロニア・ホールディングス	15,800	1,327.00	20,966,600
東洋エンジニアリング	2,200	616.00	1,355,200
レイズネクスト	2,200	1,393.00	3,064,600
ニッポン	4,000	1,838.00	7,352,000
日清製粉グループ本社	13,900	1,852.50	25,749,750
日東富士製粉	300	4,760.00	1,428,000
昭和産業	1,300	2,705.00	3,516,500
鳥越製粉	900	619.00	557,100
中部飼料	2,100	1,089.00	2,286,900
フィード・ワン	2,200	730.00	1,606,000
東洋精糖	200	1,422.00	284,400
日本甜菜製糖	900	1,835.00	1,651,500
D M三井製糖ホールディングス	1,500	2,669.00	4,003,500
塩水港精糖	1,500	204.00	306,000
ウェルネオシュガー	800	1,943.00	1,554,400
森永製菓	2,700	4,612.00	12,452,400
中村屋	400	3,065.00	1,226,000
江崎グリコ	4,300	3,838.00	16,503,400
名糖産業	600	1,621.00	972,600

井村屋グループ	800	2,272.00	1,817,600
不二家	1,000	2,495.00	2,495,000
山崎製パン	10,100	2,017.50	20,376,750
第一屋製パン	200	387.00	77,400
モロゾフ	500	3,620.00	1,810,000
亀田製菓	1,000	4,210.00	4,210,000
寿スピリッツ	1,600	10,810.00	17,296,000
カルビー	6,900	2,793.50	19,275,150
森永乳業	2,700	4,970.00	13,419,000
六甲バター	1,100	1,332.00	1,465,200
ヤクルト本社	10,700	9,080.00	97,156,000
明治ホールディングス	18,400	3,220.00	59,248,000
雪印メグミルク	3,600	1,936.00	6,969,600
プリマハム	2,000	2,179.00	4,358,000
日本ハム	5,900	4,007.00	23,641,300
林兼産業	300	480.00	144,000
丸大食品	1,500	1,492.00	2,238,000
S Foods	1,700	3,250.00	5,525,000
柿安本店	600	2,302.00	1,381,200
伊藤ハム米久ホールディングス	11,500	724.00	8,326,000
サッポロホールディングス	4,900	3,750.00	18,375,000
アサヒグループホールディングス	34,700	5,752.00	199,594,400
キリンホールディングス	67,800	2,145.50	145,464,900
宝ホールディングス	10,300	1,075.00	11,072,500
オエノンホールディングス	4,500	365.00	1,642,500
養命酒製造	500	1,842.00	921,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,800	1,580.50	18,649,900
サントリー食品インターナショナル	10,600	5,432.00	57,579,200
ダイドーグループホールディングス	900	5,090.00	4,581,000
伊藤園	5,100	4,139.00	21,108,900
キーコーヒー	1,700	2,067.00	3,513,900
ユニカフェ	400	907.00	362,800
ジャパンフーズ	200	1,095.00	219,000
日清オイリオグループ	2,100	3,445.00	7,234,500
不二製油グループ本社	3,500	2,027.00	7,094,500
J - オイルミルズ	1,600	1,596.00	2,553,600
キッコーマン	10,000	8,416.00	84,160,000
味の素	36,300	5,734.00	208,144,200
ブルドックソース	800	1,995.00	1,596,000
キューピー	8,100	2,342.00	18,970,200
ハウス食品グループ本社	4,600	3,231.00	14,862,600
カゴメ	7,000	3,392.00	23,744,000

焼津水産化学工業	500	817.00	408,500
アリアケジャパン	1,300	5,239.00	6,810,700
ピエトロ	200	1,811.00	362,200
エバラ食品工業	400	2,956.00	1,182,400
やまみ	100	1,360.00	136,000
ニチレイ	6,900	3,118.00	21,514,200
東洋水産	7,600	6,377.00	48,465,200
イトアンドホールディングス	600	2,203.00	1,321,800
大冷	100	1,936.00	193,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	900	876.00	788,400
日清食品ホールディングス	5,300	12,080.00	64,024,000
永谷園ホールディングス	700	2,103.00	1,472,100
一正蒲鉾	500	793.00	396,500
フジッコ	1,600	1,916.00	3,065,600
ロック・フィールド	1,700	1,496.00	2,543,200
日本たばこ産業	98,900	3,214.00	317,864,600
ケンコーマヨネーズ	1,000	1,297.00	1,297,000
わらべや日洋ホールディングス	1,100	2,237.00	2,460,700
なとり	900	1,968.00	1,771,200
イフジ産業	200	1,047.00	209,400
ファーマフーズ	2,200	1,858.00	4,087,600
ユーグレナ	9,700	889.00	8,623,300
紀文食品	1,200	966.00	1,159,200
ピクルスホールディングス	900	1,278.00	1,150,200
ミヨシ油脂	400	1,014.00	405,600
理研ビタミン	1,300	2,107.00	2,739,100
片倉工業	1,400	1,670.00	2,338,000
ゲンゼ	1,100	4,505.00	4,955,500
東洋紡	6,600	1,021.50	6,741,900
ユニチカ	4,500	242.00	1,089,000
富士紡ホールディングス	600	3,150.00	1,890,000
倉敷紡績	1,200	2,230.00	2,676,000
シキボウ	700	997.00	697,900
日本毛織	4,100	1,026.00	4,206,600
ダイトウボウ	2,000	93.00	186,000
トーア紡コーポレーション	500	404.00	202,000
ダイドーリミテッド	1,700	261.00	443,700
帝国繊維	1,700	1,651.00	2,806,700
帝人	14,700	1,385.50	20,366,850
東レ	102,400	787.50	80,640,000
住江織物	200	2,213.00	442,600
日本フェルト	700	412.00	288,400

イチカワ	200	1,353.00	270,600
日東製網	100	1,362.00	136,200
アツギ	700	426.00	298,200
ダイニック	300	725.00	217,500
セーレン	3,000	2,386.00	7,158,000
ソトー	400	799.00	319,600
東海染工	100	1,128.00	112,800
小松マテーレ	2,200	681.00	1,498,200
ワコールホールディングス	2,900	2,968.00	8,607,200
ホギメディカル	2,100	3,210.00	6,741,000
クラウディアホールディングス	300	667.00	200,100
T S Iホールディングス	5,200	685.00	3,562,000
マツオカコーポレーション	300	1,118.00	335,400
ワールド	2,000	1,539.00	3,078,000
三陽商会	500	1,547.00	773,500
ナイガイ	400	281.00	112,400
オンワードホールディングス	10,000	377.00	3,770,000
ルックホールディングス	300	2,364.00	709,200
ゴールドウイン	2,700	13,520.00	36,504,000
デサント	2,600	4,150.00	10,790,000
キング	500	598.00	299,000
ヤマトインターナショナル	900	277.00	249,300
特種東海製紙	700	3,290.00	2,303,000
王子ホールディングス	63,700	549.90	35,028,630
日本製紙	8,000	1,239.00	9,912,000
三菱製紙	1,400	555.00	777,000
北越コーポレーション	9,700	881.00	8,545,700
中越パルプ工業	500	1,373.00	686,500
巴川製紙所	400	663.00	265,200
大王製紙	6,700	1,125.00	7,537,500
阿波製紙	300	570.00	171,000
レンゴー	13,900	864.20	12,012,380
トーモク	900	1,996.00	1,796,400
ザ・パック	1,100	3,125.00	3,437,500
北の達人コーポレーション	6,400	296.00	1,894,400
クラレ	24,300	1,389.50	33,764,850
旭化成	95,500	972.90	92,911,950
共和レザー	700	546.00	382,200
レゾナック・ホールディングス	14,800	2,271.00	33,610,800
住友化学	113,400	431.70	48,954,780
住友精化	600	4,265.00	2,559,000
日産化学	7,300	6,445.00	47,048,500

ラサ工業	600	2,209.00	1,325,400
クレハ	1,300	8,480.00	11,024,000
多木化学	600	4,405.00	2,643,000
テイカ	1,000	1,276.00	1,276,000
石原産業	2,800	1,303.00	3,648,400
片倉コープアグリ	200	1,250.00	250,000
日本曹達	1,600	5,100.00	8,160,000
東ソー	20,400	1,748.50	35,669,400
トクヤマ	4,900	2,431.50	11,914,350
セントラル硝子	2,400	3,260.00	7,824,000
東亜合成	7,600	1,295.50	9,845,800
大阪ソーダ	900	5,260.00	4,734,000
関東電化工業	3,000	900.00	2,700,000
デンカ	5,600	2,626.00	14,705,600
信越化学工業	127,100	4,817.00	612,240,700
日本カーバイド工業	500	1,330.00	665,000
堺化学工業	1,200	1,874.00	2,248,800
第一稀元素化学工業	1,400	980.00	1,372,000
エア・ウォーター	14,400	1,893.00	27,259,200
日本酸素ホールディングス	14,800	3,142.00	46,501,600
日本化学工業	500	1,858.00	929,000
東邦アセチレン	300	1,370.00	411,000
日本パーカライズング	7,500	1,081.00	8,107,500
高压ガス工業	2,200	734.00	1,614,800
四国化成ホールディングス	1,800	1,493.00	2,687,400
戸田工業	400	2,376.00	950,400
ステラ ケミファ	900	3,010.00	2,709,000
保土谷化学工業	400	3,255.00	1,302,000
日本触媒	2,300	5,497.00	12,643,100
大日精化工業	1,100	1,968.00	2,164,800
カネカ	3,500	3,944.00	13,804,000
三菱瓦斯化学	11,400	2,117.50	24,139,500
三井化学	12,600	3,991.00	50,286,600
J S R	14,300	3,378.00	48,305,400
東京応化工業	2,700	8,528.00	23,025,600
大阪有機化学工業	1,200	2,548.00	3,057,600
三菱ケミカルグループ	103,100	826.20	85,181,220
K Hネオケム	2,600	2,419.00	6,289,400
ダイセル	22,400	1,291.00	28,918,400
住友ベークライト	2,300	5,694.00	13,096,200
積水化学工業	31,300	2,058.50	64,431,050
日本ゼオン	9,200	1,390.00	12,788,000

アイカ工業	3,800	3,079.00	11,700,200
U B E	7,900	2,453.00	19,378,700
積水樹脂	2,200	2,283.00	5,022,600
タキロンシーアイ	3,300	534.00	1,762,200
旭有機材	1,000	4,375.00	4,375,000
ニチバン	900	1,891.00	1,701,900
リケンテクノス	3,300	625.00	2,062,500
大倉工業	700	2,086.00	1,460,200
積水化成成品工業	2,100	426.00	894,600
群栄化学工業	400	2,504.00	1,001,600
タイガースポリマー	500	566.00	283,000
ミライアル	400	1,567.00	626,800
ダイキアクシス	400	716.00	286,400
ダイキョーニシカワ	3,400	797.00	2,709,800
竹本容器	400	824.00	329,600
森六ホールディングス	800	2,043.00	1,634,400
恵和	1,000	1,111.00	1,111,000
日本化薬	11,700	1,262.00	14,765,400
カーリットホールディングス	1,400	802.00	1,122,800
日本精化	900	2,840.00	2,556,000
扶桑化学工業	1,400	4,050.00	5,670,000
トリケミカル研究所	2,100	2,688.00	5,644,800
A D E K A	5,300	2,583.00	13,689,900
日油	4,700	6,277.00	29,501,900
新日本理化	1,700	252.00	428,400
ハリマ化成グループ	800	870.00	696,000
花王	37,200	5,118.00	190,389,600
第一工業製薬	500	1,787.00	893,500
石原ケミカル	700	1,716.00	1,201,200
日華化学	500	855.00	427,500
ニイタカ	200	2,075.00	415,000
三洋化成工業	900	4,265.00	3,838,500
有機合成薬品工業	900	309.00	278,100
大日本塗料	1,800	909.00	1,636,200
日本ペイントホールディングス	67,600	1,234.00	83,418,400
関西ペイント	14,000	2,199.50	30,793,000
神東塗料	1,000	130.00	130,000
中国塗料	2,500	1,122.00	2,805,000
日本特殊塗料	800	1,027.00	821,600
藤倉化成	2,000	439.00	878,000
太陽ホールディングス	2,300	2,587.00	5,950,100
D I C	6,000	2,621.00	15,726,000

サカタインクス	3,400	1,235.00	4,199,000
東洋インキSCホールディングス	3,000	2,224.00	6,672,000
T&K TOKA	1,300	1,251.00	1,626,300
富士フィルムホールディングス	29,400	8,813.00	259,102,200
資生堂	32,000	6,756.00	216,192,000
ライオン	18,300	1,378.00	25,217,400
高砂香料工業	1,000	2,628.00	2,628,000
マンダム	3,300	1,444.00	4,765,200
ミルボン	2,300	5,128.00	11,794,400
ファンケル	6,700	2,382.50	15,962,750
コーセー	3,100	14,050.00	43,555,000
コタ	1,400	1,641.00	2,297,400
ポーラ・オルビスホールディングス	7,800	2,125.50	16,578,900
ノエビアホールディングス	1,400	5,420.00	7,588,000
アジュバンホールディングス	300	928.00	278,400
新日本製薬	900	1,407.00	1,266,300
アクシージア	800	1,379.00	1,103,200
エステー	1,200	1,523.00	1,827,600
アグロ カネショウ	600	1,682.00	1,009,200
コニシ	2,600	2,226.00	5,787,600
長谷川香料	2,900	3,280.00	9,512,000
星光PMC	600	575.00	345,000
小林製薬	4,500	8,089.00	36,400,500
荒川化学工業	1,300	1,013.00	1,316,900
メック	1,300	3,395.00	4,413,500
日本高純度化学	400	2,639.00	1,055,600
タカラバイオ	4,100	1,645.00	6,744,500
JCU	1,700	3,620.00	6,154,000
新田ゼラチン	700	736.00	515,200
OATアグリオ	500	1,891.00	945,500
デクセリアルズ	4,400	3,139.00	13,811,600
アース製薬	1,400	5,150.00	7,210,000
北興化学工業	1,500	981.00	1,471,500
大成ラミック	500	2,936.00	1,468,000
クミアイ化学工業	6,100	1,094.00	6,673,400
日本農薬	2,800	657.00	1,839,600
アキレス	1,000	1,457.00	1,457,000
有沢製作所	2,500	1,108.00	2,770,000
日東電工	11,100	10,840.00	120,324,000
レック	2,200	815.00	1,793,000
三光合成	1,900	572.00	1,086,800
きもと	1,800	192.00	345,600

藤森工業	1,200	3,415.00	4,098,000	
前澤化成工業	1,000	1,631.00	1,631,000	
未来工業	500	2,643.00	1,321,500	
ウェーブロックホールディングス	400	573.00	229,200	
J S P	1,100	1,812.00	1,993,200	
エフピコ	2,900	2,940.00	8,526,000	
天馬	1,300	2,724.00	3,541,200	
信越ポリマー	2,800	1,439.00	4,029,200	
東リ	2,700	314.00	847,800	
ニフコ	5,500	4,097.00	22,533,500	
バルカー	1,300	3,890.00	5,057,000	
ユニ・チャーム	31,900	5,388.00	171,877,200	
ショーエイコーポレーション	400	559.00	223,600	
協和キリン	18,500	2,702.50	49,996,250	
武田薬品工業	135,500	4,537.00	614,763,500	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	144,600	2,258.50	326,579,100	
住友ファーマ	11,400	631.90	7,203,660	
塩野義製薬	19,300	6,131.00	118,328,300	
わかもと製薬	1,100	230.00	253,000	
日本新薬	3,600	6,378.00	22,960,800	
中外製薬	47,900	4,146.00	198,593,400	
科研製薬	2,600	3,601.00	9,362,600	
エーザイ	18,600	9,527.00	177,202,200	
ロート製薬	14,800	3,185.00	47,138,000	
小野薬品工業	29,500	2,675.00	78,912,500	
久光製薬	3,400	3,541.00	12,039,400	
持田製薬	1,800	3,225.00	5,805,000	
参天製薬	27,900	1,199.50	33,466,050	
扶桑薬品工業	500	2,009.00	1,004,500	
日本ケミファ	100	1,818.00	181,800	
ツムラ	4,800	2,726.50	13,087,200	
キッセイ薬品工業	2,400	2,938.00	7,051,200	
生化学工業	2,900	759.00	2,201,100	
栄研化学	2,500	1,518.00	3,795,000	
鳥居薬品	800	3,610.00	2,888,000	
J C R ファーマ	5,200	1,319.00	6,858,800	
東和薬品	2,400	1,763.00	4,231,200	
富士製薬工業	1,100	1,113.00	1,224,300	
ゼリア新薬工業	2,100	2,483.00	5,214,300	
そーせいグループ	5,300	2,840.00	15,052,000	
第一三共	133,400	4,800.00	640,320,000	
杏林製薬	3,300	1,741.00	5,745,300	

大幸薬品	2,700	377.00	1,017,900
ダイト	1,100	2,394.00	2,633,400
大塚ホールディングス	35,000	5,539.00	193,865,000
大正製薬ホールディングス	3,400	5,255.00	17,867,000
ペプチドリーム	7,400	2,214.50	16,387,300
あすか製薬ホールディングス	1,600	1,308.00	2,092,800
サワイグループホールディングス	3,500	3,399.00	11,896,500
日本コークス工業	13,400	108.00	1,447,200
ニチレキ	1,800	1,766.00	3,178,800
ユシロ化学工業	800	1,050.00	840,000
ピーピー・カストロール	400	889.00	355,600
富士石油	3,000	263.00	789,000
MORESCO	400	1,157.00	462,800
出光興産	17,000	2,902.50	49,342,500
Eneosホールディングス	259,800	483.70	125,665,260
コスモエネルギーホールディングス	6,100	4,120.00	25,132,000
横浜ゴム	8,700	3,204.00	27,874,800
TOYO TIRE	8,800	1,942.00	17,089,600
ブリヂストン	48,900	6,033.00	295,013,700
住友ゴム工業	15,100	1,342.50	20,271,750
藤倉コンポジット	800	904.00	723,200
オカモト	800	3,935.00	3,148,000
フコク	800	1,310.00	1,048,000
ニッタ	1,600	3,110.00	4,976,000
住友理工	3,000	862.00	2,586,000
三ツ星ベルト	2,200	4,290.00	9,438,000
バンドー化学	2,400	1,407.00	3,376,800
日東紡績	1,700	2,661.00	4,523,700
AGC	15,600	5,274.00	82,274,400
日本板硝子	7,800	629.00	4,906,200
石塚硝子	200	1,571.00	314,200
日本山村硝子	400	1,116.00	446,400
日本電気硝子	6,200	2,619.00	16,237,800
オハラ	700	1,613.00	1,129,100
住友大阪セメント	2,100	3,701.00	7,772,100
太平洋セメント	9,700	2,843.00	27,577,100
日本ヒューム	1,300	775.00	1,007,500
日本コンクリート工業	3,100	340.00	1,054,000
三谷セキサン	600	5,120.00	3,072,000
アジアパイルホールディングス	2,400	610.00	1,464,000
東海カーボン	12,800	1,248.00	15,974,400
日本カーボン	900	4,445.00	4,000,500

東洋炭素	1,000	5,090.00	5,090,000
ノリタケカンパニーリミテド	800	5,210.00	4,168,000
TOTO	10,100	4,458.00	45,025,800
日本碍子	17,800	1,787.00	31,808,600
日本特殊陶業	11,600	2,771.50	32,149,400
ダントーホールディングス	800	711.00	568,800
MARUWA	600	20,230.00	12,138,000
品川リフラクトリーズ	400	5,130.00	2,052,000
黒崎播磨	300	7,980.00	2,394,000
ヨータイ	800	1,465.00	1,172,000
東京窯業	1,100	332.00	365,200
ニッカトー	500	644.00	322,000
フジミインコーポレーテッド	1,200	9,520.00	11,424,000
クニミネ工業	300	964.00	289,200
エーアンドエーマテリアル	200	1,066.00	213,200
ニチアス	3,900	2,874.00	11,208,600
ニチハ	1,900	3,150.00	5,985,000
日本製鉄	70,600	2,989.00	211,023,400
神戸製鋼所	31,700	1,294.00	41,019,800
合同製鐵	800	3,425.00	2,740,000
JFEホールディングス	42,100	2,029.50	85,441,950
東京製鐵	4,500	1,477.00	6,646,500
共英製鋼	1,800	2,079.00	3,742,200
大和工業	2,600	5,967.00	15,514,200
東京鐵鋼	800	2,838.00	2,270,400
大阪製鐵	800	1,394.00	1,115,200
淀川製鋼所	1,800	3,180.00	5,724,000
中部鋼鈹	1,400	1,893.00	2,650,200
丸一鋼管	4,800	3,303.00	15,854,400
モリ工業	300	3,355.00	1,006,500
大同特殊鋼	2,000	5,642.00	11,284,000
日本高周波鋼業	600	337.00	202,200
日本冶金工業	1,200	4,065.00	4,878,000
山陽特殊製鋼	1,600	2,880.00	4,608,000
愛知製鋼	900	2,895.00	2,605,500
日本金属	400	887.00	354,800
大平洋金属	1,200	1,599.00	1,918,800
新日本電工	9,800	286.00	2,802,800
栗本鐵工所	800	2,023.00	1,618,400
虹技	200	1,199.00	239,800
日本鑄鐵管	200	1,029.00	205,800
三菱製鋼	1,100	1,312.00	1,443,200

日亜銅業	1,500	314.00	471,000
日本精線	200	4,640.00	928,000
エンビプロ・ホールディングス	1,000	568.00	568,000
シンニッタン	1,700	247.00	419,900
新家工業	300	2,254.00	676,200
大紀アルミニウム工業所	2,200	1,354.00	2,978,800
日本軽金属ホールディングス	4,300	1,429.00	6,144,700
三井金属鉱業	4,600	3,589.00	16,509,400
東邦亜鉛	900	1,702.00	1,531,800
三菱マテリアル	10,500	2,601.50	27,315,750
住友金属鉱山	18,300	4,927.00	90,164,100
D O W Aホールディングス	3,500	4,589.00	16,061,500
古河機械金属	2,300	1,552.00	3,569,600
エス・サイエンス	7,100	25.00	177,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,300	3,010.00	6,923,000
東邦チタニウム	2,900	1,760.00	5,104,000
U A C J	2,200	2,727.00	5,999,400
C Kサンエツ	400	4,240.00	1,696,000
古河電気工業	5,200	2,502.50	13,013,000
住友電気工業	54,400	1,767.00	96,124,800
フジクラ	16,900	1,178.00	19,908,200
S W C C	1,700	1,871.00	3,180,700
タツタ電線	3,200	715.00	2,288,000
カナレ電気	200	1,380.00	276,000
平河ヒューテック	900	1,473.00	1,325,700
リョービ	1,700	1,907.00	3,241,900
アーレスティ	1,400	686.00	960,400
アサヒホールディングス	6,300	1,936.00	12,196,800
稲葉製作所	800	1,635.00	1,308,000
宮地エンジニアリンググループ	400	3,890.00	1,556,000
トーカロ	4,400	1,425.00	6,270,000
アルファC o	500	1,152.00	576,000
S U M C O	30,000	2,061.50	61,845,000
川田テクノロジーズ	400	5,300.00	2,120,000
R S Technologies	1,000	3,360.00	3,360,000
ジェイテックコーポレーション	200	2,393.00	478,600
信和	700	738.00	516,600
東洋製罐グループホールディングス	9,400	2,138.50	20,101,900
ホッカンホールディングス	800	1,378.00	1,102,400
コロナ	900	892.00	802,800
横河ブリッジホールディングス	2,000	2,422.00	4,844,000
駒井ハルテック	200	1,851.00	370,200

高田機工	100	2,755.00	275,500
三和ホールディングス	14,500	1,836.50	26,629,250
文化シャッター	4,600	1,114.00	5,124,400
三協立山	1,800	675.00	1,215,000
アルインコ	1,200	993.00	1,191,600
東洋シャッター	300	621.00	186,300
L I X I L	22,900	1,888.50	43,246,650
日本フィルコン	800	465.00	372,000
ノーリツ	2,300	1,814.00	4,172,200
長府製作所	1,600	2,484.00	3,974,400
リンナイ	8,600	2,971.50	25,554,900
ダイニチ工業	600	726.00	435,600
日東精工	2,300	593.00	1,363,900
三洋工業	100	1,898.00	189,800
岡部	2,500	789.00	1,972,500
ジーテクト	1,800	1,473.00	2,651,400
東プレ	2,800	1,521.00	4,258,800
高周波熱錬	2,400	981.00	2,354,400
東京製綱	900	1,112.00	1,000,800
サンコール	1,100	519.00	570,900
モリテック スチール	900	281.00	252,900
パイオラックス	2,200	2,101.00	4,622,200
エイチワン	1,600	710.00	1,136,000
日本発條	13,900	1,018.00	14,150,200
中央発條	1,100	713.00	784,300
アドバネクス	100	973.00	97,300
立川ブラインド工業	700	1,283.00	898,100
三益半導体工業	1,200	3,130.00	3,756,000
日本ドライケミカル	300	1,662.00	498,600
日本製鋼所	4,300	3,038.00	13,063,400
三浦工業	6,400	3,855.00	24,672,000
タクマ	4,800	1,529.00	7,339,200
ツガミ	3,500	1,395.00	4,882,500
オークマ	1,500	7,484.00	11,226,000
芝浦機械	1,500	4,930.00	7,395,000
アマダ	24,600	1,410.50	34,698,300
アイダエンジニアリング	3,200	925.00	2,960,000
T A K I S A W A	300	1,217.00	365,100
F U J I	6,700	2,573.50	17,242,450
牧野フライス製作所	1,700	5,550.00	9,435,000
オーエスジー	7,400	2,016.50	14,922,100
ダイジェット工業	100	866.00	86,600

旭ダイヤモンド工業	4,300	822.00	3,534,600
D M G 森精機	9,400	2,574.00	24,195,600
ソディック	4,300	709.00	3,048,700
ディスコ	7,400	22,660.00	167,684,000
日東工器	800	1,972.00	1,577,600
日進工具	1,300	1,162.00	1,510,600
パンチ工業	1,100	554.00	609,400
富士ダイス	600	684.00	410,400
豊和工業	700	794.00	555,800
東洋機械金属	800	655.00	524,000
島精機製作所	2,500	1,902.00	4,755,000
オプトラン	2,300	2,445.00	5,623,500
N C ホールディングス	200	2,135.00	427,000
イワキポンプ	1,000	1,434.00	1,434,000
フリュー	1,600	1,047.00	1,675,200
ヤマシンフィルタ	3,600	312.00	1,123,200
日阪製作所	1,500	878.00	1,317,000
やまびこ	2,500	1,562.00	3,905,000
野村マイクロ・サイエンス	500	6,560.00	3,280,000
平田機工	700	8,290.00	5,803,000
P E G A S U S	1,700	564.00	958,800
マルマエ	700	1,766.00	1,236,200
タツモ	800	2,610.00	2,088,000
ナプテスコ	9,700	3,382.00	32,805,400
三井海洋開発	2,000	1,418.00	2,836,000
レオン自動機	1,600	1,455.00	2,328,000
S M C	5,000	81,950.00	409,750,000
ホソカワミクロン	1,100	2,945.00	3,239,500
ユニオンツール	700	3,405.00	2,383,500
オイレス工業	2,200	1,977.00	4,349,400
日精エー・エス・ビー機械	600	4,070.00	2,442,000
サトーホールディングス	2,200	1,934.00	4,254,800
技研製作所	1,500	2,026.00	3,039,000
日本エアータック	800	1,156.00	924,800
カワタ	300	1,250.00	375,000
日精樹脂工業	1,200	988.00	1,185,600
オカダアイヨン	400	2,251.00	900,400
ワイエイシイホールディングス	500	3,205.00	1,602,500
小松製作所	72,200	3,865.00	279,053,000
住友重機械工業	9,100	3,501.00	31,859,100
日立建機	6,100	4,027.00	24,564,700
日工	2,300	642.00	1,476,600

巴工業	700	2,837.00	1,985,900
井関農機	1,400	1,296.00	1,814,400
TOWA	1,600	2,536.00	4,057,600
丸山製作所	200	1,818.00	363,600
北川鉄工所	600	1,184.00	710,400
ローツェ	800	11,920.00	9,536,000
タカキタ	300	441.00	132,300
クボタ	81,600	2,204.00	179,846,400
荏原実業	700	3,195.00	2,236,500
三菱化工機	500	2,744.00	1,372,000
月島ホールディングス	2,100	1,207.00	2,534,700
帝国電機製作所	1,100	2,489.00	2,737,900
新東工業	3,100	1,056.00	3,273,600
澁谷工業	1,500	2,729.00	4,093,500
アイチ コーポレーション	2,100	845.00	1,774,500
小森コーポレーション	3,600	950.00	3,420,000
鶴見製作所	1,200	2,592.00	3,110,400
酒井重工業	200	4,970.00	994,000
荏原製作所	6,300	7,254.00	45,700,200
石井鐵工所	100	2,470.00	247,000
西島製作所	1,300	1,714.00	2,228,200
北越工業	1,500	1,343.00	2,014,500
ダイキン工業	18,400	29,575.00	544,180,000
オルガノ	2,100	4,040.00	8,484,000
トーヨーカネツ	600	3,485.00	2,091,000
栗田工業	8,600	5,825.00	50,095,000
椿本チエイン	2,200	3,695.00	8,129,000
大同工業	500	728.00	364,000
木村化工機	1,200	738.00	885,600
アネスト岩田	2,700	1,132.00	3,056,400
ダイフク	23,900	3,052.00	72,942,800
サムコ	400	6,440.00	2,576,000
加藤製作所	600	1,279.00	767,400
油研工業	200	2,010.00	402,000
タダノ	8,200	1,135.00	9,307,000
フジテック	5,400	3,680.00	19,872,000
C K D	4,300	2,386.00	10,259,800
平和	5,100	2,381.00	12,143,100
理想科学工業	1,400	2,304.00	3,225,600
SANKYO	3,000	5,819.00	17,457,000
日本金銭機械	1,700	1,082.00	1,839,400
マースグループホールディングス	900	2,592.00	2,332,800

フクシマガリレイ	1,200	5,660.00	6,792,000
オーイズミ	500	485.00	242,500
ダイコク電機	900	2,937.00	2,643,300
竹内製作所	2,800	4,450.00	12,460,000
アマノ	4,400	2,991.00	13,160,400
JUKI	2,400	589.00	1,413,600
サンデン	1,800	198.00	356,400
ジャノメ	1,600	604.00	966,400
マックス	1,900	2,499.00	4,748,100
グローリー	3,700	2,839.50	10,506,150
新晃工業	1,600	2,106.00	3,369,600
大和冷機工業	2,400	1,395.00	3,348,000
セガサミーホールディングス	12,400	2,926.00	36,282,400
日本ピストンリング	400	1,453.00	581,200
リケン	600	2,859.00	1,715,400
T P R	1,800	1,541.00	2,773,800
ツバキ・ナカシマ	3,800	888.00	3,374,400
ホシザキ	9,900	5,256.00	52,034,400
大豊工業	1,300	853.00	1,108,900
日本精工	28,300	897.80	25,407,740
N T N	30,500	297.80	9,082,900
ジェイテクト	13,700	1,304.00	17,864,800
不二越	1,200	4,045.00	4,854,000
日本トムソン	3,800	584.00	2,219,200
T H K	8,900	3,113.00	27,705,700
ユーシン精機	1,200	706.00	847,200
前澤給装工業	1,100	1,121.00	1,233,100
イーグル工業	1,700	1,696.00	2,883,200
前澤工業	700	754.00	527,800
日本ピラー工業	1,400	4,625.00	6,475,000
キッツ	5,800	1,105.00	6,409,000
マキタ	19,200	3,996.00	76,723,200
三井E & S	7,200	485.00	3,492,000
日立造船	12,700	918.00	11,658,600
三菱重工業	27,000	6,861.00	185,247,000
I H I	9,700	3,926.00	38,082,200
サノヤスホールディングス	1,700	131.00	222,700
スター精密	3,000	1,834.00	5,502,000
日清紡ホールディングス	12,500	1,133.50	14,168,750
イビデン	8,800	8,069.00	71,007,200
コニカミノルタ	34,400	468.70	16,123,280
ブラザー工業	20,600	2,200.00	45,320,000

ミネベアミツミ	26,800	2,805.50	75,187,400
日立製作所	75,000	8,908.00	668,100,000
東芝	29,700	4,521.00	134,273,700
三菱電機	159,300	2,043.50	325,529,550
富士電機	9,400	6,391.00	60,075,400
東洋電機製造	400	950.00	380,000
安川電機	18,300	6,732.00	123,195,600
シンフォニアテクノロジー	1,700	1,702.00	2,893,400
明電舎	2,300	1,940.00	4,462,000
オリジン	300	1,243.00	372,900
山洋電気	700	7,710.00	5,397,000
デンヨー	1,200	2,008.00	2,409,600
P H C ホールディングス	2,100	1,470.00	3,087,000
ソシオネクスト	2,100	25,410.00	53,361,000
東芝テック	2,300	4,240.00	9,752,000
芝浦メカトロニクス	300	21,110.00	6,333,000
マブチモーター	3,800	3,956.00	15,032,800
ニデック	37,500	7,753.00	290,737,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,100	614.00	675,400
トレックス・セミコンダクター	700	2,289.00	1,602,300
東光高岳	900	2,126.00	1,913,400
ダブル・スコープ	5,100	1,258.00	6,415,800
ダイヘン	1,400	5,680.00	7,952,000
ヤーマン	2,700	1,047.00	2,826,900
J V C ケンウッド	14,000	514.00	7,196,000
ミマキエンジニアリング	1,500	803.00	1,204,500
I - P E X	900	1,421.00	1,278,900
大崎電気工業	3,700	559.00	2,068,300
オムロン	14,100	9,218.00	129,973,800
日東工業	2,100	3,465.00	7,276,500
I D E C	2,300	3,245.00	7,463,500
正興電機製作所	500	1,012.00	506,000
不二電機工業	300	1,156.00	346,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,100	2,840.50	14,486,550
サクサホールディングス	300	1,806.00	541,800
メルコホールディングス	400	3,195.00	1,278,000
テクノメディカ	400	1,900.00	760,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	500	768.00	384,000
日本電気	21,800	7,029.00	153,232,200
富士通	15,400	19,085.00	293,909,000
沖電気工業	7,000	888.00	6,216,000
岩崎通信機	500	826.00	413,000

電気興業	600	2,278.00	1,366,800	
サンケン電気	1,400	12,830.00	17,962,000	
ナカヨ	200	1,156.00	231,200	
アイホン	900	2,367.00	2,130,300	
ルネサスエレクトロニクス	100,600	2,672.50	268,853,500	
セイコーエプソン	19,800	2,207.00	43,698,600	
ワコム	11,700	616.00	7,207,200	
アルバック	3,700	5,964.00	22,066,800	
アクセル	500	1,585.00	792,500	
E I Z O	1,100	4,760.00	5,236,000	
日本信号	3,500	1,074.00	3,759,000	
京三製作所	3,200	448.00	1,433,600	
能美防災	2,100	1,842.00	3,868,200	
ホーチキ	1,200	1,750.00	2,100,000	
星和電機	500	481.00	240,500	
エレコム	3,700	1,542.00	5,705,400	
パナソニック ホールディングス	182,100	1,678.50	305,654,850	
シャープ	18,500	785.00	14,522,500	
アンリツ	10,800	1,220.00	13,176,000	
富士通ゼネラル	4,400	3,249.00	14,295,600	
ソニーグループ	108,000	13,950.00	1,506,600,000	代用有価証券 35,000株
T D K	24,400	5,693.00	138,909,200	
帝国通信工業	700	1,624.00	1,136,800	
タムラ製作所	6,600	688.00	4,540,800	
アルプスアルパイン	13,700	1,273.50	17,446,950	
池上通信機	400	629.00	251,600	
日本電波工業	1,900	1,299.00	2,468,100	
鈴木	800	990.00	792,000	
メイコー	1,700	2,734.00	4,647,800	
日本トリム	400	2,898.00	1,159,200	
ローランド ディー . ジー .	900	3,435.00	3,091,500	
フォスター電機	1,400	922.00	1,290,800	
S M K	400	2,321.00	928,400	
ヨコオ	1,200	1,742.00	2,090,400	
ホシデン	3,600	1,808.00	6,508,800	
ヒロセ電機	2,500	19,680.00	49,200,000	
日本航空電子工業	3,200	2,825.00	9,040,000	
T O A	1,700	878.00	1,492,600	
マクセル	3,100	1,572.00	4,873,200	
古野電気	2,000	1,067.00	2,134,000	
スミダコーポレーション	1,400	1,320.00	1,848,000	
アイコム	600	2,980.00	1,788,000	

リオン	600	1,842.00	1,105,200
横河電機	16,900	2,745.50	46,398,950
新電元工業	600	3,355.00	2,013,000
アズビル	10,700	4,637.00	49,615,900
東亜ディーケーケー	600	830.00	498,000
日本光電工業	7,000	3,937.00	27,559,000
チノー	600	2,299.00	1,379,400
共和電業	1,100	352.00	387,200
日本電子材料	1,000	1,708.00	1,708,000
堀場製作所	3,400	8,256.00	28,070,400
アドバンテスト	12,000	19,550.00	234,600,000
小野測器	500	444.00	222,000
エスベック	1,200	2,345.00	2,814,000
キーエンス	15,300	70,970.00	1,085,841,000
日置電機	800	9,110.00	7,288,000
シスメックス	13,200	9,881.00	130,429,200
日本マイクロニクス	2,500	1,865.00	4,662,500
メガチップス	1,300	3,845.00	4,998,500
O B A R A G R O U P	800	4,145.00	3,316,000
澤藤電機	100	1,287.00	128,700
原田工業	500	805.00	402,500
コーセル	1,800	1,244.00	2,239,200
イリソ電子工業	1,400	4,255.00	5,957,000
オブテックスグループ	2,800	2,052.00	5,745,600
千代田インテグレ	500	2,400.00	1,200,000
レーザーテック	7,000	21,925.00	153,475,000
スタンレー電気	10,800	3,024.00	32,659,200
ウシオ電機	7,700	1,898.50	14,618,450
岡谷電機産業	1,000	270.00	270,000
ヘリオス テクノ ホールディング	1,100	610.00	671,000
エノモト	300	1,681.00	504,300
日本セラミック	1,600	2,607.00	4,171,200
遠藤照明	500	1,183.00	591,500
古河電池	1,100	1,060.00	1,166,000
双信電機	500	357.00	178,500
山一電機	1,300	2,283.00	2,967,900
図研	1,300	3,625.00	4,712,500
日本電子	3,800	5,309.00	20,174,200
カシオ計算機	11,400	1,208.00	13,771,200
ファナック	74,900	5,207.00	390,004,300
日本シイエムケイ	3,200	527.00	1,686,400
エンプラス	500	5,940.00	2,970,000

大真空	1,900	648.00	1,231,200	
ローム	7,100	13,450.00	95,495,000	
浜松ホトニクス	12,200	7,203.00	87,876,600	
三井ハイテック	1,600	9,320.00	14,912,000	
新光電気工業	5,400	5,716.00	30,866,400	
京セラ	23,700	7,972.00	188,936,400	
太陽誘電	7,400	4,301.00	31,827,400	
村田製作所	46,300	8,520.00	394,476,000	
双葉電子工業	2,900	503.00	1,458,700	
北陸電気工業	500	1,221.00	610,500	
ニチコン	3,100	1,461.00	4,529,100	
日本ケミコン	1,500	1,273.00	1,909,500	
K O A	2,300	1,785.00	4,105,500	
市光工業	2,200	566.00	1,245,200	
小糸製作所	18,300	2,848.00	52,118,400	
ミツバ	2,900	803.00	2,328,700	
S C R E E Nホールディングス	2,600	16,245.00	42,237,000	
キャノン電子	1,700	1,921.00	3,265,700	
キャノン	83,700	3,610.00	302,157,000	代用有価証券 10,000株
リコー	38,300	1,261.50	48,315,450	
象印マホービン	4,500	1,764.00	7,938,000	
M U T O Hホールディングス	200	1,715.00	343,000	
東京エレクトロン	32,300	20,300.00	655,690,000	
イノテック	1,000	1,602.00	1,602,000	
トヨタ紡織	6,400	2,595.00	16,608,000	
芦森工業	200	1,889.00	377,800	
ユニプレス	2,800	1,091.00	3,054,800	
豊田自動織機	11,200	9,837.00	110,174,400	
モリタホールディングス	2,700	1,543.00	4,166,100	
三櫻工業	2,300	857.00	1,971,100	
デンソー	31,500	9,660.00	304,290,000	
東海理化電機製作所	4,300	2,130.00	9,159,000	
川崎重工業	11,500	3,553.00	40,859,500	
名村造船所	3,000	587.00	1,761,000	
日本車輛製造	600	2,058.00	1,234,800	
三菱ロジスネクスト	2,500	1,239.00	3,097,500	
近畿車輛	200	1,462.00	292,400	
日産自動車	217,000	542.70	117,765,900	
いすゞ自動車	44,400	1,809.00	80,319,600	
トヨタ自動車	838,100	2,320.50	1,944,811,050	
日野自動車	19,700	624.30	12,298,710	
三菱自動車工業	59,600	489.80	29,192,080	

エフテック	800	958.00	766,400
レシップホールディングス	500	503.00	251,500
G M B	200	2,130.00	426,000
ファルテック	200	615.00	123,000
武蔵精密工業	3,800	1,811.00	6,881,800
日産車体	2,700	871.00	2,351,700
新明和工業	4,800	1,340.00	6,432,000
極東開発工業	2,600	1,749.00	4,547,400
トピー工業	1,300	2,168.00	2,818,400
ティラド	400	1,796.00	718,400
タチエス	2,400	1,503.00	3,607,200
N O K	6,000	2,054.50	12,327,000
フタバ産業	4,000	499.00	1,996,000
K Y B	1,500	4,780.00	7,170,000
大同メタル工業	3,000	494.00	1,482,000
プレス工業	6,900	596.00	4,112,400
ミクニ	1,400	413.00	578,200
太平洋工業	3,500	1,309.00	4,581,500
アイシン	11,800	4,404.00	51,967,200
マツダ	50,500	1,385.00	69,942,500
今仙電機製作所	800	635.00	508,000
本田技研工業	124,100	4,511.00	559,815,100
スズキ	28,100	5,100.00	143,310,000
S U B A R U	48,300	2,692.00	130,023,600
安永	500	923.00	461,500
ヤマハ発動機	24,000	3,990.00	95,760,000
T B K	1,200	361.00	433,200
エクセディ	2,500	2,290.00	5,725,000
豊田合成	4,500	2,584.00	11,628,000
愛三工業	2,500	1,126.00	2,815,000
盟和産業	200	978.00	195,600
日本プラスト	1,000	438.00	438,000
ヨロズ	1,400	896.00	1,254,400
エフ・シー・シー	2,700	1,823.00	4,922,100
シマノ	6,200	23,235.00	144,057,000
テイ・エス テック	7,000	1,932.50	13,527,500
ジャムコ	700	1,374.00	961,800
テルモ	47,000	4,586.00	215,542,000
クリエートメディック	400	900.00	360,000
日機装	3,500	909.00	3,181,500
日本エム・ディ・エム	900	980.00	882,000
島津製作所	18,600	4,565.00	84,909,000

JMS	1,400	566.00	792,400
長野計器	1,100	1,938.00	2,131,800
ブイ・テクノロジー	700	2,502.00	1,751,400
東京計器	1,100	1,299.00	1,428,900
愛知時計電機	600	1,646.00	987,600
インターアクション	700	1,438.00	1,006,600
オーバル	1,000	411.00	411,000
東京精密	3,400	7,010.00	23,834,000
マニー	6,100	1,640.50	10,007,050
ニコン	22,100	1,750.50	38,686,050
トプコン	8,000	2,095.50	16,764,000
オリンパス	94,100	2,250.00	211,725,000
理研計器	900	5,410.00	4,869,000
タムロン	1,100	3,755.00	4,130,500
HOYA	32,600	17,945.00	585,007,000
シード	600	549.00	329,400
ノーリツ鋼機	1,400	2,288.00	3,203,200
A & Dホロンホールディングス	2,200	1,736.00	3,819,200
朝日インテック	17,100	2,820.00	48,222,000
シチズン時計	16,800	861.00	14,464,800
リズム	300	1,609.00	482,700
大研医器	900	514.00	462,600
メニコン	5,200	2,517.50	13,091,000
シンシア	100	556.00	55,600
松風	700	2,251.00	1,575,700
セイコーグループ	2,400	2,578.00	6,187,200
ニプロ	12,700	1,027.50	13,049,250
KYORITSU	1,700	139.00	236,300
中本パックス	300	1,622.00	486,600
スノーピーク	2,600	1,860.00	4,836,000
パラマウントベッドホールディングス	3,500	2,452.00	8,582,000
トランザクション	1,000	1,709.00	1,709,000
粧美堂	300	381.00	114,300
ニホンフラッシュ	1,400	978.00	1,369,200
前田工織	1,300	3,120.00	4,056,000
永大産業	1,200	209.00	250,800
アートネイチャー	1,600	766.00	1,225,600
バンダイナムコホールディングス	41,800	3,493.00	146,007,400
アイフィスジャパン	300	620.00	186,000
SHOEI	3,400	2,605.00	8,857,000
フランスベッドホールディングス	1,900	1,121.00	2,129,900
パイロットコーポレーション	2,400	4,488.00	10,771,200

萩原工業	1,000	1,425.00	1,425,000
フジシールインターナショナル	3,100	1,531.00	4,746,100
タカラトミー	7,000	1,767.00	12,369,000
広済堂ホールディングス	800	2,126.00	1,700,800
エステールホールディングス	300	614.00	184,200
タカノ	400	726.00	290,400
プロネクサス	1,300	978.00	1,271,400
ホクシン	800	133.00	106,400
ウッドワン	400	1,147.00	458,800
大建工業	900	2,320.00	2,088,000
凸版印刷	20,000	3,095.00	61,900,000
大日本印刷	16,700	4,048.00	67,601,600
共同印刷	400	3,030.00	1,212,000
N I S S H A	2,900	1,570.00	4,553,000
光村印刷	100	1,194.00	119,400
TAKARA & COMPANY	1,000	2,282.00	2,282,000
アシックス	14,100	4,344.00	61,250,400
ツツミ	300	2,158.00	647,400
ローランド	1,100	4,300.00	4,730,000
小松ウオール工業	600	2,579.00	1,547,400
ヤマハ	9,600	5,834.00	56,006,400
河合楽器製作所	400	3,250.00	1,300,000
クリナップ	1,700	693.00	1,178,100
ピジョン	9,700	2,055.50	19,938,350
キングジム	1,300	916.00	1,190,800
リンテック	3,100	2,250.50	6,976,550
イトーキ	3,100	952.00	2,951,200
任天堂	96,400	6,225.00	600,090,000
三菱鉛筆	2,200	1,719.00	3,781,800
タカラスタANDARD	2,800	1,784.00	4,995,200
コクヨ	7,400	1,920.00	14,208,000
ナカバヤシ	1,600	485.00	776,000
グローブライド	1,200	2,237.00	2,684,400
オカムラ	4,600	1,970.00	9,062,000
美津濃	1,500	3,820.00	5,730,000
東京電力ホールディングス	137,600	492.90	67,823,040
中部電力	56,200	1,719.50	96,635,900
関西電力	59,000	1,773.00	104,607,000
中国電力	24,300	924.20	22,458,060
北陸電力	14,400	765.80	11,027,520
東北電力	37,300	880.30	32,835,190
四国電力	13,000	982.00	12,766,000

九州電力	35,100	911.20	31,983,120
北海道電力	14,700	604.00	8,878,800
沖縄電力	3,600	1,164.00	4,190,400
電源開発	11,500	2,065.00	23,747,500
エフオン	1,000	553.00	553,000
イーレックス	2,700	1,131.00	3,053,700
レノバ	4,100	1,545.00	6,334,500
東京瓦斯	32,300	3,218.00	103,941,400
大阪瓦斯	30,900	2,242.00	69,277,800
東邦瓦斯	6,000	2,506.00	15,036,000
北海道瓦斯	900	2,259.00	2,033,100
広島ガス	3,200	369.00	1,180,800
西部ガスホールディングス	1,400	2,134.00	2,987,600
静岡ガス	3,500	1,244.00	4,354,000
メタウォーター	1,900	1,866.00	3,545,400
SBSホールディングス	1,400	3,260.00	4,564,000
東武鉄道	16,800	3,749.00	62,983,200
相鉄ホールディングス	5,000	2,615.00	13,075,000
東急	42,800	1,786.00	76,440,800
京浜急行電鉄	17,300	1,302.00	22,524,600
小田急電鉄	23,100	1,999.00	46,176,900
京王電鉄	8,100	4,661.00	37,754,100
京成電鉄	9,800	5,793.00	56,771,400
富士急行	1,900	5,060.00	9,614,000
東日本旅客鉄道	25,900	7,816.00	202,434,400
西日本旅客鉄道	19,500	5,972.00	116,454,000
東海旅客鉄道	11,800	17,715.00	209,037,000
西武ホールディングス	18,400	1,510.00	27,784,000
鴻池運輸	2,600	1,582.00	4,113,200
西日本鉄道	4,100	2,416.00	9,905,600
ハマキョウレックス	1,200	3,730.00	4,476,000
サカイ引越センター	700	4,900.00	3,430,000
近鉄グループホールディングス	15,200	4,902.00	74,510,400
阪急阪神ホールディングス	20,300	4,714.00	95,694,200
南海電気鉄道	7,300	3,225.00	23,542,500
京阪ホールディングス	8,400	3,721.00	31,256,400
神戸電鉄	400	3,065.00	1,226,000
名古屋鉄道	16,800	2,371.50	39,841,200
山陽電気鉄道	1,100	2,205.00	2,425,500
アルプス物流	1,200	1,422.00	1,706,400
ヤマトホールディングス	19,500	2,553.50	49,793,250
山九	3,900	4,890.00	19,071,000

丸運	400	237.00	94,800
丸全昭和運輸	900	3,870.00	3,483,000
センコーグループホールディングス	8,000	980.00	7,840,000
トナミホールディングス	300	4,495.00	1,348,500
ニッコンホールディングス	4,900	2,847.00	13,950,300
日本石油輸送	100	2,679.00	267,900
福山通運	1,200	3,700.00	4,440,000
セイノーホールディングス	9,400	1,994.00	18,743,600
エスライン	300	805.00	241,500
神奈川中央交通	400	3,150.00	1,260,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	3,700	1,988.00	7,355,600
C & F ロジホールディングス	1,400	1,210.00	1,694,000
九州旅客鉄道	10,800	3,039.00	32,821,200
S Gホールディングス	29,200	2,117.50	61,831,000
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	5,700	8,342.00	47,549,400
日本郵船	40,800	3,069.00	125,215,200
商船三井	26,900	3,316.00	89,200,400
川崎汽船	11,500	3,252.00	37,398,000
N Sユナイテッド海運	900	3,425.00	3,082,500
飯野海運	5,700	816.00	4,651,200
乾汽船	2,000	1,299.00	2,598,000
日本航空	37,400	2,857.50	106,870,500
A N Aホールディングス	41,500	3,194.00	132,551,000
パスコ	200	1,771.00	354,200
トランコム	400	6,620.00	2,648,000
日新	1,200	2,516.00	3,019,200
三菱倉庫	3,300	3,599.00	11,876,700
三井倉庫ホールディングス	1,400	3,535.00	4,949,000
住友倉庫	4,100	2,373.00	9,729,300
澁澤倉庫	600	2,639.00	1,583,400
東陽倉庫	1,500	269.00	403,500
日本トランスシティ	3,100	633.00	1,962,300
ケイヒン	200	1,736.00	347,200
中央倉庫	700	1,056.00	739,200
川西倉庫	200	1,017.00	203,400
安田倉庫	1,000	980.00	980,000
ファイズホールディングス	200	1,230.00	246,000
東洋埠頭	300	1,335.00	400,500
上組	7,300	3,306.00	24,133,800
サンリツ	200	732.00	146,400
キムラユニティー	600	1,200.00	720,000
キューソー流通システム	700	958.00	670,600

東海運	700	282.00	197,400
エーアイティー	1,000	1,835.00	1,835,000
内外トランスライン	600	2,449.00	1,469,400
日本コンセプト	500	1,711.00	855,500
N E C ネットズエスアイ	5,100	1,989.00	10,143,900
クロスキャット	900	1,142.00	1,027,800
システナ	25,700	314.00	8,069,800
デジタルアーツ	1,000	6,200.00	6,200,000
日鉄ソリューションズ	2,600	4,145.00	10,777,000
キューブシステム	900	1,243.00	1,118,700
コア	700	1,714.00	1,199,800
手間いらず	300	3,810.00	1,143,000
ラクーンホールディングス	1,300	749.00	973,700
ソリトンシステムズ	800	1,174.00	939,200
ソフトクリエイイトホールディングス	1,300	1,711.00	2,224,300
T I S	16,700	3,619.00	60,437,300
J N S ホールディングス	600	583.00	349,800
グリー	4,100	662.00	2,714,200
G M O ペパボ	200	1,749.00	349,800
コーエーテクモホールディングス	9,600	2,374.50	22,795,200
三菱総合研究所	800	5,300.00	4,240,000
ボルテージ	400	309.00	123,600
電算	200	1,623.00	324,600
A G S	500	731.00	365,500
ファインデックス	1,200	608.00	729,600
K L a b	3,100	344.00	1,066,400
ポールトゥウィンホールディングス	2,600	810.00	2,106,000
ネクソン	39,700	2,923.50	116,062,950
アイスタイル	4,500	714.00	3,213,000
エムアップホールディングス	1,900	1,229.00	2,335,100
エイチーム	900	686.00	617,400
エニグモ	2,000	400.00	800,000
テクノスジャパン	1,000	613.00	613,000
e n i s h	900	775.00	697,500
コロブラ	6,000	675.00	4,050,000
ブロードリーフ	9,000	438.00	3,942,000
クロス・マーケティンググループ	700	743.00	520,100
デジタルハーツホールディングス	1,000	1,303.00	1,303,000
システム情報	1,200	747.00	896,400
メディアドゥ	600	1,488.00	892,800
じげん	4,500	742.00	3,339,000
バイキューブ	1,800	484.00	871,200

エンカレッジ・テクノロジー	300	519.00	155,700
サイバーリンクス	400	683.00	273,200
フィックスターズ	1,700	1,331.00	2,262,700
CARTA HOLDINGS	700	1,317.00	921,900
オブティム	1,300	1,060.00	1,378,000
セレス	600	942.00	565,200
SHIFT	1,000	26,995.00	26,995,000
ティーガイア	1,600	1,769.00	2,830,400
セック	200	3,305.00	661,000
テクマトリックス	2,800	1,813.00	5,076,400
プロシップ	700	1,459.00	1,021,300
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,500	2,907.00	13,081,500
GMOペイメントゲートウェイ	3,100	11,570.00	35,867,000
ザッパラス	400	348.00	139,200
システムリサーチ	500	2,606.00	1,303,000
インターネットイニシアティブ	8,500	2,751.50	23,387,750
さくらインターネット	1,700	706.00	1,200,200
ヴィンクス	400	1,458.00	583,200
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	3,370.00	1,685,000
SRAホールディングス	800	3,255.00	2,604,000
システムインテグレータ	400	448.00	179,200
朝日ネット	1,600	605.00	968,000
eBASE	2,100	785.00	1,648,500
アバントグループ	2,000	1,460.00	2,920,000
アドソル日進	700	1,770.00	1,239,000
ODKソリューションズ	300	558.00	167,400
フリービット	800	1,638.00	1,310,400
コムチュア	2,000	2,145.00	4,290,000
サイバーコム	200	1,530.00	306,000
アステリア	1,200	755.00	906,000
アイル	700	2,769.00	1,938,300
マークラインズ	800	2,543.00	2,034,400
メディカル・データ・ビジョン	2,300	726.00	1,669,800
gumi	2,300	654.00	1,504,200
ショーケース	300	389.00	116,700
モバイルファクトリー	300	901.00	270,300
テラスカイ	700	2,777.00	1,943,900
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	900	1,571.00	1,413,900
PCIホールディングス	500	1,036.00	518,000
アイビーシー	200	619.00	123,800
ネオジャパン	500	1,027.00	513,500
PR TIMES	400	1,407.00	562,800

ラクス	7,200	2,490.00	17,928,000
ランドコンピュータ	300	1,324.00	397,200
ダブルスタンダード	600	2,453.00	1,471,800
オープンドア	1,100	1,201.00	1,321,100
マイネット	400	338.00	135,200
アカツキ	700	2,051.00	1,435,700
ベネフィットジャパン	100	1,196.00	119,600
U b i c o mホールディングス	500	1,730.00	865,000
カナミックネットワーク	1,700	436.00	741,200
ノムラシステムコーポレーション	1,200	118.00	141,600
チェンジホールディングス	3,700	2,049.00	7,581,300
シンクロ・フード	800	704.00	563,200
オークネット	800	1,676.00	1,340,800
キャピタル・アセット・プランニング	300	738.00	221,400
エイトレッド	200	1,375.00	275,000
マクロミル	3,100	857.00	2,656,700
ビーグリー	200	1,155.00	231,000
オロ	500	2,183.00	1,091,500
ユーザーローカル	500	3,045.00	1,522,500
テモナ	300	283.00	84,900
マネーフォワード	3,700	6,316.00	23,369,200
サインポスト	500	500.00	250,000
Sun Asterisk	1,100	1,172.00	1,289,200
電算システムホールディングス	800	3,455.00	2,764,000
Appier Group	5,800	1,790.00	10,382,000
ソルクシーズ	1,000	437.00	437,000
フェイス	400	503.00	201,200
プロトコーポレーション	1,900	1,106.00	2,101,400
ハイマックス	500	1,451.00	725,500
野村総合研究所	30,500	3,786.00	115,473,000
サイバネットシステム	1,300	884.00	1,149,200
CEホールディングス	700	580.00	406,000
日本システム技術	500	2,565.00	1,282,500
インテージホールディングス	1,800	1,656.00	2,980,800
東邦システムサイエンス	400	1,211.00	484,400
ソースネクスト	7,800	200.00	1,560,000
インフォコム	2,000	2,356.00	4,712,000
シンプレクス・ホールディングス	2,600	2,514.00	6,536,400
HEROZ	500	2,163.00	1,081,500
ラクスル	3,700	1,260.00	4,662,000
メルカリ	9,200	3,284.00	30,212,800
I P S	500	2,230.00	1,115,000

F I G	1,500	277.00	415,500
システムサポート	600	2,126.00	1,275,600
イーソル	1,000	990.00	990,000
アルテリア・ネットワークス	1,500	1,968.00	2,952,000
東海ソフト	200	1,025.00	205,000
ウイングアーク1st	1,600	2,505.00	4,008,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,537.00	614,800
サーバーワークス	300	3,340.00	1,002,000
東名	100	2,515.00	251,500
ヴィッツ	100	1,496.00	149,600
トピラシステムズ	300	1,036.00	310,800
Sansan	5,000	1,815.50	9,077,500
Link-U	300	1,228.00	368,400
ギフトィ	1,700	1,750.00	2,975,000
メドレー	2,100	5,460.00	11,466,000
ベース	500	5,470.00	2,735,000
JMDC	2,500	5,985.00	14,962,500
フォーカスシステムズ	1,100	1,085.00	1,193,500
クレスコ	1,200	2,039.00	2,446,800
フジ・メディア・ホールディングス	14,700	1,358.50	19,969,950
オービック	5,100	23,655.00	120,640,500
ジャストシステム	2,200	4,490.00	9,878,000
TDCソフト	1,300	1,714.00	2,228,200
Zホールディングス	217,800	362.00	78,843,600
トレンドマイクロ	8,800	7,382.00	64,961,600
IDホールディングス	1,000	1,213.00	1,213,000
日本オラクル	2,900	11,295.00	32,755,500
アルファシステムズ	500	3,610.00	1,805,000
フューチャー	3,800	1,821.00	6,919,800
CAC Holdings	900	1,737.00	1,563,300
S Bテクノロジー	600	2,466.00	1,479,600
トーセ	400	765.00	306,000
オービックビジネスコンサルタント	3,000	5,520.00	16,560,000
伊藤忠テクノソリューションズ	8,200	3,647.00	29,905,400
アイティフォー	2,000	1,113.00	2,226,000
東計電算	200	6,410.00	1,282,000
エクスネット	200	1,027.00	205,400
大塚商会	8,700	5,690.00	49,503,000
サイボウズ	2,100	2,359.00	4,953,900
電通国際情報サービス	1,900	5,290.00	10,051,000
ACCESS	1,800	989.00	1,780,200
デジタルガレージ	2,700	3,845.00	10,381,500

EMシステムズ	2,600	848.00	2,204,800
ウェザーニューズ	500	6,680.00	3,340,000
C I J	2,500	636.00	1,590,000
ビジネスエンジニアリング	300	3,430.00	1,029,000
日本エンタープライズ	1,300	135.00	175,500
WOWOW	1,200	1,116.00	1,339,200
スカラ	1,400	795.00	1,113,000
インテリジェント ウェイブ	700	788.00	551,600
I M A G I C A G R O U P	1,300	602.00	782,600
ネットワンシステムズ	5,700	3,405.00	19,408,500
システムソフト	5,600	76.00	425,600
アルゴグラフィックス	1,400	4,050.00	5,670,000
マーベラス	2,500	667.00	1,667,500
エイベックス	2,600	1,507.00	3,918,200
B I P R O G Y	5,600	3,564.00	19,958,400
都築電気	800	1,864.00	1,491,200
T B S ホールディングス	7,800	2,418.50	18,864,300
日本テレビホールディングス	13,500	1,319.00	17,806,500
朝日放送グループホールディングス	1,400	646.00	904,400
テレビ朝日ホールディングス	3,700	1,567.00	5,797,900
スカパーJ S A Tホールディングス	13,600	574.00	7,806,400
テレビ東京ホールディングス	1,100	2,965.00	3,261,500
日本BS放送	500	911.00	455,500
ビジョン	2,000	1,869.00	3,738,000
スマートバリュー	300	397.00	119,100
U S E N - N E X T H O L D I N G S	1,700	3,440.00	5,848,000
日本通信	14,200	265.00	3,763,000
クロップス	200	1,062.00	212,400
日本電信電話	196,100	4,081.00	800,284,100
K D D I	118,300	4,523.00	535,070,900
ソフトバンク	246,000	1,524.00	374,904,000
光通信	1,800	21,625.00	38,925,000
エムティーアイ	1,100	663.00	729,300
G M O インターネットグループ	5,700	2,699.00	15,384,300
ファイバーゲート	700	1,501.00	1,050,700
アйдママーケティングコミュニケーション	300	273.00	81,900
K A D O K A W A	8,100	3,464.00	28,058,400
学研ホールディングス	2,600	884.00	2,298,400
ゼンリン	2,600	925.00	2,405,000
昭文社ホールディングス	600	299.00	179,400
インプレスホールディングス	1,200	207.00	248,400
アイネット	900	1,513.00	1,361,700

松竹	900	11,545.00	10,390,500
東宝	9,600	5,703.00	54,748,800
東映	400	18,290.00	7,316,000
エヌ・ティ・ティ・データ	48,000	2,108.00	101,184,000
ピー・シー・エー	900	1,387.00	1,248,300
ビジネスブレイン太田昭和	700	2,493.00	1,745,100
D T S	3,300	3,545.00	11,698,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,700	6,864.00	52,852,800
シーイーシー	2,200	1,819.00	4,001,800
カプコン	15,200	5,532.00	84,086,400
アイ・エス・ピー	800	1,586.00	1,268,800
ジャステック	1,000	1,319.00	1,319,000
S C S K	12,500	2,298.00	28,725,000
N S W	600	2,515.00	1,509,000
アイネス	1,100	1,473.00	1,620,300
T K C	2,400	3,880.00	9,312,000
富士ソフト	1,700	9,200.00	15,640,000
N S D	5,500	2,817.00	15,493,500
コナミグループ	6,600	7,742.00	51,097,200
福井コンピュータホールディングス	1,100	2,994.00	3,293,400
J B C Cホールディングス	1,100	2,374.00	2,611,400
ミロク情報サービス	1,400	1,567.00	2,193,800
ソフトバンクグループ	75,500	6,492.00	490,146,000
高千穂交易	500	3,040.00	1,520,000
オルパヘルスケアホールディングス	200	1,978.00	395,600
伊藤忠食品	400	5,140.00	2,056,000
エレマテック	1,500	1,775.00	2,662,500
あらた	1,300	4,630.00	6,019,000
トーメンデバイス	200	5,810.00	1,162,000
東京エレクトロン デバイス	600	10,990.00	6,594,000
円谷フィールズホールディングス	2,800	2,852.00	7,985,600
双日	16,100	3,158.00	50,843,800
アルフレッサ ホールディングス	16,200	2,151.00	34,846,200
横浜冷凍	4,500	1,167.00	5,251,500
神栄	200	1,098.00	219,600
ラサ商事	600	1,430.00	858,000
アルコニックス	2,200	1,374.00	3,022,800
神戸物産	12,500	3,716.00	46,450,000
ハイパー	400	438.00	175,200
あい ホールディングス	2,600	2,365.00	6,149,000
ディーブイエックス	400	926.00	370,400
ダイワボウホールディングス	6,600	2,878.00	18,994,800

マクニカホールディングス	3,800	6,310.00	23,978,000
ラクト・ジャパン	700	2,012.00	1,408,400
グリムス	700	2,844.00	1,990,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,400	908.00	2,179,200
八洲電機	1,300	1,369.00	1,779,700
メディアスホールディングス	1,100	923.00	1,015,300
レスターホールディングス	1,600	2,537.00	4,059,200
ジューテックホールディングス	400	1,146.00	458,400
大光	600	576.00	345,600
OCHIホールディングス	300	1,234.00	370,200
TOKAIホールディングス	8,000	886.00	7,088,000
黒谷	500	598.00	299,000
Cominix	300	785.00	235,500
三洋貿易	1,900	1,394.00	2,648,600
ビューティガレージ	300	4,255.00	1,276,500
ウイン・パートナーズ	1,200	1,020.00	1,224,000
ミタチ産業	400	1,413.00	565,200
シップヘルスケアホールディングス	5,800	2,366.50	13,725,700
明治電機工業	600	1,374.00	824,400
デリカフーズホールディングス	600	583.00	349,800
スターティアホールディングス	300	1,170.00	351,000
コメダホールディングス	4,000	2,647.00	10,588,000
ピーバンドットコム	300	468.00	140,400
アセンテック	700	667.00	466,900
富士興産	300	1,404.00	421,200
協栄産業	200	2,146.00	429,200
フルサト・マルカホールディングス	1,600	2,462.00	3,939,200
ヤマエグループホールディングス	1,000	2,912.00	2,912,000
小野建	1,600	1,600.00	2,560,000
南陽	300	2,182.00	654,600
佐島電機	800	1,732.00	1,385,600
エコートレーディング	300	789.00	236,700
伯東	900	5,170.00	4,653,000
コンドーテック	1,300	1,126.00	1,463,800
中山福	900	342.00	307,800
ナガイレーベン	2,100	2,288.00	4,804,800
三菱食品	1,500	3,600.00	5,400,000
松田産業	1,300	2,210.00	2,873,000
第一興商	6,300	2,569.00	16,184,700
メディバルホールディングス	15,500	2,358.50	36,556,750
S P K	800	1,761.00	1,408,800
萩原電気ホールディングス	600	3,125.00	1,875,000

アズワン	2,300	5,893.00	13,553,900
スズデン	600	2,257.00	1,354,200
シモジマ	1,200	1,125.00	1,350,000
ドウシシャ	1,700	2,257.00	3,836,900
小津産業	300	1,595.00	478,500
高速	900	2,084.00	1,875,600
たけびし	600	1,707.00	1,024,200
リックス	300	2,944.00	883,200
丸文	1,500	1,307.00	1,960,500
ハピネット	1,400	2,101.00	2,941,400
橋本総業ホールディングス	700	1,215.00	850,500
日本ライフライン	4,800	1,079.00	5,179,200
タカショー	1,500	665.00	997,500
I D O M	5,000	885.00	4,425,000
進和	1,000	2,225.00	2,225,000
エスケイジャパン	400	547.00	218,800
ダイトロン	700	3,090.00	2,163,000
シークス	2,300	1,578.00	3,629,400
田中商事	500	634.00	317,000
オーハシテクニカ	800	1,592.00	1,273,600
白銅	600	2,380.00	1,428,000
ダイコー通産	200	1,117.00	223,400
伊藤忠商事	97,300	5,613.00	546,144,900
丸紅	126,100	2,403.00	303,018,300
高島	200	3,535.00	707,000
長瀬産業	7,400	2,417.50	17,889,500
蝶理	900	2,775.00	2,497,500
豊田通商	14,200	7,238.00	102,779,600
三共生興	2,500	563.00	1,407,500
兼松	6,300	1,984.00	12,499,200
ツカモトコーポレーション	200	1,349.00	269,800
三井物産	114,600	5,446.00	624,111,600
日本紙パルプ商事	900	5,050.00	4,545,000
カメイ	1,800	1,426.00	2,566,800
東都水産	100	6,470.00	647,000
O U G ホールディングス	200	2,441.00	488,200
スターゼン	1,300	2,356.00	3,062,800
山善	4,400	1,115.00	4,906,000
椿本興業	300	3,970.00	1,191,000
住友商事	100,000	3,049.00	304,900,000
内田洋行	700	5,700.00	3,990,000
三菱商事	99,900	6,792.00	678,520,800

第一実業	600	5,800.00	3,480,000
キヤノンマーケティングジャパン	3,800	3,614.00	13,733,200
西華産業	700	2,018.00	1,412,600
佐藤商事	1,200	1,440.00	1,728,000
菱洋エレクトロ	1,400	3,535.00	4,949,000
東京産業	1,600	887.00	1,419,200
ユアサ商事	1,500	4,470.00	6,705,000
神鋼商事	400	5,680.00	2,272,000
トルク	1,000	267.00	267,000
阪和興業	2,900	4,635.00	13,441,500
正栄食品工業	1,100	4,255.00	4,680,500
カナデン	1,100	1,303.00	1,433,300
R Y O D E N	1,400	2,101.00	2,941,400
岩谷産業	3,700	7,507.00	27,775,900
ナイス	400	1,485.00	594,000
ニチモウ	200	3,625.00	725,000
極東貿易	1,000	1,680.00	1,680,000
アステナホールディングス	3,000	453.00	1,359,000
三愛オブリ	4,300	1,507.00	6,480,100
稲畑産業	3,300	3,235.00	10,675,500
G S I クレオス	1,000	1,909.00	1,909,000
明和産業	2,200	678.00	1,491,600
クワザワホールディングス	600	453.00	271,800
ワキタ	3,000	1,308.00	3,924,000
東邦ホールディングス	4,000	2,572.00	10,288,000
サンゲツ	4,100	2,413.00	9,893,300
ミツウロコグループホールディングス	2,100	1,366.00	2,868,600
シナネンホールディングス	500	3,825.00	1,912,500
伊藤忠エネクス	4,100	1,229.00	5,038,900
サンリオ	4,600	5,836.00	26,845,600
サンワテクノス	800	2,410.00	1,928,000
リョーサン	1,700	4,050.00	6,885,000
新光商事	2,300	1,230.00	2,829,000
トーヨー	700	2,944.00	2,060,800
三信電気	700	2,147.00	1,502,900
東陽テクニカ	1,700	1,422.00	2,417,400
モスフードサービス	2,400	3,195.00	7,668,000
加賀電子	1,300	6,100.00	7,930,000
ソーダニッカ	1,000	796.00	796,000
立花エレテック	1,200	2,917.00	3,500,400
フォーバル	700	1,061.00	742,700
P A L T A C	2,500	5,185.00	12,962,500

三谷産業	3,000	316.00	948,000
太平洋興発	500	729.00	364,500
西本Wismettacホールディングス	400	4,520.00	1,808,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	2,029.00	202,900
コア商事ホールディングス	1,000	697.00	697,000
KPPグループホールディングス	3,900	621.00	2,421,900
ヤマタネ	800	1,642.00	1,313,600
丸紅建材リース	100	2,183.00	218,300
泉州電業	800	3,575.00	2,860,000
トラスコ中山	3,400	2,299.00	7,816,600
オートバックスセブン	5,700	1,530.00	8,721,000
モリト	1,200	1,048.00	1,257,600
加藤産業	2,000	3,990.00	7,980,000
北恵	400	744.00	297,600
イエローハット	2,900	1,843.00	5,344,700
JKホールディングス	1,300	967.00	1,257,100
日伝	1,000	2,270.00	2,270,000
北沢産業	800	402.00	321,600
杉本商事	800	2,064.00	1,651,200
因幡電機産業	4,200	3,340.00	14,028,000
東テク	600	4,230.00	2,538,000
ミスミグループ本社	24,400	3,102.00	75,688,800
アルテック	1,000	275.00	275,000
タキヒヨー	400	931.00	372,400
蔵王産業	200	2,234.00	446,800
スズケン	4,700	3,668.00	17,239,600
ジェコス	1,000	868.00	868,000
グローセル	1,700	412.00	700,400
ローソン	4,000	6,244.00	24,976,000
サンエー	1,200	4,560.00	5,472,000
カワチ薬品	1,300	2,176.00	2,828,800
エービーシー・マート	2,400	7,966.00	19,118,400
ハードオフコーポレーション	500	1,358.00	679,000
アスクル	3,400	1,904.00	6,473,600
ゲオホールディングス	1,600	1,649.00	2,638,400
アダストリア	2,000	2,980.00	5,960,000
ジーフット	900	271.00	243,900
シー・ヴィ・エス・バイエリア	200	494.00	98,800
くら寿司	1,900	3,050.00	5,795,000
キャンドウ	600	2,430.00	1,458,000
IKホールディングス	400	370.00	148,000
パルグループホールディングス	1,600	3,705.00	5,928,000

エディオン	6,400	1,392.00	8,908,800
サーラコーポレーション	3,500	768.00	2,688,000
ワッツ	600	703.00	421,800
ハローズ	700	3,450.00	2,415,000
フジオフードグループ本社	1,800	1,512.00	2,721,600
あみやき亭	400	3,500.00	1,400,000
ひらまつ	2,800	265.00	742,000
大黒天物産	500	5,080.00	2,540,000
ハニーズホールディングス	1,300	1,483.00	1,927,900
ファーマライズホールディングス	300	616.00	184,800
アルペン	1,400	1,989.00	2,784,600
ハブ	400	792.00	316,800
クオールホールディングス	2,200	1,818.00	3,999,600
ジーンズホールディングス	1,000	3,125.00	3,125,000
ビックカメラ	8,600	1,070.00	9,202,000
D C Mホールディングス	9,400	1,236.00	11,618,400
ペッパーフードサービス	4,000	130.00	520,000
Monotaro	22,900	1,880.50	43,063,450
東京一番フーズ	300	495.00	148,500
アークランドサービスホールディングス	1,300	2,929.00	3,807,700
J.フロント リテイリング	20,100	1,422.00	28,582,200
ドトール・日レスホールディングス	2,900	2,037.00	5,907,300
マツキヨココカラ&カンパニー	9,800	8,091.00	79,291,800
ブロンコビリー	900	2,916.00	2,624,400
Z O Z O	10,700	2,950.00	31,565,000
トレジャー・ファクトリー	800	1,571.00	1,256,800
物語コーポレーション	2,700	3,435.00	9,274,500
三越伊勢丹ホールディングス	27,200	1,465.50	39,861,600
Hamee	600	1,156.00	693,600
マーケットエンタープライズ	100	1,368.00	136,800
ウエルシアホールディングス	8,400	2,912.00	24,460,800
クリエイトSDホールディングス	2,700	3,505.00	9,463,500
丸善CHIホールディングス	1,500	351.00	526,500
ミサワ	200	608.00	121,600
ティーライフ	200	1,417.00	283,400
シュッピン	1,200	1,033.00	1,239,600
オイシックス・ラ・大地	2,200	2,327.00	5,119,400
ネクステージ	3,700	2,873.00	10,630,100
ジョイフル本田	4,800	1,751.00	8,404,800
鳥貴族ホールディングス	600	2,683.00	1,609,800
ホットランド	1,300	1,722.00	2,238,600
すかいらーくホールディングス	22,100	1,841.00	40,686,100

SFPホールディングス	900	2,012.00	1,810,800
綿半ホールディングス	1,200	1,370.00	1,644,000
ヨシックスホールディングス	300	2,270.00	681,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,300	1,105.00	5,856,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	840.00	672,000
BEENOS	700	1,798.00	1,258,600
あさひ	1,300	1,278.00	1,661,400
日本調剤	1,100	1,145.00	1,259,500
コスモス薬品	1,600	13,830.00	22,128,000
トーエル	600	744.00	446,400
セブン&アイ・ホールディングス	55,700	6,158.00	343,000,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	12,100	1,002.00	12,124,200
ツルハホールディングス	3,400	10,420.00	35,428,000
サンマルクホールディングス	1,300	1,903.00	2,473,900
フェリシモ	300	1,010.00	303,000
トリドールホールディングス	4,000	2,951.00	11,804,000
TOKYO BASE	1,700	380.00	646,000
ウイルプラスホールディングス	200	1,175.00	235,000
JMホールディングス	1,200	1,930.00	2,316,000
サツドラホールディングス	600	804.00	482,400
アレンザホールディングス	1,200	991.00	1,189,200
串カツ田中ホールディングス	400	1,698.00	679,200
パロックジャパンリミテッド	1,100	848.00	932,800
クスリのアオキホールディングス	1,400	7,851.00	10,991,400
力の源ホールディングス	700	1,383.00	968,100
FOOD & LIFE COMPANIE	8,600	3,049.00	26,221,400
メディカルシステムネットワーク	1,500	363.00	544,500
一家ホールディングス	300	625.00	187,500
ジャパングラフトホールディングス	400	558.00	223,200
はるやまホールディングス	600	476.00	285,600
ノジマ	5,300	1,390.00	7,367,000
カッパ・クリエイト	2,600	1,515.00	3,939,000
ライトオン	1,000	568.00	568,000
良品計画	17,600	1,395.00	24,552,000
パリミキホールディングス	1,600	327.00	523,200
アドヴァングループ	1,600	951.00	1,521,600
アルビス	500	2,384.00	1,192,000
コナカ	1,400	363.00	508,200
ハウス オブ ローゼ	200	1,601.00	320,200
G-7ホールディングス	2,100	1,272.00	2,671,200
イオン北海道	2,400	857.00	2,056,800

コジマ	2,700	568.00	1,533,600
ヒマラヤ	400	940.00	376,000
コーナン商事	2,200	3,505.00	7,711,000
エコス	600	1,871.00	1,122,600
ワタミ	2,000	896.00	1,792,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	32,600	2,518.00	82,086,800
西松屋チェーン	3,600	1,644.00	5,918,400
ゼンショーホールディングス	8,800	6,179.00	54,375,200
ハークスレイ	500	615.00	307,500
サイゼリヤ	2,400	3,610.00	8,664,000
V Tホールディングス	6,200	521.00	3,230,200
魚力	500	2,175.00	1,087,500
フジ・コーポレーション	900	1,511.00	1,359,900
ユナイテッドアローズ	1,700	2,411.00	4,098,700
ハイデイ日高	2,400	2,353.00	5,647,200
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	800	195.00	156,000
コロワイド	7,400	1,991.00	14,733,400
ピーシーデボコーポレーション	1,900	479.00	910,100
壱番屋	1,300	5,360.00	6,968,000
P L A N T	300	694.00	208,200
スギホールディングス	3,300	6,004.00	19,813,200
薬王堂ホールディングス	900	2,578.00	2,320,200
スクロール	2,400	916.00	2,198,400
ヨンドシーホールディングス	1,400	1,787.00	2,501,800
木曽路	2,500	2,382.00	5,955,000
S R Sホールディングス	2,700	946.00	2,554,200
千趣会	3,000	418.00	1,254,000
リテールパートナーズ	2,400	1,680.00	4,032,000
ケーヨー	2,600	823.00	2,139,800
上新電機	1,500	1,940.00	2,910,000
日本瓦斯	8,700	1,979.50	17,221,650
ロイヤルホールディングス	3,100	2,689.00	8,335,900
東天紅	100	770.00	77,000
いなげや	1,600	1,545.00	2,472,000
チヨダ	1,600	861.00	1,377,600
ライフコーポレーション	1,400	3,020.00	4,228,000
リンガーハット	2,100	2,443.00	5,130,300
M r M a x H D	2,300	621.00	1,428,300
A O K Iホールディングス	3,100	834.00	2,585,400
オークワ	2,600	861.00	2,238,600
コメリ	2,500	2,959.00	7,397,500

青山商事	3,500	1,261.00	4,413,500
しまむら	1,900	13,335.00	25,336,500
はせがわ	700	337.00	235,900
高島屋	12,200	1,885.00	22,997,000
松屋	2,800	1,171.00	3,278,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,900	1,468.00	11,597,200
近鉄百貨店	700	2,541.00	1,778,700
丸井グループ	11,900	2,443.50	29,077,650
アクシアル リテイリング	1,100	3,555.00	3,910,500
イオン	54,800	2,796.00	153,220,800
イズミ	2,500	3,399.00	8,497,500
平和堂	2,700	2,121.00	5,726,700
フジ	2,500	1,824.00	4,560,000
ヤオコー	1,800	7,159.00	12,886,200
ゼビオホールディングス	2,200	1,115.00	2,453,000
ケーズホールディングス	11,400	1,241.00	14,147,400
Olympicグループ	500	543.00	271,500
日産東京販売ホールディングス	1,700	346.00	588,200
シルバーライフ	300	1,260.00	378,000
Genky DrugStores	700	4,110.00	2,877,000
ナルミヤ・インターナショナル	200	953.00	190,600
ブックオフグループホールディングス	800	1,251.00	1,000,800
ギフトホールディングス	300	5,130.00	1,539,000
アインホールディングス	2,200	5,024.00	11,052,800
元気寿司	500	3,235.00	1,617,500
ヤマダホールディングス	66,200	431.10	28,538,820
アーケランズ	2,400	1,577.00	3,784,800
ニトリホールディングス	6,500	17,105.00	111,182,500
愛眼	1,000	192.00	192,000
ケーユーホールディングス	1,000	1,276.00	1,276,000
吉野家ホールディングス	6,300	2,585.00	16,285,500
松屋フーズホールディングス	800	4,135.00	3,308,000
サガミホールディングス	2,600	1,257.00	3,268,200
関西フードマーケット	1,500	1,617.00	2,425,500
王将フードサービス	1,100	6,440.00	7,084,000
ミニストップ	1,200	1,455.00	1,746,000
アークス	3,000	2,447.00	7,341,000
パローホールディングス	3,100	1,951.00	6,048,100
ベルク	800	6,210.00	4,968,000
大庄	700	1,115.00	780,500
ファーストリテイリング	7,300	36,570.00	266,961,000
サンドラッグ	6,100	4,292.00	26,181,200

サクスパー ホールディングス	1,600	955.00	1,528,000	
ヤマザワ	200	1,254.00	250,800	
やまや	300	2,650.00	795,000	
ペルーナ	4,000	708.00	2,832,000	
いよぎんホールディングス	17,800	746.80	13,293,040	
しずおかフィナンシャルグループ	33,900	1,014.00	34,374,600	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	12,600	860.20	10,838,520	
楽天銀行	5,100	1,834.00	9,353,400	
島根銀行	400	480.00	192,000	
じもとホールディングス	1,000	383.00	383,000	
めぶきフィナンシャルグループ	74,400	340.90	25,362,960	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,900	3,130.00	5,947,000	
九州フィナンシャルグループ	26,400	546.10	14,417,040	
ゆうちょ銀行	42,100	1,088.50	45,825,850	
富山第一銀行	5,000	680.00	3,400,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	80,600	546.50	44,047,900	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,300	1,198.00	11,141,400	
三十三フィナンシャルグループ	1,300	1,539.00	2,000,700	
第四北越フィナンシャルグループ	2,300	3,070.00	7,061,000	
ひろぎんホールディングス	19,500	790.90	15,422,550	
おきなわフィナンシャルグループ	1,400	2,099.00	2,938,600	
十六フィナンシャルグループ	1,900	3,020.00	5,738,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,700	4,215.00	7,165,500	
プロクレアホールディングス	1,800	2,050.00	3,690,000	
あいちフィナンシャルグループ	2,100	2,179.00	4,575,900	
S B I 新生銀行	3,500	2,815.00	9,852,500	
あおぞら銀行	9,400	2,630.50	24,726,700	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	941,400	989.90	931,891,860	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	190,000	663.00	125,970,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	27,800	5,045.00	140,251,000	
三井住友フィナンシャルグループ	109,800	5,865.00	643,977,000	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	41,800	863.10	36,077,580	
群馬銀行	29,100	514.00	14,957,400	
武蔵野銀行	1,900	2,106.00	4,001,400	
千葉興業銀行	2,700	552.00	1,490,400	
筑波銀行	6,500	199.00	1,293,500	
七十七銀行	4,800	2,401.00	11,524,800	
秋田銀行	1,000	1,662.00	1,662,000	
山形銀行	1,600	1,070.00	1,712,000	
岩手銀行	1,000	2,016.00	2,016,000	
東邦銀行	11,900	227.00	2,701,300	

東北銀行	500	1,000.00	500,000
ふくおかフィナンシャルグループ	12,000	2,742.50	32,910,000
スルガ銀行	13,200	507.00	6,692,400
八十二銀行	31,716	616.30	19,546,570
山梨中央銀行	1,500	1,151.00	1,726,500
大垣共立銀行	2,900	1,817.00	5,269,300
福井銀行	1,300	1,421.00	1,847,300
清水銀行	600	1,420.00	852,000
富山銀行	200	1,631.00	326,200
滋賀銀行	2,500	2,704.00	6,760,000
南都銀行	2,300	2,369.00	5,448,700
百五銀行	14,200	407.00	5,779,400
京都銀行	4,800	7,140.00	34,272,000
紀陽銀行	5,300	1,457.00	7,722,100
ほくほくフィナンシャルグループ	9,500	1,150.00	10,925,000
山陰合同銀行	9,300	797.00	7,412,100
鳥取銀行	400	1,133.00	453,200
百十四銀行	1,400	1,754.00	2,455,600
四国銀行	2,400	840.00	2,016,000
阿波銀行	2,100	1,959.00	4,113,900
大分銀行	900	2,096.00	1,886,400
宮崎銀行	1,000	2,274.00	2,274,000
佐賀銀行	900	1,609.00	1,448,100
琉球銀行	3,400	901.00	3,063,400
セブン銀行	53,700	287.10	15,417,270
みずほフィナンシャルグループ	217,400	2,129.50	462,953,300
高知銀行	400	670.00	268,000
山口フィナンシャルグループ	16,500	907.00	14,965,500
名古屋銀行	1,000	3,270.00	3,270,000
北洋銀行	22,800	270.00	6,156,000
大光銀行	300	1,052.00	315,600
愛媛銀行	2,000	796.00	1,592,000
トマト銀行	400	1,010.00	404,000
京葉銀行	6,800	532.00	3,617,600
栃木銀行	6,700	246.00	1,648,200
北日本銀行	500	1,971.00	985,500
東和銀行	2,700	525.00	1,417,500
福島銀行	1,200	208.00	249,600
大東銀行	400	622.00	248,800
トモニホールディングス	12,100	359.00	4,343,900
フィデアホールディングス	1,500	1,308.00	1,962,000
池田泉州ホールディングス	19,100	236.00	4,507,600

F P G	5,100	1,195.00	6,094,500
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,200	1,116.00	1,339,200
マーキュリアホールディングス	700	747.00	522,900
S B Iホールディングス	21,800	2,835.00	61,803,000
ジャフコ グループ	5,000	1,843.50	9,217,500
大和証券グループ本社	107,500	729.80	78,453,500
野村ホールディングス	276,900	550.20	152,350,380
岡三証券グループ	13,300	483.00	6,423,900
丸三証券	5,000	451.00	2,255,000
東洋証券	5,000	309.00	1,545,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	16,500	388.00	6,402,000
光世証券	300	465.00	139,500
水戸証券	4,100	317.00	1,299,700
いちよし証券	2,700	609.00	1,644,300
松井証券	8,900	815.00	7,253,500
マネックスグループ	16,200	527.00	8,537,400
極東証券	1,900	655.00	1,244,500
岩井コスモホールディングス	1,700	1,465.00	2,490,500
アイザワ証券グループ	2,200	828.00	1,821,600
マネーパートナーズグループ	1,300	264.00	343,200
スパークス・グループ	1,700	1,589.00	2,701,300
かんぽ生命保険	18,200	2,127.00	38,711,400
S O M P Oホールディングス	25,800	6,487.00	167,364,600
アニコム ホールディングス	5,100	599.00	3,054,900
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	30,600	5,223.00	159,823,800
第一生命ホールディングス	73,500	2,635.00	193,672,500
東京海上ホールディングス	148,600	3,361.00	499,444,600
T & Dホールディングス	40,300	2,015.00	81,204,500
アドバンスクリエイト	800	1,185.00	948,000
全国保証	3,900	5,145.00	20,065,500
あんしん保証	600	307.00	184,200
ジェイリース	400	2,148.00	859,200
イントラスト	400	940.00	376,000
日本モーゲージサービス	700	568.00	397,600
C a s a	500	877.00	438,500
アルヒ	1,800	1,003.00	1,805,400
プレミアグループ	2,500	1,624.00	4,060,000
ネットプロテクションズホールディングス	4,900	367.00	1,798,300
クレディセゾン	9,500	2,087.00	19,826,500
芙蓉総合リース	1,400	10,830.00	15,162,000
みずほリース	2,200	4,520.00	9,944,000
東京センチュリー	2,800	5,353.00	14,988,400

日本証券金融	5,600	1,179.00	6,602,400
アイフル	24,900	343.00	8,540,700
リコーリース	1,400	4,045.00	5,663,000
イオンフィナンシャルサービス	8,600	1,279.00	10,999,400
アコム	26,800	336.70	9,023,560
ジャックス	1,600	4,805.00	7,688,000
オリエントコーポレーション	4,000	1,110.00	4,440,000
オリックス	98,700	2,529.50	249,661,650
三菱HCキャピタル	58,600	801.90	46,991,340
九州リースサービス	500	876.00	438,000
日本取引所グループ	42,300	2,561.50	108,351,450
イー・ギャランティ	2,500	1,917.00	4,792,500
アサックス	500	625.00	312,500
NECキャピタルソリューション	700	2,999.00	2,099,300
大東建託	5,500	14,230.00	78,265,000
いちご	17,800	268.00	4,770,400
日本駐車場開発	16,400	235.00	3,854,000
スター・マイカ・ホールディングス	1,500	645.00	967,500
SREホールディングス	800	4,175.00	3,340,000
ADワークスグループ	3,400	208.00	707,200
ヒューリック	35,200	1,237.00	43,542,400
三栄建築設計	800	1,533.00	1,226,400
野村不動産ホールディングス	9,400	3,507.00	32,965,800
三重交通グループホールディングス	3,400	572.00	1,944,800
サムティ	2,500	2,182.00	5,455,000
ディア・ライフ	2,700	779.00	2,103,300
コーセーアールイー	500	773.00	386,500
地主	1,200	1,963.00	2,355,600
プレサンスコーポレーション	2,400	1,947.00	4,672,800
THEグローバル社	1,100	213.00	234,300
ハウスコム	300	932.00	279,600
JPMC	900	1,120.00	1,008,000
サンセイランディック	500	872.00	436,000
エストラスト	300	638.00	191,400
フージャースホールディングス	2,400	996.00	2,390,400
オープンハウスグループ	5,500	5,451.00	29,980,500
東急不動産ホールディングス	45,300	845.40	38,296,620
飯田グループホールディングス	13,200	2,410.00	31,812,000
イーランド	300	1,500.00	450,000
ムゲンエステート	900	742.00	667,800
ビーロッド	1,000	643.00	643,000
ファーストブラザーズ	300	926.00	277,800

A n d D oホールディングス	1,000	1,155.00	1,155,000
シーアールイー	900	1,470.00	1,323,000
プロパティエージェント	200	1,149.00	229,800
ケイアイスター不動産	700	4,805.00	3,363,500
アグレ都市デザイン	300	1,538.00	461,400
グッドコムアセット	1,500	855.00	1,282,500
ジェイ・エス・ビー	400	4,885.00	1,954,000
ロードスターキャピタル	900	1,590.00	1,431,000
テンポイノベーション	500	1,066.00	533,000
グローバル・リンク・マネジメント	300	1,379.00	413,700
フェイスネットワーク	400	1,405.00	562,000
パーク24	11,800	2,134.00	25,181,200
パラカ	600	1,915.00	1,149,000
三井不動産	65,000	2,879.00	187,135,000
三菱地所	90,800	1,754.50	159,308,600
平和不動産	2,500	3,720.00	9,300,000
東京建物	14,400	1,914.00	27,561,600
京阪神ビルディング	2,600	1,176.00	3,057,600
住友不動産	27,200	3,698.00	100,585,600
テーオーシー	2,800	619.00	1,733,200
東京楽天地	300	4,185.00	1,255,500
スターツコーポレーション	2,200	2,878.00	6,331,600
フジ住宅	2,300	681.00	1,566,300
空港施設	2,000	546.00	1,092,000
明和地所	700	927.00	648,900
ゴールドクレスト	1,500	1,786.00	2,679,000
エスリード	700	2,598.00	1,818,600
日神グループホールディングス	2,600	534.00	1,388,400
日本エスコン	3,500	810.00	2,835,000
M I R A R T Hホールディングス	7,900	435.00	3,436,500
A V A N T I A	800	834.00	667,200
イオンモール	7,900	1,795.00	14,180,500
毎日コムネット	600	738.00	442,800
ファースト住建	600	1,091.00	654,600
カチタス	4,100	2,285.00	9,368,500
トーセイ	2,600	1,802.00	4,685,200
サンフロンティア不動産	2,600	1,395.00	3,627,000
F Jネクストホールディングス	1,700	1,015.00	1,725,500
インテリックス	500	550.00	275,000
ランドビジネス	800	242.00	193,600
グランディハウス	1,200	571.00	685,200
日本空港ビルデング	5,300	6,410.00	33,973,000

明豊ファシリティワークス	600	740.00	444,000
日本工営	900	3,800.00	3,420,000
L I F U L L	5,300	275.00	1,457,500
M I X I	3,600	2,764.00	9,950,400
ジェイエイシーリクルートメント	1,400	2,500.00	3,500,000
日本M&Aセンターホールディングス	26,900	1,086.00	29,213,400
メンバーズ	500	1,585.00	792,500
中広	200	403.00	80,600
UTグループ	2,300	2,993.00	6,883,900
アイティメディア	600	1,320.00	792,000
E・Jホールディングス	900	1,566.00	1,409,400
オープンアップグループ	4,700	2,166.00	10,180,200
コシダカホールディングス	4,700	1,182.00	5,555,400
アルトナー	300	1,718.00	515,400
パソナグループ	1,900	1,718.00	3,264,200
C D S	300	1,797.00	539,100
リンクアンドモチベーション	4,500	438.00	1,971,000
エス・エム・エス	6,000	3,010.00	18,060,000
サニーサイドアップグループ	400	661.00	264,400
パーソルホールディングス	17,300	2,763.00	47,799,900
リニカル	700	840.00	588,000
クックパッド	4,300	181.00	778,300
エスクリ	500	360.00	180,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	600	600.00	360,000
学情	700	1,776.00	1,243,200
スタジオアリス	800	2,175.00	1,740,000
シミックホールディングス	800	1,978.00	1,582,400
エプコ	300	761.00	228,300
N J S	400	2,702.00	1,080,800
総合警備保障	5,800	3,999.00	23,194,200
カカクコム	11,500	2,036.50	23,419,750
アイロムグループ	600	1,890.00	1,134,000
セントケア・ホールディング	1,000	755.00	755,000
サイネックス	200	619.00	123,800
ルネサンス	1,100	901.00	991,100
ディップ	2,700	3,490.00	9,423,000
デジタルホールディングス	1,200	1,059.00	1,270,800
新日本科学	1,700	2,145.00	3,646,500
キャリアデザインセンター	300	1,480.00	444,000
ベネフィット・ワン	7,300	1,626.50	11,873,450
エムスリー	31,000	3,253.00	100,843,000
ツカダ・グローバルホールディング	800	488.00	390,400

プラス	100	1,047.00	104,700
アウトソーシング	9,300	1,378.50	12,820,050
ウェルネット	900	616.00	554,400
ワールドホールディングス	700	2,780.00	1,946,000
ディー・エヌ・エー	6,300	1,899.00	11,963,700
博報堂D Yホールディングス	20,000	1,523.50	30,470,000
ぐるなび	2,900	372.00	1,078,800
タカミヤ	2,100	505.00	1,060,500
ジャパンベストレスキューシステム	800	701.00	560,800
ファンコミュニケーションズ	3,100	400.00	1,240,000
ライク	600	1,617.00	970,200
ビジネス・ブレークスルー	500	436.00	218,000
エスプール	4,500	532.00	2,394,000
WDBホールディングス	800	2,206.00	1,764,800
ティア	700	438.00	306,600
C D G	100	1,401.00	140,100
アドウェイズ	2,100	680.00	1,428,000
バリューコマース	1,200	1,441.00	1,729,200
インフォマート	16,300	295.00	4,808,500
J Pホールディングス	4,400	339.00	1,491,600
エコナックホールディングス	2,200	93.00	204,600
C Lホールディングス	400	889.00	355,600
プレステージ・インターナショナル	6,600	660.00	4,356,000
アミューズ	800	1,835.00	1,468,000
ドリームインキュベータ	500	2,894.00	1,447,000
クイック	1,200	2,098.00	2,517,600
T A C	600	200.00	120,000
電通グループ	15,400	4,730.00	72,842,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	400	1,186.00	474,400
ぴあ	500	3,345.00	1,672,500
イオンファンタジー	700	3,390.00	2,373,000
シーティーエス	1,700	738.00	1,254,600
ネクシィーズグループ	400	660.00	264,000
H . U . グループホールディングス	4,600	2,741.00	12,608,600
アルプス技研	1,400	2,961.00	4,145,400
日本空調サービス	1,700	766.00	1,302,200
オリエンタルランド	83,000	5,447.00	452,101,000
ダスキン	3,500	3,152.00	11,032,000
明光ネットワークジャパン	1,900	645.00	1,225,500
ファルコホールディングス	700	1,863.00	1,304,100
秀英予備校	300	405.00	121,500
ラウンドワン	13,100	589.00	7,715,900

リゾートトラスト	6,200	2,185.00	13,547,000
ビー・エム・エル	2,000	3,080.00	6,160,000
りらいあコミュニケーションズ	2,600	1,464.00	3,806,400
リゾー教育	7,200	286.00	2,059,200
早稲田アカデミー	900	1,375.00	1,237,500
ユー・エス・エス	16,100	2,405.50	38,728,550
東京個別指導学院	1,800	530.00	954,000
サイバーエージェント	34,600	1,046.50	36,208,900
楽天グループ	94,100	518.50	48,790,850
クリーク・アンド・リバー社	900	1,978.00	1,780,200
SBIグローバルアセットマネジメント	2,600	503.00	1,307,800
テー・オー・ダブリュー	3,000	323.00	969,000
山田コンサルティンググループ	800	1,698.00	1,358,400
セントラルスポーツ	600	2,427.00	1,456,200
フルキャストホールディングス	1,500	2,369.00	3,553,500
エン・ジャパン	2,800	2,603.00	7,288,400
リソルホールディングス	100	4,675.00	467,500
テクノプロ・ホールディングス	9,300	3,380.00	31,434,000
アトラグループ	300	178.00	53,400
インターワークス	300	333.00	99,900
アイ・アールジャパンホールディングス	800	1,611.00	1,288,800
Keeper 技研	1,000	5,080.00	5,080,000
ファーストロジック	100	961.00	96,100
三機サービス	200	1,073.00	214,600
Gunosy	1,200	610.00	732,000
デザインワン・ジャパン	300	175.00	52,500
イー・ガーディアン	600	2,010.00	1,206,000
リブセンス	600	259.00	155,400
ジャパンマテリアル	4,800	2,398.00	11,510,400
ベクトル	2,500	1,345.00	3,362,500
ウチヤマホールディングス	500	315.00	157,500
チャーム・ケア・コーポレーション	1,300	1,295.00	1,683,500
キャリアリンク	600	2,923.00	1,753,800
I B J	1,000	650.00	650,000
アサンテ	800	1,659.00	1,327,200
バリューHR	1,300	1,402.00	1,822,600
M&Aキャピタルパートナーズ	1,300	3,350.00	4,355,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,028.00	616,800
E R Iホールディングス	300	1,338.00	401,400
アピスト	200	3,110.00	622,000
シグマクシス・ホールディングス	2,400	1,243.00	2,983,200
ウィルグループ	1,300	1,097.00	1,426,100

エスクロー・エージェント・ジャパン	1,300	143.00	185,900
メドピア	1,400	993.00	1,390,200
レアジョブ	200	961.00	192,200
リクルートホールディングス	116,200	4,885.00	567,637,000
エラン	2,000	820.00	1,640,000
土木管理総合試験所	500	335.00	167,500
日本郵政	188,800	1,013.00	191,254,400
ベルシステム24ホールディングス	2,100	1,393.00	2,925,300
鎌倉新書	1,800	723.00	1,301,400
S MN	300	455.00	136,500
一蔵	200	561.00	112,200
グローバルキッズCOMPANY	200	679.00	135,800
エアトリ	1,100	2,722.00	2,994,200
アトラエ	900	743.00	668,700
ストライク	700	3,330.00	2,331,000
ソラスト	4,300	683.00	2,936,900
セラク	500	1,497.00	748,500
インソース	3,400	1,261.00	4,287,400
ベイカレント・コンサルティング	12,400	5,516.00	68,398,400
Orchestra Holdings	300	1,290.00	387,000
アイモバイル	700	1,157.00	809,900
キャリアインデックス	400	294.00	117,600
MS - Japan	400	1,021.00	408,400
船場	200	736.00	147,200
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,600	1,872.00	10,483,200
フルテック	200	1,096.00	219,200
グリーンズ	400	1,178.00	471,200
ツナググループ・ホールディングス	400	605.00	242,000
GameWith	400	384.00	153,600
MS&Consulting	100	609.00	60,900
ウェルビー	1,100	468.00	514,800
エル・ティー・エス	200	3,240.00	648,000
ミダックホールディングス	900	1,582.00	1,423,800
日総工産	1,200	913.00	1,095,600
キュービーネットホールディングス	800	1,408.00	1,126,400
RPAホールディングス	2,200	417.00	917,400
スプリックス	400	779.00	311,600
マネジメントソリューションズ	900	3,740.00	3,366,000
プロレド・パートナーズ	400	526.00	210,400
and factory	400	396.00	158,400
テノ・ホールディングス	200	678.00	135,600
フロンティア・マネジメント	500	1,203.00	601,500

ピアラ	200	503.00	100,600
コプロ・ホールディングス	200	2,225.00	445,000
ギークス	200	763.00	152,600
アンビスホールディングス	1,700	3,080.00	5,236,000
カーブスホールディングス	4,300	724.00	3,113,200
フォーラムエンジニアリング	900	1,168.00	1,051,200
Fast Fitness Japan	500	1,233.00	616,500
ダイレクトマーケティングミックス	1,800	885.00	1,593,000
ポピンズ	200	1,564.00	312,800
LITALICO	1,200	2,507.00	3,008,400
アドバンテッジリスクマネジメント	600	610.00	366,000
リログループ	8,700	2,089.50	18,178,650
東祥	1,100	1,150.00	1,265,000
ビーウィズ	400	2,068.00	827,200
TREホールディングス	3,300	1,186.00	3,913,800
人・夢・技術グループ	600	1,497.00	898,200
大栄環境	4,000	2,442.00	9,768,000
日本管財ホールディングス	1,600	2,570.00	4,112,000
エイチ・アイ・エス	4,100	2,063.00	8,458,300
ラックランド	700	3,350.00	2,345,000
共立メンテナンス	2,700	5,415.00	14,620,500
イチネンホールディングス	1,700	1,347.00	2,289,900
建設技術研究所	800	3,525.00	2,820,000
スペース	1,100	1,047.00	1,151,700
燦ホールディングス	700	2,202.00	1,541,400
スバル興業	100	9,590.00	959,000
東京テアトル	500	1,130.00	565,000
タナベコンサルティンググループ	500	911.00	455,500
ナガワ	400	6,710.00	2,684,000
東京都競馬	1,300	4,085.00	5,310,500
常磐興産	400	1,224.00	489,600
カナモト	2,900	2,184.00	6,333,600
ニシオホールディングス	1,500	3,305.00	4,957,500
トランス・コスモス	1,900	3,570.00	6,783,000
乃村工藝社	6,900	970.00	6,693,000
藤田観光	700	3,580.00	2,506,000
KNT-CTホールディングス	900	1,371.00	1,233,900
トーカイ	1,400	1,867.00	2,613,800
白洋舎	200	2,733.00	546,600
セコム	16,000	9,612.00	153,792,000
セントラル警備保障	900	2,892.00	2,602,800
丹青社	3,100	783.00	2,427,300

メイテック	6,100	2,490.00	15,189,000	
応用地質	1,500	1,976.00	2,964,000	
船井総研ホールディングス	3,300	2,619.00	8,642,700	
進学会ホールディングス	400	291.00	116,400	
オオバ	700	755.00	528,500	
いであ	300	1,677.00	503,100	
学究社	600	2,153.00	1,291,800	
ベネッセホールディングス	5,800	1,834.50	10,640,100	
イオンディライト	1,700	2,996.00	5,093,200	
ナック	700	953.00	667,100	
ダイセキ	3,200	3,860.00	12,352,000	
ステップ	600	1,814.00	1,088,400	
合 計	17,871,516		50,071,963,440	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

貸借対照表

（単位：円）

	2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	303,213,694	392,582,669
コール・ローン	1,743,162,589	2,404,087,335
株式	248,978,169,684	286,332,550,594
投資証券	5,871,568,844	6,058,893,330
派生商品評価勘定	34,156,145	150,652,465
未収入金	580,051	9,854,554
未収配当金	289,470,100	364,951,463
差入委託証拠金	2,006,859,583	725,937,219
流動資産合計	259,227,180,690	296,439,509,629
資産合計	259,227,180,690	296,439,509,629
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	42,961,073	168,335
未払金	3,237,100	-
未払解約金	22,573,274	69,512,256
未払利息	2,845	4,434

	2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
流動負債合計	68,774,292	69,685,025
負債合計	68,774,292	69,685,025
純資産の部		
元本等		
元本	60,264,747,727	60,758,637,464
剰余金		
剰余金又は欠損金()	198,893,658,671	235,611,187,140
元本等合計	259,158,406,398	296,369,824,604
純資産合計	259,158,406,398	296,369,824,604
負債純資産合計	259,227,180,690	296,439,509,629

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12月15日現在	2023年 6月15日現在
1. 期首	2022年 6月16日	2022年12月16日
期首元本額	59,803,606,565円	60,264,747,727円
期首からの追加設定元本額	6,652,512,959円	4,884,841,617円
期首からの一部解約元本額	6,191,371,797円	4,390,951,880円

	2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
元本の内訳		
インデックスファンド海外株式ヘッジなし(D C 専用)	30,297,136,142円	31,688,666,926円
D C インデックスバランス(株式 2 0)	117,948,562円	119,933,154円
D C インデックスバランス(株式 4 0)	320,400,325円	326,215,035円
D C インデックスバランス(株式 6 0)	643,489,107円	679,837,435円
D C インデックスバランス(株式 8 0)	707,055,714円	776,578,315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	1,441,704,173円	1,348,115,199円
日興五大陸株式ファンド	3,631,602,575円	3,541,615,542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)	14,003,581円	12,785,673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)	86,196,465円	83,401,210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)	5,918,140,127円	5,827,084,962円
グローバル 3 倍 3 分法ファンド(適格機関投資家向け)	11,011,449,444円	10,393,797,327円
Tracers グローバル 3 分法(おとなの balan ス)	- 円	3,460,606円
インデックスファンド M S C I オール・カンントリー(全 世界株式)	- 円	1,898,165円
Tracers M S C I オール・カンントリー・イン デックス(全世界株式)	- 円	118,798,873円
国際分散型ファンド 4 0 (適格機関投資家向け)	1,752,322,548円	1,560,582,133円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式 2 0)	17,780,507円	17,639,406円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式 4 0)	50,821,739円	48,807,373円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式 6 0)	77,405,650円	76,872,757円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式 8 0)	76,875,596円	77,183,846円
インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	4,100,415,472円	4,055,363,527円
計	60,264,747,727円	60,758,637,464円
2. 受益権の総数	60,264,747,727口	60,758,637,464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 2022年 6月16日 至 2022年12月15日	自 2022年12月16日 至 2023年 6月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

	自 2022年 6月16日 至 2022年12月15日	自 2022年12月16日 至 2023年 6月15日
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、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

	2022年12月15日現在	2023年 6月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2022年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	10,364,761,548
投資証券	453,574,765
合計	10,818,336,313

(2023年 6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	32,480,064,809
投資証券	202,797,894
合計	32,682,862,703

(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)

(2022年12月15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	4,236,961,880	-		4,260,917,849	23,955,969
	合計	4,236,961,880	-		4,260,917,849	23,955,969

(2023年 6月15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	3,656,855,426	-		3,710,757,191	53,901,765
	合計	3,656,855,426	-		3,710,757,191	53,901,765

(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)

(2022年12月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,967,071,862	-	1,934,310,965	32,760,897
	米ドル	1,430,539,070	-	1,400,122,120	30,416,950
	ユーロ	536,532,792	-	534,188,845	2,343,947
合計		1,967,071,862	-	1,934,310,965	32,760,897

(2023年 6月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,441,648,990	-	2,538,231,355	96,582,365
	米ドル	2,054,784,600	-	2,136,243,960	81,459,360
	ユーロ	386,864,390	-	401,987,395	15,123,005
合計		2,441,648,990	-	2,538,231,355	96,582,365

(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)

2022年12月15日現在		2023年 6月15日現在	
1口当たり純資産額	4.3003円	1口当たり純資産額	4.8778円
(1万口当たり純資産額)	(43,003円)	(1万口当たり純資産額)	(48,778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	33.65	429,037.50	
	BAKER HUGHES CO	40,615	29.94	1,216,013.10	
	CHENIERE ENERGY INC	8,900	147.00	1,308,300.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	3,750	79.76	299,100.00	
	CHEVRON CORP	71,931	157.09	11,299,640.79	
	CONOCOPHILLIPS	48,686	102.67	4,998,591.62	
	COTERRA ENERGY INC	32,460	24.26	787,479.60	
	DEVON ENERGY CORPORATION	25,260	48.95	1,236,477.00	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	6,540	126.78	829,141.20	
	EOG RESOURCES INC	22,952	110.67	2,540,097.84	
	EQT CORP	12,660	38.45	486,777.00	
	EXXON MOBIL CORP	161,351	105.16	16,967,671.16	
	HALLIBURTON CO	37,607	32.05	1,205,304.35	
	HESS CORP	10,130	134.03	1,357,723.90	
	HF SINCLAIR CORP	5,940	44.60	264,924.00	
	KINDER MORGAN INC	81,490	16.90	1,377,181.00	
	MARATHON OIL CORP	28,380	22.81	647,347.80	
	MARATHON PETROLEUM CORP	18,692	111.64	2,086,774.88	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	28,771	58.47	1,682,240.37	
	ONEOK INC	16,840	60.43	1,017,641.20	
	OVINTIV INC	9,400	36.88	346,672.00	
PHILLIPS 66	18,855	95.70	1,804,423.50		
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,130	201.28	1,837,686.40		
SCHLUMBERGER LTD	56,141	47.27	2,653,785.07		
TARGA RESOURCES CORP	8,180	70.97	580,534.60		

TEXAS PACIFIC LAND CORP	245	1,330.37	325,940.65
VALERO ENERGY CORP	15,292	111.83	1,710,104.36
WILLIAMS COS INC	46,304	30.20	1,398,380.80
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,505	288.84	2,456,584.20
ALBEMARLE CORP	4,750	226.80	1,077,300.00
ALCOA CORP	6,700	36.13	242,071.00
AMCOR PLC	65,600	10.16	666,496.00
AVERY DENNISON CORP	3,040	167.09	507,953.60
BALL CORP	12,500	54.46	680,750.00
CELANESE CORP	4,090	116.35	475,871.50
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,820	67.80	530,196.00
CLEVELAND-CLIFFS INC	21,150	16.72	353,628.00
CORTEVA INC	28,172	57.03	1,606,649.16
CROWN HOLDINGS INC	4,565	85.32	389,485.80
DOW INC	28,025	52.81	1,480,000.25
DUPONT DE NEMOURS INC	19,162	69.94	1,340,190.28
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,815	81.97	394,685.55
ECOLAB INC	10,200	179.81	1,834,062.00
FMC CORP	4,840	104.54	505,973.60
FREEPORT-MCMORAN INC	56,338	40.06	2,256,900.28
INTERNATIONAL PAPER CO	13,670	31.80	434,706.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,675	78.30	835,852.50
LINDE PLC	19,320	374.31	7,231,669.20
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,570	90.33	954,788.10
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,360	425.81	1,004,911.60
MOSAIC CO/THE	13,580	34.99	475,164.20
NEWMONT CORP	30,452	42.10	1,282,029.20
NUCOR CORP	10,499	150.64	1,581,569.36
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	131.36	470,268.80
PPG INDUSTRIES INC	9,394	140.70	1,321,735.80
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	2,210	254.85	563,218.50
RPM INTERNATIONAL INC	4,960	83.82	415,747.20
SEALED AIR CORP	5,746	39.13	224,840.98
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,216	245.85	2,265,753.60
STEEL DYNAMICS INC	7,140	104.69	747,486.60

VULCAN MATERIALS CO	5,563	207.39	1,153,710.57
WESTLAKE CORP	1,360	113.69	154,618.40
WESTROCK CO	9,989	29.23	291,978.47
3M CO	20,696	101.95	2,109,957.20
AECOM	4,930	86.20	424,966.00
AERCAP HOLDINGS NV	6,970	60.66	422,800.20
ALLEGION PLC	3,340	116.77	390,011.80
AMETEK INC	9,033	153.60	1,387,468.80
AXON ENTERPRISE INC	2,540	197.81	502,437.40
BOEING CO/THE	22,342	216.90	4,845,979.80
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	5,240	121.00	634,040.00
CARLISLE COS INC	2,250	236.10	531,225.00
CARRIER GLOBAL CORP	32,338	46.16	1,492,722.08
CATERPILLAR INC	20,376	243.32	4,957,888.32
CUMMINS INC	5,535	234.31	1,296,905.85
DEERE & CO	11,190	399.05	4,465,369.50
DOVER CORP	5,350	145.18	776,713.00
EATON CORP PLC	15,486	193.07	2,989,882.02
EMERSON ELECTRIC CO	22,490	85.84	1,930,541.60
FASTENAL CO	22,796	55.44	1,263,810.24
FERGUSON PLC	8,440	150.03	1,266,253.20
FORTIVE CORP	13,454	69.50	935,053.00
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	5,050	66.03	333,451.50
GENERAC HOLDINGS INC	2,440	119.55	291,702.00
GENERAL DYNAMICS CORP	9,397	212.14	1,993,479.58
GENERAL ELECTRIC CO	42,787	104.70	4,479,798.90
GRACO INC	6,310	84.14	530,923.40
HEICO CORP	1,800	164.84	296,712.00
HEICO CORP-CLASS A	3,120	131.29	409,624.80
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	26,266	200.52	5,266,858.32
HOWMET AEROSPACE INC	14,463	45.70	660,959.10
HUBBELL INC	1,980	315.45	624,591.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,530	215.32	329,439.60
IDEX CORP	2,880	207.86	598,636.80
ILLINOIS TOOL WORKS	11,995	244.46	2,932,297.70

INGERSOLL-RAND INC	16,398	64.12	1,051,439.76
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,570	49.77	326,988.90
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	27,484	64.50	1,772,718.00
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,750	190.93	1,479,707.50
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,385	306.64	424,696.40
LOCKHEED MARTIN CORP	9,236	452.55	4,179,751.80
MASCO CORP	9,849	55.29	544,551.21
NORDSON CORP	2,345	233.80	548,261.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,879	447.90	2,633,204.10
OTIS WORLDWIDE CORP	17,124	87.51	1,498,521.24
OWENS CORNING	3,550	121.36	430,828.00
PACCAR INC	20,706	78.06	1,616,310.36
PARKER HANNIFIN CORP	5,265	367.55	1,935,150.75
PENTAIR PLC	6,918	60.59	419,161.62
QUANTA SERVICES INC	5,710	185.09	1,056,863.90
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	58,196	96.86	5,636,864.56
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,618	313.12	1,445,988.16
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,420	44.55	286,011.00
SMITH (A.O.) CORP	5,020	69.63	349,542.60
SNAP-ON INC	1,975	271.78	536,765.50
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,806	89.09	517,256.54
TEXTRON INC	7,956	65.29	519,447.24
TORO CO	3,890	96.74	376,318.60
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,066	181.38	1,644,391.08
TRANSDIGM GROUP INC	2,020	810.86	1,637,937.20
UNITED RENTALS INC	2,805	405.98	1,138,773.90
WABTEC CORP	6,470	101.66	657,740.20
WATSCO INC	1,240	361.50	448,260.00
WW GRAINGER INC	1,847	727.07	1,342,898.29
XYLEM INC	11,118	111.78	1,242,770.04
AUTOMATIC DATA PROCESSING	16,226	216.09	3,506,276.34
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,070	105.75	536,152.50
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,400	157.43	692,692.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,280	66.06	348,796.80
CINTAS CORP	3,592	486.09	1,746,035.28

CLARIVATE PLC	18,400	8.90	163,760.00
COPART INC	16,860	86.34	1,455,692.40
COSTAR GROUP INC	16,800	82.80	1,391,040.00
EQUIFAX INC	4,764	229.71	1,094,338.44
JACOBS SOLUTIONS INC	4,880	115.29	562,615.20
LEIDOS HOLDINGS INC	4,960	83.03	411,828.80
PAYCHEX INC	13,072	111.54	1,458,050.88
PAYCOM SOFTWARE INC	1,945	319.91	622,224.95
PAYLOCITY HOLDING CORP	1,730	187.12	323,717.60
REPUBLIC SERVICES INC	8,920	143.56	1,280,555.20
ROBERT HALF INTL INC	4,415	71.37	315,098.55
ROLLINS INC	8,265	40.89	337,955.85
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	59.10	500,577.00
TRANSUNION	7,270	75.51	548,957.70
VERISK ANALYTICS INC	6,310	220.28	1,389,966.80
WASTE CONNECTIONS INC	10,606	136.83	1,451,218.98
WASTE MANAGEMENT INC	16,034	162.42	2,604,242.28
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,930	94.61	466,427.30
CSX CORP	81,089	33.09	2,683,235.01
DELTA AIR LINES INC	4,715	42.19	198,925.85
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,467	117.64	760,777.88
FEDEX CORP	9,448	229.67	2,169,922.16
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	90,000	3.40	306,000.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,140	174.39	547,584.60
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,140	56.00	343,840.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,305	221.40	2,060,127.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,655	320.72	1,172,231.60
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	33.57	183,627.90
U-HAUL HOLDING CO	3,375	48.73	164,463.75
UBER TECHNOLOGIES INC	71,590	41.27	2,954,519.30
UNION PACIFIC CORP	24,011	202.74	4,867,990.14
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	28,507	174.88	4,985,304.16
APTIV PLC	11,080	101.01	1,119,190.80
BORGWARNER INC	9,120	47.80	435,936.00
FORD MOTOR COMPANY	159,205	14.20	2,260,711.00

GENERAL MOTORS CORP	52,765	37.36	1,971,300.40	
LEAR CORP	2,290	144.66	331,271.40	
LUCID GROUP INC	31,730	6.40	203,072.00	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	23,890	14.74	352,138.60	
TESLA INC	113,115	256.79	29,046,800.85	
DECKERS OUTDOOR CORP	990	506.73	501,662.70	
DR HORTON INC	12,896	113.60	1,464,985.60	
GARMIN LTD	5,865	106.55	624,915.75	
HASBRO INC	5,188	61.91	321,189.08	
LENNAR CORP-CL A	10,040	114.75	1,152,090.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	4,710	377.21	1,776,659.10	
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,878	98.94	185,809.32	
NIKE INC -CL B	49,738	112.86	5,613,430.68	
NVR INC	118	5,886.57	694,615.26	
PULTE GROUP INC	8,850	73.25	648,262.50	
VF CORP	12,170	19.27	234,515.90	
WHIRLPOOL CORP	2,079	145.96	303,450.84	
AIRBNB INC-CLASS A	16,340	125.14	2,044,787.60	
ARAMARK	8,880	40.16	356,620.80	
BOOKING HOLDINGS INC	1,533	2,609.79	4,000,808.07	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,970	49.19	392,044.30	
CARNIVAL CORP	38,787	15.60	605,077.20	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,065	2,061.17	2,195,146.05	
DARDEN RESTAURANTS INC	4,853	167.64	813,556.92	
DOMINO'S PIZZA INC	1,375	305.72	420,365.00	
DOORDASH INC - A	9,130	71.50	652,795.00	
EXPEDIA GROUP INC	6,032	108.93	657,065.76	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,650	143.55	1,528,807.50	
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,680	116.89	196,375.20	
LAS VEGAS SANDS CORP	14,390	59.83	860,953.70	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,673	181.46	1,936,722.58	
MCDONALD'S CORP	28,861	288.44	8,324,666.84	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	12,900	43.84	565,536.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,748	94.72	828,610.56	
STARBUCKS CORP	45,294	100.66	4,559,294.04	

VAIL RESORTS INC	1,520	249.62	379,422.40
WYNN RESORTS LTD	4,180	103.50	432,630.00
YUM! BRANDS INC	11,394	136.35	1,553,571.90
ACTIVISION BLIZZARD INC	31,330	81.23	2,544,935.90
ALPHABET INC-CL A	236,150	123.67	29,204,670.50
ALPHABET INC-CL C	213,290	124.38	26,529,010.20
CHARTER COMMUNICATION-A	4,476	335.25	1,500,579.00
COMCAST CORP-CLASS A	168,724	40.84	6,890,688.16
ELECTRONIC ARTS INC	10,834	127.90	1,385,668.60
FOX CORP - CLASS A	13,084	33.29	435,566.36
FOX CORP- CLASS B	5,466	31.19	170,484.54
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,096	40.14	605,953.44
LIBERTY BROADBAND-C	4,850	75.20	364,720.00
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	5,726	30.46	174,413.96
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	7,780	78.26	608,862.80
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,420	87.08	559,053.60
MATCH GROUP INC	10,912	44.11	481,328.32
META PLATFORMS INC-CLASS A	87,980	273.35	24,049,333.00
NETFLIX INC	17,575	440.86	7,748,114.50
NEWS CORP - CLASS A	14,750	19.26	284,085.00
OMNICOM GROUP	6,937	94.62	656,378.94
PARAMOUNT GLOBAL	22,823	16.60	378,861.80
PINTEREST INC- CLASS A	22,100	24.42	539,682.00
ROBLOX CORP -CLASS A	14,450	39.91	576,699.50
ROKU INC	4,700	73.37	344,839.00
SEA LTD-ADR	14,470	63.64	920,870.80
SIRIUS XM HOLDINGS INC	30,280	3.77	114,155.60
SNAP INC - A	45,300	10.25	464,325.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	7,240	136.63	989,201.20
THE WALT DISNEY CO.	71,822	92.45	6,639,943.90
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	17,500	76.81	1,344,175.00
WARNER BROS DISCOVERY INC	94,890	13.67	1,297,146.30
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	9,840	27.65	272,076.00
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,328	70.20	163,425.60
AMAZON.COM INC	365,970	126.42	46,265,927.40

AUTOZONE INC	747	2,399.42	1,792,366.74
BATH & BODY WORKS INC	9,270	39.70	368,019.00
BEST BUY CO INC	7,814	76.64	598,864.96
BURLINGTON STORES INC	2,585	148.41	383,639.85
CARMAX INC	5,949	79.70	474,135.30
CHEWY INC - CLASS A	3,410	39.71	135,411.10
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,270	135.00	306,450.00
EBAY INC	21,897	45.07	986,897.79
ETSY INC	4,800	95.06	456,288.00
GENUINE PARTS CO	5,751	158.72	912,798.72
HOME DEPOT INC	40,055	299.71	12,004,884.05
LKQ CORP	10,260	54.47	558,862.20
LOWE'S COS INC	23,892	214.86	5,133,435.12
MERCADOLIBRE INC	1,790	1,211.84	2,169,193.60
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,450	909.64	2,228,618.00
POOL CORP	1,540	345.40	531,916.00
ROSS STORES INC	12,642	106.24	1,343,086.08
TJX COMPANIES INC	45,426	79.90	3,629,537.40
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,530	218.04	987,721.20
ULTA BEAUTY INC	2,100	443.58	931,518.00
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	10,260	20.94	214,844.40
COSTCO WHOLESALE CORP	17,449	527.20	9,199,112.80
DOLLAR GENERAL CORP	8,725	162.12	1,414,497.00
DOLLAR TREE INC	8,986	137.79	1,238,180.94
KROGER CO	26,880	47.21	1,269,004.80
SYSCO CORP	19,996	72.83	1,456,308.68
TARGET CORP	17,980	133.23	2,395,475.40
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	30,782	31.51	969,940.82
WALMART INC	58,422	156.87	9,164,659.14
ALTRIA GROUP INC	70,068	43.95	3,079,488.60
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,143	73.15	1,619,760.45
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,770	64.96	829,539.20
BUNGE LTD	5,847	95.32	557,336.04
CAMPBELL SOUP CO	7,885	45.91	362,000.35
COCA-COLA CO/THE	162,012	60.86	9,860,050.32

COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	7,710	65.46	504,696.60
CONAGRA BRANDS INC	20,640	34.95	721,368.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,270	247.01	1,548,752.70
DARLING INGREDIENTS INC	5,880	64.59	379,789.20
GENERAL MILLS INC	23,059	80.65	1,859,708.35
HERSHEY CO/THE	5,765	260.59	1,502,301.35
HORMEL FOODS CORP	11,500	41.25	474,375.00
JM SMUCKER CO/THE	4,100	152.46	625,086.00
KELLOGG CO	9,818	66.14	649,362.52
KEURIG DR PEPPER INC	35,300	31.76	1,121,128.00
KRAFT HEINZ CO/THE	29,531	36.67	1,082,901.77
LAMB WESTON HOLDING INC	6,150	115.00	707,250.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,420	90.98	948,011.60
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,570	67.45	510,596.50
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	53,465	73.13	3,909,895.45
MONSTER BEVERAGE CORP	31,280	58.48	1,829,254.40
PEPSICO INC	54,331	183.17	9,951,809.27
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	61,218	93.06	5,696,947.08
TYSON FOODS INC-CL A	10,906	49.76	542,682.56
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,310	95.37	983,264.70
CLOROX COMPANY	5,266	153.94	810,648.04
COLGATE-PALMOLIVE CO	30,440	75.42	2,295,784.80
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,200	192.16	1,767,872.00
KIMBERLY-CLARK CORP	13,663	135.12	1,846,144.56
PROCTER & GAMBLE CO	93,339	146.42	13,666,696.38
ABBOTT LABORATORIES	68,666	103.25	7,089,764.50
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,060	322.46	986,727.60
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,014	179.05	1,255,856.70
BAXTER INTERNATIONAL INC	19,439	43.45	844,624.55
BECTON DICKINSON AND CO	11,227	253.33	2,844,135.91
BOSTON SCIENTIFIC CORP	57,338	53.31	3,056,688.78
CARDINAL HEALTH INC	10,305	86.97	896,225.85
CENTENE CORP	22,367	64.65	1,446,026.55
CIGNA GROUP/THE	11,910	263.77	3,141,500.70
COOPER COS INC/THE	2,025	362.74	734,548.50

CVS HEALTH CORP	51,398	66.65	3,425,676.70
DAVITA INC	2,108	97.48	205,487.84
DENTSPLY SIRONA INC	8,222	38.06	312,929.32
DEXCOM INC	15,500	127.06	1,969,430.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	24,120	90.53	2,183,583.60
ELEVANCE HEALTH INC	9,321	436.33	4,067,031.93
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	14,275	78.53	1,121,015.75
HCA HEALTHCARE INC	8,390	284.20	2,384,438.00
HENRY SCHEIN INC	5,280	74.81	394,996.80
HOLOGIC INC	9,858	78.22	771,092.76
HUMANA INC	5,030	455.00	2,288,650.00
IDEXX LABORATORIES INC	3,360	466.97	1,569,019.20
INSULET CORP	2,745	283.59	778,454.55
INTUITIVE SURGICAL INC	13,835	323.07	4,469,673.45
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,415	226.98	775,136.70
MASIMO CORP	2,020	161.35	325,927.00
MCKESSON CORP	5,609	391.25	2,194,521.25
MEDTRONIC PLC	52,338	87.91	4,601,033.58
MOLINA HEALTHCARE INC	2,035	275.49	560,622.15
NOVOCURE LTD	4,700	45.00	211,500.00
QUEST DIAGNOSTICS	4,386	136.25	597,592.50
RESMED INC	5,830	216.64	1,263,011.20
STERIS PLC	4,240	213.12	903,628.80
STRYKER CORP	13,588	293.57	3,989,029.16
TELEFLEX INC	1,820	244.53	445,044.60
UNITEDHEALTH GROUP INC	36,875	459.86	16,957,337.50
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,920	146.19	280,684.80
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	5,790	194.39	1,125,518.10
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,412	142.01	1,194,588.12
ABBVIE INC	70,046	136.23	9,542,366.58
AGILENT TECHNOLOGIES INC	10,800	119.40	1,289,520.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,040	198.49	1,000,389.60
AMGEN INC	21,001	222.28	4,668,102.28
AVANTOR INC	27,110	19.56	530,271.60
BIO-RAD LABORATORIES-A	860	370.87	318,948.20

BIO-TECHNE CORP	5,920	74.87	443,230.40
BIOGEN INC	5,543	299.99	1,662,844.57
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,140	94.41	674,087.40
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	83,095	64.16	5,331,375.20
CATALENT INC	6,520	42.09	274,426.80
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,910	207.42	396,172.20
DANAHER CORP	27,529	238.45	6,564,290.05
ELI LILLY & CO	31,934	447.72	14,297,490.48
EXACT SCIENCES CORP	8,190	93.06	762,161.40
GILEAD SCIENCES INC	49,654	77.95	3,870,529.30
HORIZON THERAPEUTICS PLC	8,450	100.62	850,239.00
ILLUMINA INC	6,275	204.84	1,285,371.00
INCYTE CORP	7,670	61.44	471,244.80
IQVIA HOLDINGS INC	7,438	212.72	1,582,211.36
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,450	126.55	310,047.50
JOHNSON & JOHNSON	102,831	161.56	16,613,376.36
MERCK & CO. INC.	100,353	108.66	10,904,356.98
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	890	1,315.57	1,170,857.30
MODERNA INC	12,875	126.05	1,622,893.75
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,630	94.22	342,018.60
PFIZER INC	221,620	39.36	8,722,963.20
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,285	771.11	3,304,206.35
REPLIGEN CORP	2,250	161.43	363,217.50
REVVITY INC	4,910	115.40	566,614.00
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	14,330	32.15	460,709.50
SEAGEN INC	5,620	196.21	1,102,700.20
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43,590	7.46	325,181.40
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	15,349	520.12	7,983,321.88
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,900	226.28	429,932.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10,270	340.96	3,501,659.20
VIATRIS INC	45,819	9.76	447,193.44
WATERS CORP	2,331	262.08	610,908.48
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,960	354.69	1,049,882.40
ZOETIS INC	18,225	165.65	3,018,971.25
BANK OF AMERICA CORP	284,539	29.12	8,285,775.68

CITIGROUP INC	75,757	48.24	3,654,517.68	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,310	27.10	523,301.00	
FIFTH THIRD BANCORP	26,459	25.95	686,611.05	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	450	1,280.70	576,315.00	
FIRST HORIZON CORP	19,800	11.45	226,710.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,720	10.83	581,787.60	
JPMORGAN CHASE & CO	115,760	141.49	16,378,882.40	
KEYCORP	36,108	9.91	357,830.28	
M & T BANK CORP	6,913	121.90	842,694.70	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	16,200	126.52	2,049,624.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	41,944	18.01	755,411.44	
TRUIST FINANCIAL CORP	55,170	31.72	1,749,992.40	
US BANCORP	55,931	32.10	1,795,385.10	
WEBSTER FINANCIAL CORP	6,370	38.86	247,538.20	
WELLS FARGO & CO	148,980	42.08	6,269,078.40	
ALLY FINANCIAL INC	12,240	28.37	347,248.80	
AMERICAN EXPRESS CO	24,784	174.47	4,324,064.48	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,225	318.93	1,347,479.25	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,800	76.15	1,203,170.00	
ARES MANAGEMENT CORP-A	7,150	94.17	673,315.50	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	30,612	44.17	1,352,132.04	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	51,375	335.90	17,256,862.50	
BLACKROCK INC	5,905	692.45	4,088,917.25	
BLACKSTONE INC	27,850	90.29	2,514,576.50	
BLOCK INC	21,450	63.69	1,366,150.50	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15,435	112.33	1,733,813.55	
CARLYLE GROUP INC/THE	7,650	30.63	234,319.50	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,940	138.81	546,911.40	
CME GROUP INC	14,250	181.51	2,586,517.50	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	7,550	53.90	406,945.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,750	117.14	1,259,255.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,420	26.77	386,023.40	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,590	410.99	653,474.10	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	25,298	54.70	1,383,800.60	
FISERV INC	24,864	120.00	2,983,680.00	

FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,880	239.79	690,595.20
FRANKLIN RESOURCES INC	11,755	26.92	316,444.60
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	41.92	104,800.00
GLOBAL PAYMENTS INC	10,989	101.16	1,111,647.24
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,223	338.42	4,474,927.66
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	21,690	110.67	2,400,432.30
INVESCO LTD	13,527	16.56	224,007.12
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,200	160.89	514,848.00
KKR & CO INC -A	25,820	57.03	1,472,514.60
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,185	205.61	654,867.85
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,420	276.15	392,133.00
MASTERCARD INC - A	33,620	374.76	12,599,431.20
MOODY'S CORP	6,502	340.71	2,215,296.42
MORGAN STANLEY	49,483	87.98	4,353,514.34
MSCI INC	3,175	486.20	1,543,685.00
NASDAQ INC	11,725	51.16	599,851.00
NORTHERN TRUST CORP	7,690	74.25	570,982.50
PAYPAL HOLDINGS INC	43,017	63.60	2,735,881.20
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,720	98.26	758,567.20
S&P GLOBAL INC	13,045	393.09	5,127,859.05
SCHWAB (CHARLES) CORP	59,913	54.35	3,256,271.55
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,385	58.70	198,699.50
STATE STREET CORP	12,947	73.20	947,720.40
SYNCHRONY FINANCIAL	19,010	33.54	637,595.40
T ROWE PRICE GROUP INC	8,675	111.14	964,139.50
TOAST INC-CLASS A	10,580	23.28	246,302.40
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,200	71.60	300,720.00
VISA INC-CLASS A SHARES	64,242	223.44	14,354,232.48
AFLAC INC	23,424	68.76	1,610,634.24
ALLSTATE CORP	10,513	111.40	1,171,148.20
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,660	114.40	304,304.00
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	30,345	55.84	1,694,464.80
AON PLC	8,077	322.97	2,608,628.69
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,535	70.08	1,018,612.80
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,980	209.79	1,883,914.20

ASSURANT INC	1,960	129.11	253,055.60
BROWN & BROWN INC	9,090	64.60	587,214.00
CHUBB LTD	16,225	188.84	3,063,929.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,880	99.97	587,823.60
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	940	217.13	204,102.20
EVEREST RE GROUP LTD	1,469	341.11	501,090.59
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	11,071	34.65	383,610.15
GLOBE LIFE INC	3,586	107.00	383,702.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,382	70.64	874,664.48
LOEWS CORP	7,145	58.12	415,267.40
MARKEL GROUP INC	595	1,330.70	791,766.50
MARSH & MCLENNAN COS	19,653	178.10	3,500,199.30
METLIFE INC	26,335	53.94	1,420,509.90
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,520	72.35	688,772.00
PROGRESSIVE CORP	22,800	126.93	2,894,004.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,962	85.54	1,279,849.48
TRAVELERS COS INC/THE	8,889	173.55	1,542,685.95
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,198	228.40	958,823.20
WR BERKLEY CORP	8,091	56.54	457,465.14
ACCENTURE PLC-CL A	25,093	315.05	7,905,549.65
ADOBE INC	18,229	479.53	8,741,352.37
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,030	91.99	554,699.70
ANSYS INC	3,515	334.31	1,175,099.65
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,300	164.55	213,915.00
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	6,020	181.23	1,091,004.60
AUTODESK INC	8,720	213.55	1,862,156.00
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,530	53.42	402,252.60
BILL HOLDINGS INC	3,630	114.24	414,691.20
BLACK KNIGHT INC	5,860	57.00	334,020.00
CADENCE DESIGN SYS INC	10,570	236.06	2,495,154.20
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,840	128.87	494,860.80
CLOUDFLARE INC-CLASS A	9,750	68.87	671,482.50
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	20,318	63.71	1,294,459.78
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	8,250	153.96	1,270,170.00
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,650	151.90	250,635.00

DATADOG INC-CLASS A	9,910	96.28	954,134.80
DOCUSIGN INC	8,320	54.10	450,112.00
DROPBOX INC-CLASS A	11,660	25.10	292,666.00
DYNATRACE INC	9,850	51.82	510,427.00
EPAM SYSTEMS INC	2,280	222.53	507,368.40
FAIR ISAAC CORP	970	795.25	771,392.50
FORTINET INC	26,965	71.48	1,927,458.20
GARTNER INC	3,050	352.37	1,074,728.50
GEN DIGITAL INC	24,365	18.35	447,097.75
GODADDY INC-CLASS A	6,020	74.43	448,068.60
HUBSPOT INC	1,885	503.94	949,926.90
INTL BUSINESS MACHINES CORP	35,662	137.20	4,892,826.40
INTUIT INC	11,166	446.22	4,982,492.52
MICROSOFT CORP	280,254	337.34	94,540,884.36
MONGODB INC	2,490	374.59	932,729.10
OKTA INC	5,670	74.42	421,961.40
ORACLE CORP	63,723	122.27	7,791,411.21
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	68,020	15.91	1,082,198.20
PALO ALTO NETWORKS INC	12,085	238.56	2,882,997.60
PTC INC	4,160	141.38	588,140.80
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,200	456.44	1,917,048.00
SALESFORCE INC	39,716	209.40	8,316,530.40
SERVICENOW INC	8,110	567.31	4,600,884.10
SNOWFLAKE INC-CLASS A	10,100	181.07	1,828,807.00
SPLUNK INC	6,120	104.16	637,459.20
SYNOPSIS INC	6,082	446.05	2,712,876.10
TWILIO INC - A	7,225	66.29	478,945.25
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,910	392.10	748,911.00
UIPATH INC - CLASS A	12,800	17.99	230,272.00
UNITY SOFTWARE INC	9,650	41.04	396,036.00
VERISIGN INC	3,690	220.79	814,715.10
VMWARE INC-CLASS A	9,517	140.83	1,340,279.11
WIX.COM LTD	2,280	85.28	194,438.40
WORKDAY INC-CLASS A	7,990	217.31	1,736,306.90
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	8,530	68.40	583,452.00

ZSCALER INC	3,630	157.55	571,906.50
AMPHENOL CORP-CL A	23,350	80.77	1,885,979.50
APPLE INC	626,784	183.95	115,296,916.80
ARISTA NETWORKS INC	10,680	169.08	1,805,774.40
ARROW ELECTRONICS INC	2,520	137.93	347,583.60
CDW CORP/DE	5,195	176.58	917,333.10
CISCO SYSTEMS INC	161,890	50.96	8,249,914.40
COGNEX CORP	6,480	55.90	362,232.00
CORNING INC	33,518	33.24	1,114,138.32
DELL TECHNOLOGIES -C	11,022	49.38	544,266.36
F5 INC	2,385	149.72	357,082.20
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	50,105	16.81	842,265.05
HP INC	40,475	30.95	1,252,701.25
JUNIPER NETWORKS INC	11,943	31.68	378,354.24
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,160	164.18	1,175,528.80
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,610	278.31	1,839,629.10
NETAPP INC	8,246	73.30	604,431.80
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,794	65.29	508,870.26
TE CONNECTIVITY LTD	12,995	131.73	1,711,831.35
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,020	398.72	805,414.40
TRIMBLE INC	9,520	51.92	494,278.40
WESTERN DIGITAL CORP	14,698	40.46	594,681.08
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,075	280.38	581,788.50
AT&T INC	281,237	15.84	4,454,794.08
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,435	17.22	93,590.70
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	12,791	18.23	233,179.93
T-MOBILE US INC	24,259	128.05	3,106,364.95
VERIZON COMMUNICATIONS INC	165,407	35.73	5,909,992.11
AES CORP	27,958	20.74	579,848.92
ALLIANT ENERGY CORP	9,590	53.13	509,516.70
AMEREN CORPORATION	10,152	82.84	840,991.68
AMERICAN ELECTRIC POWER	20,348	83.61	1,701,296.28
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,705	146.11	1,125,777.55
ATMOS ENERGY CORP	5,310	117.07	621,641.70
CENTERPOINT ENERGY INC	23,972	29.03	695,907.16

CMS ENERGY CORP	11,090	60.42	670,057.80
CONSOLIDATED EDISON INC	14,236	92.39	1,315,264.04
CONSTELLATION ENERGY	13,168	93.20	1,227,257.60
DOMINION ENERGY INC	33,331	52.56	1,751,877.36
DTE ENERGY COMPANY	8,318	112.95	939,518.10
DUKE ENERGY CORP	29,986	90.85	2,724,228.10
EDISON INTERNATIONAL	14,439	68.17	984,306.63
ENERGY CORP	7,967	101.30	807,057.10
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,210	41.21	461,964.10
EVERGY INC	8,720	58.92	513,782.40
EVERSOURCE ENERGY	14,310	69.90	1,000,269.00
EXELON CORP	37,926	40.12	1,521,591.12
FIRSTENERGY CORP	23,295	38.82	904,311.90
NEXTERA ENERGY INC	80,200	73.40	5,886,680.00
NISOURCE INC	15,610	27.16	423,967.60
NRG ENERGY INC	8,760	34.34	300,818.40
P G & E CORP	69,370	17.24	1,195,938.80
PPL CORP	30,338	26.86	814,878.68
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	19,888	61.93	1,231,663.84
SEMPRA ENERGY	12,432	147.29	1,831,109.28
SOUTHERN CO	42,555	70.48	2,999,276.40
UGI CORP	8,500	27.70	235,450.00
VISTRA CORP	14,720	24.81	365,203.20
WEC ENERGY GROUP INC	12,220	90.53	1,106,276.60
XCEL ENERGY INC	22,174	62.49	1,385,653.26
ADVANCED MICRO DEVICES	63,934	127.33	8,140,716.22
ANALOG DEVICES INC	20,157	191.89	3,867,926.73
APPLIED MATERIALS INC	33,683	141.17	4,755,029.11
BROADCOM INC	16,470	886.18	14,595,384.60
ENPHASE ENERGY INC	5,440	179.20	974,848.00
ENTEGRIS INC	5,660	113.23	640,881.80
FIRST SOLAR INC	3,910	193.03	754,747.30
INTEL CORP	163,292	35.58	5,809,929.36
KLA CORP	5,319	480.54	2,555,992.26
LAM RESEARCH CORP	5,327	630.03	3,356,169.81

	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	5,150	92.07	474,160.50	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	33,394	62.96	2,102,486.24	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,028	86.64	1,908,505.92	
	MICRON TECHNOLOGY INC	42,997	69.12	2,971,952.64	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,820	537.21	977,722.20	
	NVIDIA CORP	97,920	429.97	42,102,662.40	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	10,447	195.69	2,044,373.43	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	17,340	92.74	1,608,111.60	
	QORVO INC	4,240	103.60	439,264.00	
	QUALCOMM INC	43,782	123.40	5,402,698.80	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,440	109.89	707,691.60	
	SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	2,310	271.44	627,026.40	
	TERADYNE INC	6,190	110.36	683,128.40	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	35,812	177.12	6,343,021.44	
	WOLFSPEED INC	5,080	56.49	286,969.20	
	CBRE GROUP INC - A	12,560	78.39	984,578.40	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,500	4.10	166,050.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	6,370	46.12	293,784.40	
米ドル小計		13,470,628		1,500,389,298.88	(210,639,653,669)
加ドル	ARC RESOURCES LTD	25,510	16.94	432,139.40	
	CAMECO CORP	16,352	41.63	680,733.76	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	44,054	73.93	3,256,912.22	
	CENOVUS ENERGY INC	57,213	22.16	1,267,840.08	
	ENBRIDGE INC	79,137	49.16	3,890,374.92	
	IMPERIAL OIL LTD	8,922	66.19	590,547.18	
	KEYERA CORP	8,460	30.52	258,199.20	
	PARKLAND CORP	6,170	33.81	208,607.70	
	PEMBINA PIPELINE CORP	23,552	41.14	968,929.28	
	SUNCOR ENERGY INC	53,489	39.73	2,125,117.97	
	TC ENERGY CORP	41,663	54.44	2,268,133.72	
	TOURMALINE OIL CORP	12,040	59.57	717,222.80	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	19,076	66.87	1,275,612.12	
	BARRICK GOLD CORP	69,624	22.37	1,557,488.88	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	62.76	360,870.00	

FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	30.96	701,244.00
FRANCO-NEVADA CORP	8,125	192.95	1,567,718.75
IVANHOE MINES LTD-CL A	24,510	11.86	290,688.60
KINROSS GOLD CORP	46,025	6.48	298,242.00
LUNDIN MINING CORP	25,010	10.73	268,357.30
NUTRIEN LTD	20,908	78.04	1,631,660.32
PAN AMERICAN SILVER CORP	12,860	20.09	258,357.40
TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,975	57.78	1,038,595.50
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,450	106.19	260,165.50
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,165	59.43	1,138,975.95
CAE INC	12,305	27.72	341,094.60
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,260	107.76	351,297.60
WSP GLOBAL INC	4,590	175.78	806,830.20
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,410	50.01	370,574.10
RB GLOBAL INC	6,440	75.88	488,667.20
THOMSON REUTERS CORP	6,546	169.02	1,106,404.92
AIR CANADA	7,190	23.54	169,252.60
CANADIAN NATL RAILWAY CO	22,438	155.49	3,488,884.62
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	37,141	103.61	3,848,179.01
TFI INTERNATIONAL INC	3,210	141.37	453,797.70
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,668	74.97	799,779.96
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,570	107.50	168,775.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,040	40.23	283,219.20
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,998	101.68	1,118,276.64
QUEBECOR INC -CL B	6,110	33.25	203,157.50
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,250	171.24	385,290.00
DOLLARAMA INC	10,360	85.87	889,613.20
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	32,470	65.04	2,111,848.80
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	34.69	241,095.50
LOBLAW COMPANIES LTD	6,339	117.02	741,789.78
METRO INC	9,570	71.10	680,427.00
WESTON (GEORGE) LTD	2,808	153.25	430,326.00
SAPUTO INC	9,620	31.27	300,817.40
BANK OF MONTREAL	26,881	118.27	3,179,215.87
BANK OF NOVA SCOTIA	47,539	66.31	3,152,311.09

CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	37,740	57.64	2,175,333.60
NATIONAL BANK OF CANADA	13,750	98.80	1,358,500.00
ROYAL BANK OF CANADA	54,429	125.18	6,813,422.22
TORONTO-DOMINION BANK	71,320	79.92	5,699,894.40
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	13,859	44.70	619,497.30
BROOKFIELD CORP	57,209	44.10	2,522,916.90
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	13,800	20.34	280,692.00
IGM FINANCIAL INC	3,335	41.01	136,768.35
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,250	39.65	89,212.50
ONEX CORPORATION	2,765	70.15	193,964.75
TMX GROUP LTD	2,170	29.85	64,774.50
TMX GROUP LTD(N)	8,680	29.85	259,098.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	980.81	882,729.00
GREAT-WEST LIFECO INC	11,324	38.47	435,634.28
IA FINANCIAL CORP INC	4,075	91.12	371,314.00
INTACT FINANCIAL CORP	7,215	197.87	1,427,632.05
MANULIFE FINANCIAL CORP	71,921	25.67	1,846,212.07
POWER CORP OF CANADA	20,479	35.08	718,403.32
SUN LIFE FINANCIAL INC	24,774	67.36	1,668,776.64
CGI INC	8,030	139.85	1,122,995.50
CONSTELLATION SOFTWARE INC	810	2,758.40	2,234,304.00
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,740	103.03	385,332.20
OPEN TEXT CORP	11,190	56.00	626,640.00
SHOPIFY INC - CLASS-A	47,780	87.85	4,197,473.00
BCE INC	3,000	60.37	181,110.00
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	13,875	58.41	810,438.75
TELUS CORP	12,662	25.48	322,627.76
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	11.13	301,400.40
ALTAGAS LTD	11,170	24.54	274,111.80
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	44.10	240,124.50
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	34.77	158,551.20
EMERA INC	10,460	54.80	573,208.00
FORTIS INC	19,055	56.49	1,076,416.95
HYDRO ONE LTD	13,230	37.29	493,346.70
NORTHLAND POWER INC	8,600	27.66	237,876.00

	FIRSTSERVICE CORP	1,500	196.40	294,600.00	
加ドル小計		1,596,575		94,518,992.68 (9,952,849,929)	
ユーロ	ENI SPA	96,426	12.98	1,252,188.03	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	18,755	10.74	201,428.70	
	NESTE OYJ	16,380	40.98	671,252.40	
	OMV AG	5,480	39.24	215,035.20	
	REPSOL SA	54,849	13.54	742,929.70	
	TENARIS SA	17,895	12.93	231,382.35	
	TOTALENERGIES SE	93,757	53.91	5,054,439.87	
	AIR LIQUIDE SA	20,869	159.58	3,330,275.02	
	AKZO NOBEL	6,937	72.82	505,152.34	
	ARCELORMITTAL	20,552	26.18	538,154.12	
	ARKEMA	2,215	85.00	188,275.00	
	BASF SE	37,045	46.83	1,735,002.57	
	COVESTRO AG	7,410	40.82	302,476.20	
	CRH PLC	30,060	47.27	1,420,936.20	
	DSM-FIRMENICH AG	7,552	99.00	747,648.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	8,230	18.29	150,526.70	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	5,715	73.54	420,281.10	
	OCI NV	4,810	21.17	101,827.70	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,050	34.30	310,415.00	
	SOLVAY SA	2,811	108.15	304,009.65	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	19,785	12.38	245,037.22	
	SYMRISE AG	5,790	92.72	536,848.80	
	UMICORE	7,960	27.93	222,322.80	
	UPM-KYMMENE OYJ	21,098	29.87	630,197.26	
	VOESTALPINE AG	4,249	33.64	142,936.36	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,876	31.23	245,967.48	
	AIRBUS GROUP SE	23,108	129.52	2,992,948.16	
	ALSTOM	11,635	27.19	316,355.65	
	BOUYGUES SA	8,460	30.12	254,815.20	
	BRENTAG SE	5,605	74.14	415,554.70	
	CNH INDUSTRIAL NV	39,510	13.40	529,631.55	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	19,106	56.74	1,084,074.44	

DAIMLER TRUCK HOLDING AG	18,186	32.46	590,317.56
DASSAULT AVIATION SA	900	169.60	152,640.00
EIFFAGE	3,250	100.25	325,812.50
FERROVIAL SA	17,825	28.84	514,073.00
GEA GROUP AG	6,020	39.70	238,994.00
IMCD NV	2,120	135.35	286,942.00
KINGSPAN GROUP PLC	5,900	63.76	376,184.00
KNORR-BREMSE AG	2,970	66.68	198,039.60
KONE OYJ-B	13,614	49.52	674,165.28
LEGRAND SA	11,128	92.56	1,030,007.68
METSO CORPORATION	24,200	11.11	268,862.00
MTU AERO ENGINES AG	2,020	226.30	457,126.00
PRYSMIAN SPA	9,565	37.45	358,209.25
RATIONAL AG	230	641.50	147,545.00
RHEINMETALL AG	1,730	245.30	424,369.00
SAFRAN SA	13,080	138.44	1,810,795.20
SCHNEIDER ELECTRIC SE	21,608	166.26	3,592,546.08
SIEMENS AG-REG	30,236	164.34	4,968,984.24
SIEMENS ENERGY AG	21,343	23.70	505,829.10
THALES SA	4,015	131.85	529,377.75
VINCI SA	20,600	108.76	2,240,456.00
WARTSILA OYJ ABP	18,180	10.97	199,434.60
BUREAU VERITAS SA	10,920	25.01	273,109.20
RANDSTAD NV	4,675	48.29	225,755.75
TELEPERFORMANCE	2,240	160.20	358,848.00
WOLTERS KLUWER	10,027	113.95	1,142,576.65
ADP	1,090	138.20	150,638.00
AENA SA	2,870	148.30	425,621.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	9.47	226,286.88
DEUTSCHE POST AG-REG	39,823	43.65	1,738,273.95
GETLINK	17,310	15.68	271,507.35
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,355	112.90	1,507,779.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,210	103.30	228,293.00
CONTINENTAL AG	4,385	71.90	315,281.50
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	4,380	117.25	513,555.00

FERRARI NV	5,019	281.30	1,411,844.70
MERCEDES-BENZ GROUP AG	33,372	75.35	2,514,580.20
MICHELIN (CGDE)	23,556	27.97	658,861.32
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	57.94	328,519.80
RENAULT SA	8,247	35.57	293,387.02
STELLANTIS NV	90,796	15.76	1,431,489.73
VALEO SA	7,420	21.14	156,858.80
VOLKSWAGEN AG	1,151	160.70	184,965.70
VOLKSWAGEN AG-PFD	7,433	131.74	979,223.42
ADIDAS AG	6,571	174.70	1,147,953.70
HERMES INTERNATIONAL	1,272	1,973.00	2,509,656.00
KERING	3,007	523.00	1,572,661.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	10,964	850.00	9,319,400.00
MONCLER SPA	8,080	65.68	530,694.40
PUMA SE	4,200	51.70	217,140.00
SEB SA	987	88.40	87,250.80
ACCOR SA	6,056	33.51	202,936.56
AMADEUS IT GROUP SA	18,350	69.64	1,277,894.00
DELIVERY HERO SE	6,600	36.48	240,801.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,816	181.25	1,235,400.00
JUST EAT TAKEAWAY	10,350	13.13	135,936.90
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	36.96	144,144.00
SODEXO	3,240	101.60	329,184.00
BOLLORE SE	33,530	5.61	188,270.95
PUBLICIS GROUPE	9,305	74.54	693,594.70
SCOUT24 SE	2,970	58.30	173,151.00
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	27,730	20.07	556,541.10
VIVENDI SE	26,070	8.24	214,868.94
D'IETEREN GROUP	1,050	173.00	181,650.00
INDITEX	43,905	34.21	1,501,990.05
PROSUS	31,900	67.71	2,159,949.00
ZALANDO SE	8,260	26.42	218,229.20
CARREFOUR SA	22,633	16.49	373,331.33
HELLOFRESH SE	6,070	18.01	109,351.05
JERONIMO MARTINS	10,585	24.74	261,872.90

KESKO OYJ-B SHS	10,930	19.19	209,746.70
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	40,028	29.68	1,188,031.04
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	33,221	52.32	1,738,122.72
DANONE	24,624	53.94	1,328,218.56
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,850	12.85	255,072.50
HEINEKEN HOLDING NV	4,895	79.50	389,152.50
HEINEKEN NV	10,033	93.94	942,500.02
JDE PEET'S NV	4,010	27.44	110,034.40
KERRY GROUP PLC-A	6,460	90.12	582,175.20
PERNOD-RICARD SA	8,296	203.70	1,689,895.20
REMY COINTREAU	810	145.50	117,855.00
BEIERSDORF AG	4,015	119.45	479,591.75
HENKEL AG & CO KGAA	4,520	65.70	296,964.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,793	74.20	504,040.60
L'OREAL	9,586	412.20	3,951,349.20
AMPLIFON SPA	4,830	35.23	170,160.90
BIOMERIEUX	1,690	91.82	155,175.80
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	111.40	179,354.00
DIASORIN ITALIA SPA	930	97.86	91,009.80
ESSILORLUXOTTICA	11,505	167.40	1,925,937.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,613	43.25	329,262.25
FRESENIUS SE & CO KGAA	15,695	25.57	401,321.15
KONINKLIJKE PHILIPS NV	36,772	18.64	685,503.62
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,640	52.74	561,153.60
ARGENX SE	2,235	364.20	813,987.00
BAYER AG-REG	39,064	51.80	2,023,515.20
EUROFINS SCIENTIFIC	5,050	60.22	304,111.00
GRIFOLS SA	12,050	11.81	142,370.75
IPSEN	1,870	110.70	207,009.00
MERCK KGAA	5,150	168.15	865,972.50
ORION OYJ-CLASS B	4,500	39.48	177,660.00
QIAGEN N.V.	10,384	42.34	439,658.56
RECORDATI SPA	3,720	44.98	167,325.60
SANOFI	45,156	93.98	4,243,760.88
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	960	340.20	326,592.00

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	273.30	295,164.00
UCB SA	4,928	83.94	413,656.32
ABN AMRO BANK NV-CVA	15,170	14.04	213,062.65
AIB GROUP PLC	34,900	3.87	135,342.20
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	241,763	6.77	1,638,186.08
BANCO SANTANDER SA	662,389	3.25	2,152,764.25
BANK OF IRELAND GROUP PLC	44,790	9.41	421,473.90
BNP PARIBAS	43,252	57.52	2,487,855.04
CAIXABANK S.A	163,050	3.66	596,926.05
COMMERZBANK AG	40,474	10.18	412,227.69
CREDIT AGRICOLE SA	49,662	10.96	544,295.52
ERSTE GROUP BANK AG	13,018	32.15	418,528.70
FINECOBANK SPA	23,540	12.46	293,426.10
ING GROEP NV-CVA	146,925	12.31	1,808,940.60
INTESA SANPAOLO	658,093	2.35	1,546,518.55
KBC GROEP NV	9,719	63.64	618,517.16
MEDIOBANCA SPA	27,330	11.31	309,102.30
SOCIETE GENERALE	34,309	23.51	806,776.13
UNICREDIT SPA	77,226	19.12	1,476,715.57
ADYEN NV	865	1,625.00	1,405,625.00
AMUNDI SA	2,140	54.70	117,058.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	80,935	9.93	803,684.55
DEUTSCHE BOERSE AG	7,600	167.00	1,269,200.00
EDENRED	9,626	61.64	593,346.64
EURAZEO SE	1,487	66.40	98,736.80
EURONEXT NV	3,470	65.80	228,326.00
EXOR NV	4,164	81.46	339,199.44
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,452	73.38	253,307.76
NEXI SPA	21,240	7.39	157,091.04
SOFINA	655	205.20	134,406.00
WENDEL	1,000	99.70	99,700.00
WORLDLINE SA	8,950	35.70	319,515.00
AEGON NV	69,679	4.55	317,039.45
AGEAS	5,924	38.16	226,059.84
ALLIANZ SE-REG	15,783	209.75	3,310,484.25

ASSICURAZIONI GENERALI	42,248	18.93	799,754.64
AXA SA	75,752	26.65	2,019,169.56
HANNOVER RUECK SE-REG	2,275	191.25	435,093.75
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,626	327.40	1,841,952.40
NN GROUP NV	10,270	33.22	341,169.40
POSTE ITALIANE SPA	19,560	10.09	197,458.20
SAMPO OYJ-A SHS	19,639	42.66	837,799.74
BECHTLE AG	3,070	38.61	118,532.70
CAP GEMINI SA	6,509	177.25	1,153,720.25
DASSAULT SYSTEMES SE	27,400	40.87	1,119,975.00
NEMETSCHKE SE	2,350	72.50	170,375.00
SAP SE	41,532	125.48	5,211,435.36
NOKIA OYJ	213,336	3.89	829,877.04
CELLNEX TELECOM SA	21,660	36.44	789,290.40
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	129,326	19.14	2,475,558.29
ELISA OYJ	6,005	50.60	303,853.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	11.81	179,233.55
KONINKLIJKE KPN NV	122,956	3.08	379,196.30
ORANGE S.A.	85,804	10.30	884,467.63
TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.25	103,212.20
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	46,470	2.56	119,195.55
TELEFONICA SA	195,629	3.63	710,720.15
ACCIONA SA	830	162.10	134,543.00
E.ON SE	90,999	11.27	1,026,013.72
EDP RENOVAVEIS SA	11,156	19.43	216,761.08
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	126,131	4.61	581,842.30
ELIA GROUP SA/NV	1,356	114.80	155,668.80
ENAGAS SA	8,610	18.18	156,529.80
ENDESA SA	12,050	20.92	252,086.00
ENEL SPA	309,737	6.10	1,891,873.59
ENGIE	71,874	14.29	1,027,510.70
FORTUM OYJ	16,755	13.19	220,998.45
IBERDROLA SA	240,172	11.57	2,778,790.04
NATURGY ENERGY GROUP SA	6,252	26.62	166,428.24
RED ELECTRICA CORPORACION SA	15,580	16.34	254,577.20

	RWE AG	25,835	39.95	1,032,108.25	
	SNAM SPA	91,120	5.00	456,328.96	
	TERNA SPA	53,627	8.01	429,552.27	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	25,530	29.15	744,199.50	
	VERBUND AG	2,780	75.15	208,917.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	1,935	411.15	795,575.25	
	ASML HOLDING NV	15,997	681.70	10,905,154.90	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	51,775	38.86	2,011,976.50	
	STMICROELECTRONICS NV	27,283	46.16	1,259,383.28	
	LEG IMMOBILIEN SE	3,010	55.14	165,971.40	
	VONOVIA SE	27,119	18.90	512,684.69	
ユーロ小計		7,192,626		189,514,507.97 (28,834,632,387)	
英ポンド	BP PLC	717,548	4.61	3,308,972.60	
	SHELL PLC-NEW	270,837	23.04	6,241,438.66	
	ANGLO AMERICAN PLC	48,104	25.82	1,242,285.80	
	ANTOFAGASTA PLC	14,330	15.60	223,548.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,131	55.26	338,799.06	
	ENDEAVOUR MINING PLC	6,490	20.52	133,174.80	
	GLENCORE PLC	404,503	4.70	1,902,579.86	
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,339	17.60	129,203.09	
	MONDI PLC	18,370	12.62	231,829.40	
	RIO TINTO PLC	44,725	53.38	2,387,420.50	
	ASHTREAD GROUP PLC	17,770	54.78	973,440.60	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	124,235	9.50	1,180,729.44	
	BUNZL PLC	12,896	31.06	400,549.76	
	DCC PLC	3,820	46.65	178,203.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	321,031	1.50	483,954.23	
	SMITHS GROUP PLC	13,603	17.02	231,523.06	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,890	113.70	328,593.00	
	EXPERIAN PLC	37,408	29.74	1,112,513.92	
	INTERTEK GROUP PLC	6,025	43.94	264,738.50	
	RELX PLC	76,445	25.80	1,972,281.00	
	RENTOKIL INITIAL PLC	95,400	6.42	612,468.00	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	4.51	183,932.24	

BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,515	39.42	177,981.30
BURBERRY GROUP PLC	15,504	22.61	350,545.44
PERSIMMON PLC	12,440	11.68	145,361.40
TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.10	136,933.31
COMPASS GROUP PLC	72,268	21.80	1,575,442.40
ENTAIN PLC	24,860	12.06	299,935.90
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	8,263	55.40	457,770.20
PEARSON PLC	26,089	8.22	214,608.11
WHITBREAD PLC	8,110	34.00	275,740.00
AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	6.40	233,763.84
INFORMA PLC	56,580	7.04	398,549.52
WPP PLC	41,144	8.74	359,927.71
JD SPORTS FASHION PLC	97,350	1.48	144,321.37
KINGFISHER PLC	78,137	2.38	186,122.33
NEXT PLC	5,667	64.52	365,634.84
OCADO GROUP PLC	22,670	4.09	92,742.97
SAINSBURY (J) PLC	70,601	2.72	192,387.72
TESCO PLC	288,058	2.64	760,473.12
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,125	18.79	246,684.37
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	84,527	25.70	2,172,343.90
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	23.38	179,792.20
DIAGEO PLC	89,282	33.75	3,013,713.91
IMPERIAL BRANDS PLC	38,792	17.42	675,950.60
HALEON PLC	194,651	3.18	620,742.03
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	28,605	59.06	1,689,411.30
UNILEVER PLC	100,482	39.67	3,986,623.35
NMC HEALTH PLC	8,090	-	-
SMITH & NEPHEW PLC	33,906	12.49	423,485.94
ASTRAZENECA PLC	61,542	115.10	7,083,484.20
GSK PLC	163,440	13.63	2,228,340.96
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,740	19.00	109,060.00
BARCLAYS PLC	639,751	1.57	1,007,223.97
HSBC HOLDINGS PLC	791,021	6.10	4,831,556.26
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,649,936	0.45	1,200,023.51
NATWEST GROUP PLC	204,035	2.65	541,508.89

	STANDARD CHARTERED PLC	95,420	6.70	639,314.00
	3I GROUP PLC	36,819	20.31	747,793.89
	ABRDN PLC	88,515	2.16	191,812.00
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	8.44	109,940.88
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	15,067	86.58	1,304,500.86
	M&G PLC	99,522	2.02	201,133.96
	SCHRODERS PLC	30,300	4.57	138,713.40
	ST JAMES'S PLACE PLC	20,540	11.48	235,901.90
	WISE PLC - A	21,400	6.20	132,680.00
	ADMIRAL GROUP PLC	6,795	22.51	152,955.45
	AVIVA PLC	94,524	4.00	378,852.19
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	225,651	2.38	537,049.38
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,230	5.53	167,232.36
	PRUDENTIAL PLC	104,652	11.36	1,188,846.72
	SAGE GROUP PLC/THE	38,840	8.74	339,694.64
	HALMA PLC	14,690	24.29	356,820.10
	BT GROUP PLC	267,752	1.36	366,284.73
	VODAFONE GROUP PLC	996,528	0.72	725,870.99
	CENTRICA PLC	209,200	1.17	245,077.80
	NATIONAL GRID PLC	140,528	10.31	1,449,546.32
	SEVERN TRENT PLC	9,023	27.04	243,981.92
	SSE PLC	43,667	18.36	801,944.45
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	10.39	271,230.95
英ボンド小計		11,026,849		71,367,544.28 (12,683,439,969)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,990	13.14	104,988.60
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	709.00	191,430.00
	GIVAUDAN-REG	378	2,884.00	1,090,152.00
	HOLCIM LTD	22,219	59.86	1,330,029.34
	SIG GROUP AG	10,900	25.62	279,258.00
	SIKA AG-REG	5,505	259.70	1,429,648.50
	ABB LTD-REG	61,275	35.41	2,169,747.75
	GEBERIT AG-REG	1,490	491.20	731,888.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,070	192.10	205,547.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	199.20	294,816.00

VAT GROUP AG	1,015	392.60	398,489.00
ADECCO GROUP AG-REG	6,817	28.47	194,079.99
SGS SA-REG	5,950	85.10	506,345.00
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,160	260.00	561,600.00
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	20,809	147.05	3,059,963.45
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,125	265.00	298,125.00
SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,610	50.20	131,022.00
DUFREY AG-REG	3,460	40.36	139,645.60
BARRY CALLEBAUT AG-REG	130	1,739.00	226,070.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	40	11,240.00	449,600.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	113,400.00	453,600.00
NESTLE SA-REG	109,130	106.52	11,624,527.60
ALCON INC	19,554	71.80	1,403,977.20
SONOVA HOLDING AG-REG	2,051	237.60	487,317.60
STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,370	137.00	598,690.00
BACHEM HOLDING AG	1,400	87.00	121,800.00
LONZA GROUP AG-REG	2,973	569.00	1,691,637.00
NOVARTIS AG-REG	81,063	89.66	7,268,108.58
ROCHE HOLDING AG-BR	1,020	295.80	301,716.00
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	27,898	274.55	7,659,395.90
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,490	95.55	142,369.50
JULIUS BAER GROUP LTD	8,420	58.14	489,538.80
PARTNERS GROUP HOLDING AG	900	887.20	798,480.00
UBS GROUP AG-REG	130,352	18.48	2,409,556.72
BALOISE HOLDING AG - REG	1,740	141.40	246,036.00
HELVETIA HOLDING AG-REG	1,320	125.60	165,792.00
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,285	540.60	694,671.00
SWISS RE AG	12,289	88.46	1,087,084.94
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,876	426.40	2,505,526.40
TEMENOS AG	2,280	75.98	173,234.40
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	50.74	337,928.40
SWISSCOM AG-REG	1,024	552.20	565,452.80
BKW AG	840	148.30	124,572.00
SWISS PRIME SITE-REG	3,441	78.15	268,914.15
	584,073		55,412,372.22

スイスフラン小計				(8,634,355,839)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	10,290	324.20	3,336,018.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,520	412.40	1,451,648.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	22,680	148.05	3,357,774.00	
	ALFA LAVAL AB	10,710	391.20	4,189,752.00	
	ASSA ABLOY AB-B	42,940	260.10	11,168,694.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	111,390	162.85	18,139,861.50	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	56,870	140.75	8,004,452.50	
	BEIJER REF AB	11,900	161.30	1,919,470.00	
	EPIROC AB-A	24,905	203.10	5,058,205.50	
	EPIROC AB-B	15,450	173.60	2,682,120.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	89.58	1,343,700.00	
	INDUTRADE AB	10,180	264.10	2,688,538.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	224.10	1,523,880.00	
	LIFCO AB-B SHS	8,470	233.90	1,981,133.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	63,000	110.10	6,936,300.00	
	SAAB AB-B	2,780	576.20	1,601,836.00	
	SANDVIK AB	40,890	213.70	8,738,193.00	
	SKANSKA AB-B SHS	14,390	150.10	2,159,939.00	
	SKF AB-B SHARES-B	14,079	199.15	2,803,832.85	
	VOLVO AB-A SHS	9,530	226.00	2,153,780.00	
	VOLVO AB-B SHS-B	58,430	219.05	12,799,091.50	
	SECURITAS AB-B SHS	17,788	84.58	1,504,509.04	
	VOLVO CAR AB-B	20,400	44.66	911,064.00	
	EVOLUTION AB	7,140	1,408.40	10,055,976.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,848	145.60	4,054,668.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	23,695	279.70	6,627,491.50	
	GETINGE AB-B SHS	9,470	247.50	2,343,825.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	7,130	224.40	1,599,972.00	
	NORDEA BANK ABP	131,132	112.44	14,744,482.08	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	62,450	118.55	7,403,447.50	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60,120	89.76	5,396,371.20		
SWEDBANK AB - A SHARES	34,550	175.35	6,058,342.50		
EQT AB	10,840	222.30	2,409,732.00		
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	291.40	1,452,337.60		

	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	290.50	1,737,190.00	
	INVESTOR AB-A SHS	23,750	214.20	5,087,250.00	
	INVESTOR AB-B SHS	69,350	214.45	14,872,107.50	
	KINNEVIK AB - B	8,285	153.00	1,267,605.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,590	458.10	1,644,579.00	
	ERICSSON LM-B SHS	108,515	56.94	6,178,844.10	
	HEXAGON AB-B SHS	80,990	131.35	10,638,036.50	
	TELE2 AB-B SHS	23,245	92.42	2,148,302.90	
	TELIA CO AB	118,530	23.98	2,842,349.40	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	23,220	42.44	985,456.80	
	SAGAX AB-B	7,910	230.80	1,825,628.00	
スウェーデンクローナ小計		1,445,116		217,827,787.27 (2,851,365,735)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	12,100	260.30	3,149,630.00	
	EQUINOR ASA	40,254	319.25	12,851,089.50	
	NORSK HYDRO A S	50,660	73.42	3,719,457.20	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,670	366.80	2,446,556.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,900	468.40	1,826,760.00	
	ADEVINTA ASA	11,400	77.60	884,640.00	
	MOWI ASA	16,360	186.50	3,051,140.00	
	ORKLA ASA	32,290	76.94	2,484,392.60	
	SALMAR ASA	3,590	467.80	1,679,402.00	
	DNB BANK ASA	35,845	192.90	6,914,500.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,410	177.10	1,312,311.00	
	TELENOR ASA	23,915	109.35	2,615,105.25	
ノルウェークローネ小計		244,394		42,934,984.05 (565,024,390)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,840	509.00	1,954,560.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,165	338.10	2,760,586.50	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	315	1,784.00	561,960.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	41,480	195.46	8,107,680.80	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	115	12,460.00	1,432,900.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	195	12,620.00	2,460,900.00	
	DSV A/S	7,250	1,355.00	9,823,750.00	
	PANDORA A/S	3,310	585.00	1,936,350.00	

	CARLSBERG AS-B	3,630	1,066.00	3,869,580.00	
	COLOPLAST-B	4,485	846.80	3,797,898.00	
	DEMANT A/S	3,640	290.80	1,058,512.00	
	GENMAB A/S	2,580	2,665.00	6,875,700.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	65,715	1,091.20	71,708,208.00	
	DANSKE BANK A/S	26,635	162.00	4,314,870.00	
	TRYG A/S	13,945	154.60	2,155,897.00	
	ORSTED A/S	7,570	657.40	4,976,518.00	
	デンマーククローネ小計	192,870		127,795,870.30 (2,609,591,671)	
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	30.53	267,900.75	
	SANTOS LTD	121,660	7.29	886,901.40	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	75,946	34.65	2,631,528.90	
	BHP GROUP LTD	199,987	45.90	9,179,403.30	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	20.53	375,904.30	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	65,915	21.70	1,430,355.50	
	IGO LTD	24,300	15.14	367,902.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	16,955	39.09	662,770.95	
	MINERAL RESOURCES LTD	6,240	71.32	445,036.80	
	NEWCREST MINING LTD	35,809	26.08	933,898.72	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42,190	13.04	550,157.60	
	ORICA LIMITED	17,675	15.16	267,953.00	
	PILBARA MINERALS LTD	133,600	4.88	651,968.00	
	RIO TINTO LTD	13,468	116.15	1,564,308.20	
	SOUTH32 LTD	207,787	3.90	810,369.30	
	REECE LTD	10,200	18.79	191,658.00	
	BRAMBLES LTD	54,798	13.77	754,568.46	
	COMPUTERSHARE LTD	20,910	22.82	477,166.20	
	AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	3.57	262,644.90	
	QANTAS AIRWAYS LTD	35,030	6.39	223,841.70	
	TRANSURBAN GROUP	129,996	14.27	1,855,042.92	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,520	38.08	895,641.60	
	IDP EDUCATION LTD	12,410	23.68	293,868.80	
	LOTTERY CORP LTD/THE	85,554	5.06	432,903.24	
	REA GROUP LTD	1,820	132.50	241,150.00	

	SEEK LTD	12,860	21.60	277,776.00	
	WESFARMERS LTD	42,585	48.20	2,052,597.00	
	COLES GROUP LTD	57,925	17.89	1,036,278.25	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	50,462	5.93	299,239.66	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	49,102	38.37	1,884,043.74	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	27,906	11.42	318,686.52	
	COCHLEAR LTD	2,527	237.47	600,086.69	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,105	57.50	408,537.50	
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	35.01	618,276.60	
	CSL LTD	19,212	287.25	5,518,647.00	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	120,799	22.92	2,768,713.08	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	66,357	97.37	6,461,181.09	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	124,183	25.51	3,167,908.33	
	WESTPAC BANKING CORP	140,651	20.56	2,891,784.56	
	ASX LTD	7,105	60.82	432,126.10	
	MACQUARIE GROUP LTD	14,604	178.05	2,600,242.20	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,370	31.79	266,082.30	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	5.23	497,503.75	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	108,430	3.61	391,432.30	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	55,210	15.12	834,775.20	
	SUNCORP GROUP LTD	44,036	13.14	578,633.04	
	WISETECH GLOBAL LTD	5,920	78.30	463,536.00	
	XERO LTD	4,930	111.34	548,906.20	
	TELSTRA GROUP LTD	164,284	4.35	714,635.40	
	APA GROUP	45,818	10.04	460,012.72	
	ORIGIN ENERGY LTD	68,320	8.49	580,036.80	
	豪ドル小計	2,797,911		63,326,522.57 (6,039,450,457)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,165	8.29	390,997.85	
	EBOS GROUP LTD	5,630	35.64	200,653.20	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,130	23.79	550,262.70	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	5.12	392,074.24	
	MERCURY NZ LTD	34,100	6.36	217,046.50	
	MERIDIAN ENERGY LTD	57,830	5.42	313,438.60	
		244,432		2,064,473.09	

ニュージーランドドル小計				(179,464,645)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	103,208	48.85	5,041,710.80	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	52,500	81.60	4,284,000.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	71,000	12.40	880,400.00	
	MTR CORP	62,500	36.80	2,300,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	14.02	729,040.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	81,000	51.35	4,159,350.00	
	SANDS CHINA LTD	96,600	28.50	2,753,100.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	21.25	1,442,875.00	
	WH GROUP LTD	299,894	4.15	1,244,560.10	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	148,000	24.10	3,566,800.00	
	HANG SENG BANK LTD	29,100	112.80	3,282,480.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	48,300	311.20	15,030,960.00	
	AIA GROUP LTD	463,190	82.15	38,051,058.50	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	9.02	1,353,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	41.75	1,043,750.00	
	CLP HOLDINGS LTD	63,000	56.55	3,562,650.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	456,237	6.85	3,125,223.45	
	POWER ASSETS HOLDINGS	58,000	41.15	2,386,700.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	80,538	44.55	3,587,967.90	
	ESR GROUP LTD	75,800	13.98	1,059,684.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	13.04	1,017,120.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	23.55	1,363,568.55	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	61,666	19.96	1,230,853.36	
	SINO LAND CO	123,050	9.70	1,193,585.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,480	101.20	6,120,576.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	17,517	53.55	938,035.35	
SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	19.76	822,016.00		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	41.05	2,618,990.00		
香港ドル小計		2,987,781		114,190,054.01	(2,047,427,668)
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	53,360	6.69	356,978.40	
	SEATRIM LTD	1,488,177	0.12	190,486.65	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	63,300	3.71	234,843.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	7.60	409,640.00	

	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.95	200,545.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	4.02	297,319.20	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	71,195	31.16	2,218,436.20	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	134,240	12.43	1,668,603.20	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	49,900	28.07	1,400,693.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	32,800	9.70	318,160.00	
	VENTURE CORP LTD	9,900	15.19	150,381.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	354,480	2.49	882,655.20	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	105,000	3.36	352,800.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	6.95	120,235.00	
	UOL GROUP LTD	15,550	6.70	104,185.00	
シンガポールドル小計		2,734,162		8,905,960.85	(931,385,385)
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	26,090	20.61	537,714.90	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,010	739.00	746,390.00	
	BANK HAPOALIM BM	46,265	31.05	1,436,528.25	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	62,565	27.11	1,696,137.15	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	48,330	18.84	910,537.20	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,900	129.00	890,100.00	
	NICE LTD	2,440	818.20	1,996,408.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	4,700	147.00	690,900.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,780	215.60	383,768.00	
イスラエルシュケル小計		200,080		9,288,483.50	(363,908,850)
合 計		44,717,497		286,332,550,594	(286,332,550,594)

(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	6,250	762,000.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	12,110	421,791.30	
		AMERICAN TOWER CORP	18,569	3,584,188.38	

		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	18,847	389,190.55	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,790	1,101,026.40	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,717	310,032.91	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,700	413,512.00	
		CROWN CASTLE INC	16,110	1,843,145.10	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,695	1,233,705.55	
		EQUINIX INC	3,733	2,895,986.74	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,550	443,042.00	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	15,450	1,025,416.50	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	578,807.20	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,290	758,162.80	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,340	568,474.20	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	14,810	289,683.60	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	421,762.50	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	27,179	474,545.34	
		INVITATION HOMES INC	27,180	925,207.20	
		IRON MOUNTAIN INC	10,815	613,426.80	
		KIMCO REALTY CORP	23,760	458,568.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,300	659,620.00	
		PROLOGIS INC	36,745	4,492,811.15	
		PUBLIC STORAGE	6,319	1,795,354.28	
		REALTY INCOME CORP	25,471	1,558,315.78	
		REGENCY CENTERS CORP	6,005	365,344.20	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,175	959,498.50	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	13,394	1,485,394.60	
		SUN COMMUNITIES INC	4,640	620,739.20	
		UDR INC	12,100	521,631.00	
		VENTAS INC	17,025	788,598.00	
		VICI PROPERTIES INC	39,120	1,266,705.60	
		WELLTOWER INC	21,000	1,712,340.00	
		WEYERHAEUSER CO	29,998	915,538.96	
		WP CAREY INC	8,610	602,011.20	
米ドル小計			496,652	37,255,577.54	(5,230,310,530)
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	139,832.00	

加ドル小計			2,800	139,832.00 (14,724,309)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	89,012.00
		GECINA SA	1,950	191,100.00
		KLEPIERRE	8,402	187,448.62
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,990	233,881.30
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,730	203,917.40
ユーロ小計			24,997	905,359.32 (137,750,420)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	30,601	102,421.54
		LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	158,093.31
		SEGRO PLC	45,033	340,179.28
英ポンド小計			102,258	600,694.13 (106,755,360)
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	42,067	331,067.29
		GOODMAN GROUP	70,642	1,390,940.98
		GPT GROUP	71,335	286,766.70
		LENDLEASE GROUP	23,367	165,204.69
		MIRVAC GROUP	159,875	348,527.50
		SCENTRE GROUP	198,271	513,521.89
		STOCKLAND	102,400	416,768.00
		VICINITY CENTRES	154,902	288,117.72
豪ドル小計			822,859	3,740,914.77 (356,771,041)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	104,160	4,869,480.00
香港ドル小計			104,160	4,869,480.00 (87,309,776)
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,243	369,108.81
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	412,825.32
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	144,556	239,962.96
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	106,000	175,960.00
シンガポールドル小計			598,355	1,197,857.09 (125,271,894)
合計				6,058,893,330 (6,058,893,330)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 603銘柄	97.6%		72.1%
	投資証券 35銘柄		2.4%	1.8%
加ドル	株式 86銘柄	99.9%		3.4%
	投資証券 1銘柄		0.1%	0.0%
ユーロ	株式 218銘柄	99.5%		9.9%
	投資証券 5銘柄		0.5%	0.0%
英ポンド	株式 80銘柄	99.2%		4.3%
	投資証券 3銘柄		0.8%	0.0%
スイスフラン	株式 44銘柄	100.0%		3.0%
スウェーデンクローナ	株式 45銘柄	100.0%		1.0%
ノルウェークローネ	株式 12銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式 16銘柄	100.0%		0.9%
豪ドル	株式 51銘柄	94.4%		2.1%
	投資証券 8銘柄		5.6%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 6銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式 28銘柄	95.9%		0.7%
	投資証券 1銘柄		4.1%	0.0%
シンガポールドル	株式 15銘柄	88.1%		0.3%
	投資証券 4銘柄		11.9%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	100.0%		0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2023年 6月30日現在です。

【世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型】

【純資産額計算書】

資産総額	39,765,943,396円
負債総額	64,446,296円
純資産総額(-)	39,701,497,100円
発行済口数	36,629,549,300口
1口当たり純資産額(/)	1.0839円

(参考)

日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	60,442,873,724円
負債総額	39,855,726円
純資産総額(-)	60,403,017,998円
発行済口数	23,928,548,856口
1口当たり純資産額(/)	2.5243円

海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	57,717,695,487円
負債総額	2,389,489円
純資産総額(-)	57,715,305,998円
発行済口数	19,627,645,359口
1口当たり純資産額(/)	2.9405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	51,889,559,907円
負債総額	255,802,175円
純資産総額（ - ）	51,633,757,732円
発行済口数	37,515,127,268口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3763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	160,690,764,157円
負債総額	183,669,098円
純資産総額（ - ）	160,507,095,059円
発行済口数	58,469,039,654口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7452円

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	50,736,678,657円
負債総額	11,104,157円
純資産総額（ - ）	50,725,574,500円
発行済口数	21,867,517,745口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3197円

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	308,169,612,140円
負債総額	1,503,324,791円
純資産総額（ - ）	306,666,287,349円
発行済口数	60,784,584,448口
1口当たり純資産額（ / ）	5.0451円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

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

いものとしてします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2023年6月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2023年6月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

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

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

・監査等委員会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（2023年6月末現在）

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用状況の評価・分析および運用リスク（流動性リスクを含む）の管理ならびに法令など遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理/コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2023年6月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	852	270,873
株式投資信託	797	231,267
単位型	315	9,758
追加型	482	221,508
公社債投資信託	55	39,606
単位型	42	1,031
追加型	13	38,574

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)
負債の部		
流動負債		
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
固定負債		
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
純資産の部		
株主資本		
資本金	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金	5,220	5,220
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	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
評価・換算差額等		
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="528 757 1034 831"> <tr> <td>建物</td> <td>3年～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3年～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	3年～15年	器具備品	3年～20年
建物	3年～15年				
器具備品	3年～20年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>				
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>				

<p>5 ヘッジ会計の方法</p>	<p>(3) 成功報酬 当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。</p> <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>
<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>	<p>消費税等の会計処理 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

(会計方針の変更)

<p style="text-align: center;">第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)</p>
<p>(時価の算定に関する会計基準の適用) 「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(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)

<p style="text-align: center;">第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)</p>
<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 其他有価証券 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)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 5,312	(1) 関連会社に対する投資の金額 5,326
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 15,942	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 16,722
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,964	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 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

- 1 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。
- 2 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。
- 3 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(ロンドン)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せん。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第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せん。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第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いません。

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第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 (2023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 (2023年3月末現在)	事業の内容
あかつき証券株式会社	3,067百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
大和証券株式会社	100,000百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
東洋証券株式会社 1	13,494百万円	
野村證券株式会社 1	10,000百万円	
八十二証券株式会社 1	3,000百万円	
フィデリティ証券株式会社	11,757百万円 (2022年12月末現在)	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	19,495百万円	
株式会社秋田銀行 1	14,100百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社イオン銀行	51,250百万円	
株式会社香川銀行	12,014百万円	
株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	
株式会社三十三銀行 1	37,461百万円	
株式会社滋賀銀行	33,076百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社東和銀行	38,653百万円	
株式会社鳥取銀行	9,061百万円	
株式会社富山銀行 1	6,730百万円	
株式会社八十二銀行	52,243百万円	
株式会社百十四銀行	37,322百万円	
株式会社南日本銀行	13,351百万円	
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	
株式会社琉球銀行	56,967百万円	

株式会社S M B C 信託銀行	87,550百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
みずほ信託銀行株式会社	247,369百万円	
農林中央金庫	4,040,198百万円	全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余剰資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
労働金庫連合会	120,000百万円 (出資の総額)	労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

1 募集の取扱いを行いません。

名 称	資本金の額 (2022年3月末現在)	事業の内容
埼玉県信用農業協同組合連合会	165,627百万円	農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでおります。
東京都信用農業協同組合連合会	132,435百万円	
神奈川県信用農業協同組合連合会	298,878百万円	
長野県信用農業協同組合連合会	103,923百万円	
新潟県信用農業協同組合連合会	74,495百万円	
石川県信用農業協同組合連合会	33,047百万円	
岐阜県信用農業協同組合連合会	99,118百万円	
静岡県信用農業協同組合連合会	161,302百万円	
愛知県信用農業協同組合連合会	242,402百万円	
三重県信用農業協同組合連合会	68,752百万円	
滋賀県信用農業協同組合連合会	40,771百万円	
大阪府信用農業協同組合連合会	140,690百万円	
兵庫県信用農業協同組合連合会	258,320百万円	
和歌山県信用農業協同組合連合会	57,883百万円	
山口県信用農業協同組合連合会	50,542百万円	
徳島県信用農業協同組合連合会	32,545百万円	
仙台農業協同組合	3,374百万円	
みやぎ亘理農業協同組合	1,505百万円	
みやぎ登米農業協同組合	6,232百万円	
新みやぎ農業協同組合	10,274百万円	
いしのまき農業協同組合	4,584百万円	
みやぎ仙南農業協同組合	3,756百万円	
秋田しんせい農業協同組合	5,222百万円	
山形農業協同組合	3,911百万円	
さがえ西村山農業協同組合	3,633百万円	
山形おきたま農業協同組合	4,572百万円	

鶴岡市農業協同組合	1,451百万円
庄内たがわ農業協同組合	4,161百万円
ふくしま未来農業協同組合	16,061百万円
茨城みなみ農業協同組合	1,358百万円
北つくば農業協同組合	3,405百万円
はが野農業協同組合	3,960百万円
那須南農業協同組合	1,172百万円
高崎市農業協同組合	2,204百万円
佐波伊勢崎農業協同組合	2,521百万円
さいたま農業協同組合	8,277百万円
あさか野農業協同組合	863百万円
いるま野農業協同組合	5,616百万円
埼玉中央農業協同組合	2,318百万円
くまがや農業協同組合	2,706百万円
ほくさい農業協同組合	3,117百万円
越谷市農業協同組合	2,038百万円
南彩農業協同組合	2,880百万円
埼玉みずほ農業協同組合	1,504百万円
さいかつ農業協同組合	1,832百万円
ふかや農業協同組合	1,694百万円
横浜農業協同組合	11,721百万円
セレサ川崎農業協同組合	2,486百万円
よこすか葉山農業協同組合	1,358百万円
さがみ農業協同組合	5,060百万円
湘南農業協同組合	3,195百万円
秦野市農業協同組合	1,641百万円
かながわ西湘農業協同組合	2,385百万円
厚木市農業協同組合	2,420百万円
相模原市農業協同組合	842百万円
神奈川つくい農業協同組合	762百万円
佐久浅間農業協同組合	7,042百万円
信州うえだ農業協同組合	4,020百万円
信州諏訪農業協同組合	6,256百万円
上伊那農業協同組合	8,056百万円
みなみ信州農業協同組合	4,372百万円
松本ハイランド農業協同組合	8,922百万円
大北農業協同組合	3,052百万円
グリーン長野農業協同組合	3,820百万円
中野市農業協同組合	2,527百万円
ながの農業協同組合	12,995百万円
北越後農業協同組合	2,913百万円
新潟かがやき農業協同組合	12,859百万円 (2022年4月1日現在)

えちご中越農業協同組合	15,869百万円 (2023年2月1日現在)
十日町農業協同組合	2,626百万円
ひすい農業協同組合	1,184百万円
にいがた岩船農業協同組合	2,327百万円
佐渡農業協同組合	2,324百万円
加賀農業協同組合	1,961百万円
小松市農業協同組合	2,052百万円
能美農業協同組合	1,265百万円
金沢中央農業協同組合	1,063百万円
金沢市農業協同組合	3,108百万円
はくい農業協同組合	1,369百万円
能登わかば農業協同組合	2,544百万円
能登農業協同組合	2,500百万円 (2023年8月1日現在)
ぎふ農業協同組合	7,119百万円
西美濃農業協同組合	4,468百万円
いび川農業協同組合	1,963百万円
めぐみの農業協同組合	4,965百万円
陶都信用農業協同組合	1,597百万円
東美濃農業協同組合	2,652百万円
飛騨農業協同組合	6,471百万円
富士伊豆農業協同組合	11,165百万円 (2022年4月1日現在)
清水農業協同組合	2,893百万円
静岡市農業協同組合	1,822百万円
大井川農業協同組合	3,275百万円
ハイナン農業協同組合	819百万円
掛川市農業協同組合	780百万円
遠州夢咲農業協同組合	3,403百万円
遠州中央農業協同組合	3,215百万円
とびあ浜松農業協同組合	3,630百万円
三ヶ日町農業協同組合	292百万円
尾張中央農業協同組合	2,061百万円
西春日井農業協同組合	154百万円
あいち尾東農業協同組合	1,187百万円
愛知北農業協同組合	744百万円
愛知西農業協同組合	1,593百万円
あいち知多農業協同組合	6,783百万円
あいち中央農業協同組合	3,589百万円
西三河農業協同組合	1,313百万円
あいち三河農業協同組合	1,111百万円
あいち豊田農業協同組合	1,797百万円

愛知東農業協同組合	924百万円
豊橋農業協同組合	2,455百万円
鈴鹿農業協同組合	1,548百万円
津安芸農業協同組合	2,518百万円
伊勢農業協同組合	6,329百万円
伊賀ふるさと農業協同組合	3,799百万円
甲賀農業協同組合	2,568百万円
北大阪農業協同組合	1,794百万円
茨木市農業協同組合	1,198百万円
大阪泉州農業協同組合	1,918百万円
いずみの農業協同組合	2,781百万円
堺市農業協同組合	1,201百万円
大阪南農業協同組合	3,599百万円
グリーン大阪農業協同組合	1,415百万円
大阪中河内農業協同組合	4,167百万円
北河内農業協同組合	2,749百万円
大阪市農業協同組合	2,412百万円
兵庫南農業協同組合	3,722百万円
みのり農業協同組合	4,265百万円
兵庫西農業協同組合	12,628百万円
たじま農業協同組合	4,301百万円
丹波ひかみ農業協同組合	2,158百万円
淡路日の出農業協同組合	1,844百万円
奈良県農業協同組合	9,294百万円
わかやま農業協同組合	4,861百万円
ながみね農業協同組合	2,070百万円
紀の里農業協同組合	3,918百万円
紀北川上農業協同組合	4,989百万円
ありだ農業協同組合	2,151百万円
紀州農業協同組合	3,834百万円
紀南農業協同組合	4,870百万円
みくまの農業協同組合	1,170百万円
鳥取いなば農業協同組合	5,703百万円
鳥取中央農業協同組合	3,581百万円
鳥取西部農業協同組合	4,979百万円
島根県農業協同組合	21,662百万円
広島市農業協同組合	10,341百万円
ひろしま農業協同組合	61,155百万円 (2023年4月1日現在)
山口県農業協同組合	16,321百万円
徳島市農業協同組合	3,991百万円
香川県農業協同組合	24,495百万円
越智今治農業協同組合	6,344百万円

高知市農業協同組合	5,111百万円
高知県農業協同組合	10,571百万円
福岡八女農業協同組合	3,267百万円
宮崎中央農業協同組合	5,550百万円
沖縄県農業協同組合	23,893百万円

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

(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いません。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2022年12月28日	臨時報告書
2023年 2月 7日	有価証券届出書の訂正届出書
2023年 3月15日	有価証券届出書
2023年 3月15日	有価証券報告書
2023年 3月31日	臨時報告書

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9月6日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

P w C あらた有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2022年12月16日から2023年6月15日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2023年6月15日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。