

【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10月18日提出
【計算期間】	第7期(自 2022年7月20日至 2023年7月18日)
【ファンド名】	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 ステファニー・ドゥルーズ
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

主として、日本を含む世界各国の株式、債券、不動産投信およびコモディティ(商品)連動証券などに投資を行なう投資信託証券に投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

「資産配分変更型」とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。

年1回

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

グローバル(含む日本)

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

ファンド・オブ・ファンズ

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

為替ヘッジあり(部分ヘッジ)

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

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

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

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

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

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

*2 その他の資産については、低リスク資産による安定的な運用を行ないます。

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

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

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

繰上償還について

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

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

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

資産分散について

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

投資対象資産と期待される収益・効果



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

(2016年9月末現在)

投資タイミングの分散について

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

「エントリー分散」の仕組み



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

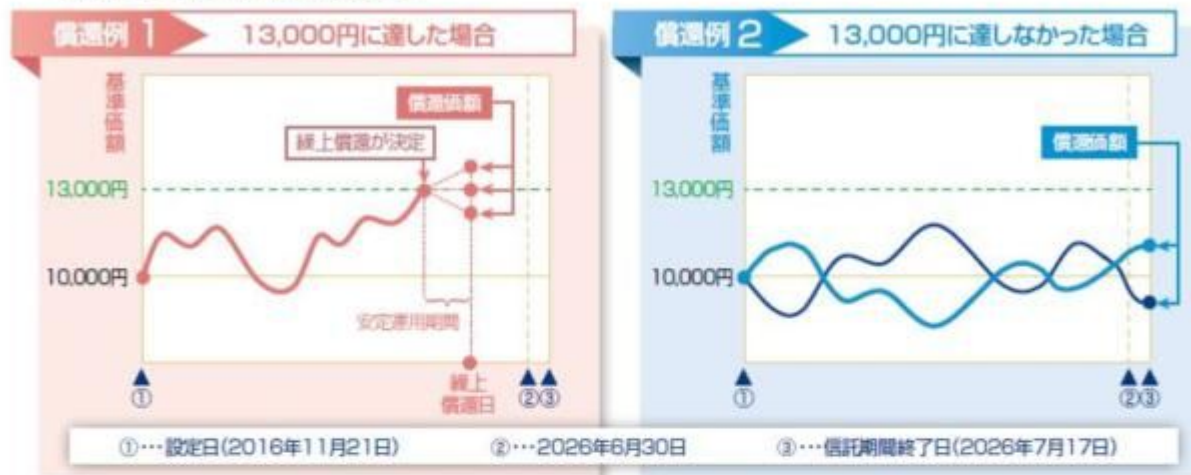
※低リスク資産は、内外のソブリン債を投資対象とし、外貨建資産については為替ヘッジを行なうことで為替変動リスクの低減を図ります。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。また、為替ヘッジを行なうことに伴い、為替ヘッジコストがかかります。

※上記は「エントリー分散」の仕組みについて説明するためのイメージ図です。

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

繰上償還について

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

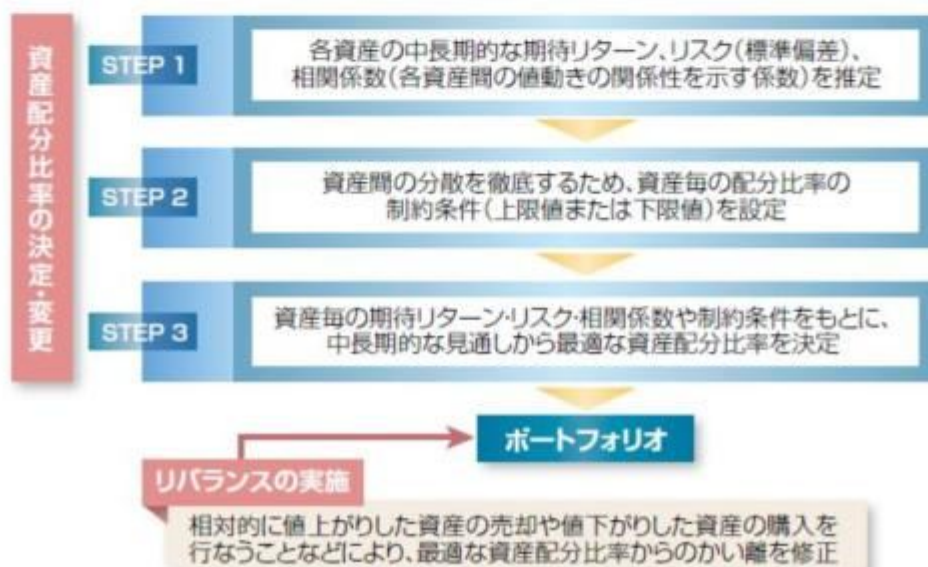


※上記は繰上償還について説明するためのイメージ図です。

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

資産配分の決定プロセス

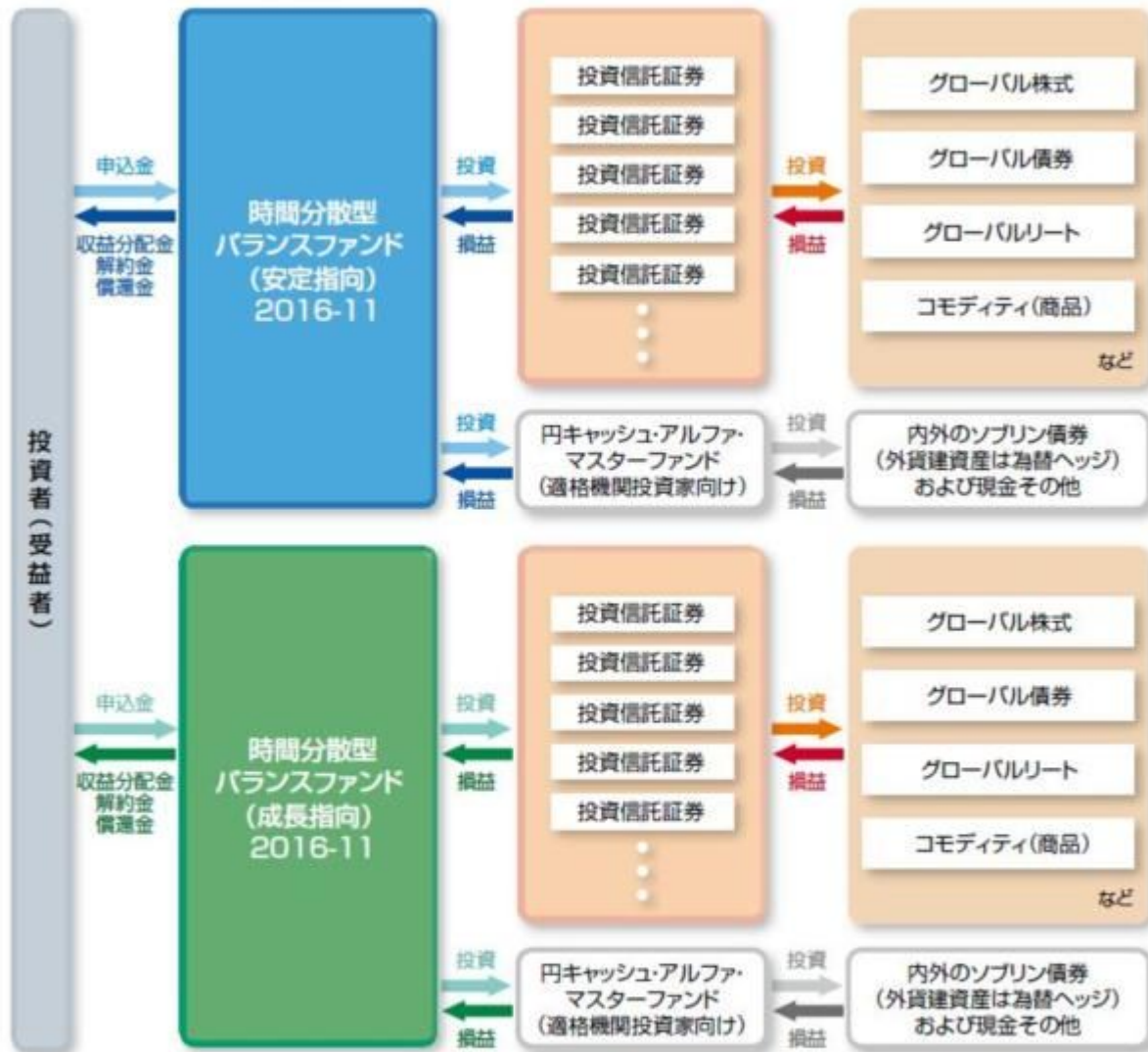
- 当ファンドにおいて、世界の資産への分散投資における資産配分比率の決定および変更は、年金運用などで豊富な運用ノウハウを持つ三井住友信託銀行株式会社からの投資助言に基づき行ないます。



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

ファンドの仕組み

■当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



※投資先投資信託証券は適宜見直しを行いません。

※投資先投資信託証券の詳細については、後述の追加的記載事項をご覧ください。

〈主な投資制限〉

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

〈分配方針〉

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

追加的記載事項

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

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

(有価証券報告書提出日現在)

信託金限度額

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

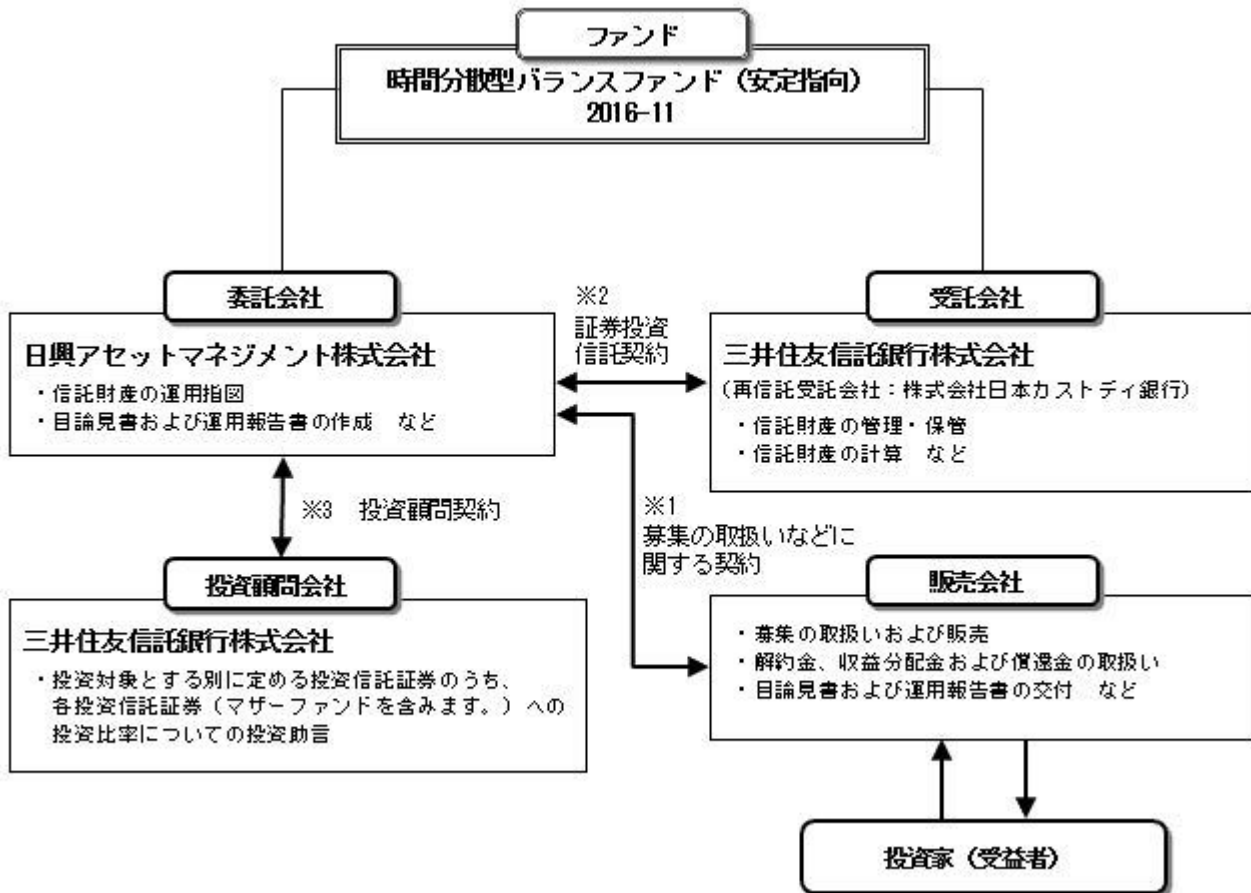
(2) 【ファンドの沿革】

2016年11月21日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

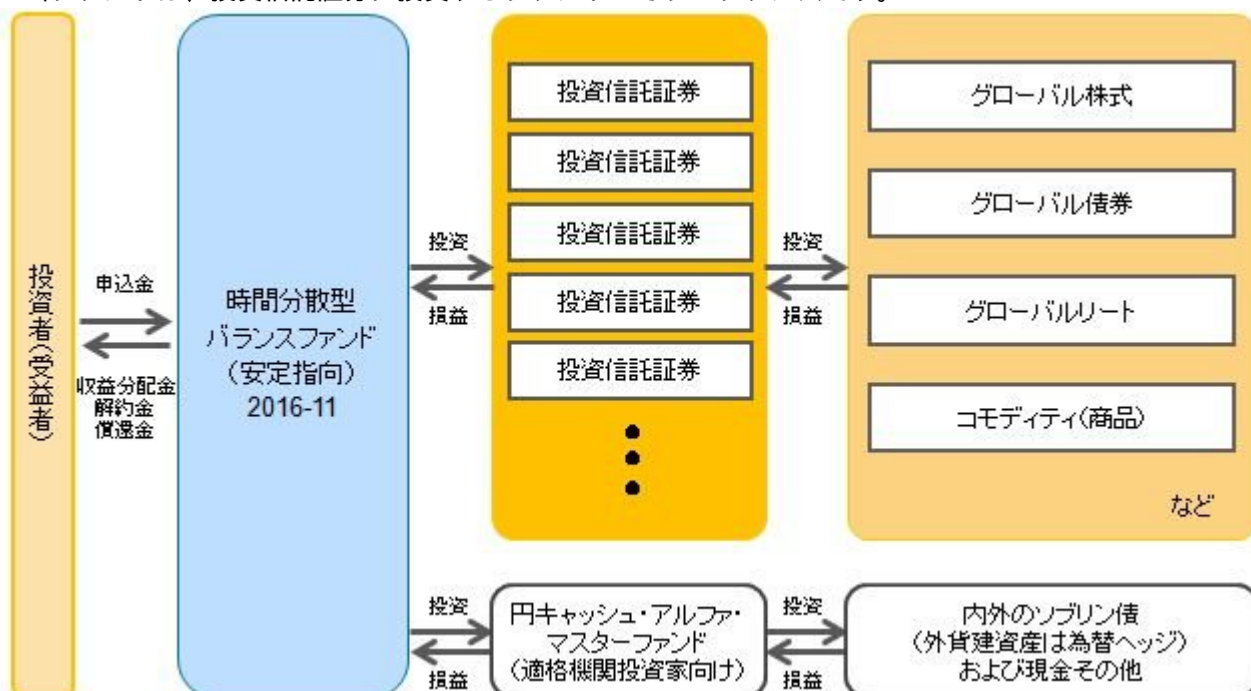
ファンドの仕組み



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

<ファンド・オブ・ファンズの仕組み>

当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



投資先投資信託証券は適宜見直しを行いません。

投資先投資信託証券の詳細については、前述の追加的記載事項をご覧ください。

委託会社の概況（2023年7月末現在）

1）資本金

17,363百万円

2）沿革

1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

3）大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

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

- ・各投資信託証券への投資比率の合計は、原則として高位を保ちます。

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

当初設定時からの約3ヵ月間において、以下の投資比率を目指します。

別に定める投資信託証券への投資比率の合計 … 25%

円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）… 75%

2017年2月下旬以降の約3ヵ月間において、以下の投資比率を目指します。

別に定める投資信託証券への投資比率の合計 … 50%

円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）… 50%

2017年5月下旬以降の約3ヵ月間において、以下の投資比率を目指します。

別に定める投資信託証券への投資比率の合計 … 75%

円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）… 25%

2017年8月下旬以降の信託期間中において、以下の投資比率を目指します。

別に定める投資信託証券への投資比率の合計 … 100%

円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）… 0%

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

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

- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（2）【投資対象】

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

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 追加型証券投資信託 円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け） 受益証券
- 2) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 3) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、2)の証券の性質を有するもの
- 4) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

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

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

投資対象とする投資信託証券の概要

<インデックス マザーファンド T O P I X >

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

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

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

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

<ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド>

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

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

<インデックス マザーファンド リポート>

運用の基本方針

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

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

< インデックス マザーファンド 海外先進国債券 >

運用の基本方針	
基本方針	日本を除く先進国の債券に投資を行ない、別に定める日本を除く先進国債券市場を代表する指数（FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）（有価証券届出書提出日現在）以下同じ。）に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として日本を除く先進国の債券に投資を行ない、別に定める日本を除く先進国債券市場を代表する指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。対象指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性を勘案し委託会社の判断により決定するものとします。 運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社

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

<先進国資本エマージング株式マザーファンド>

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

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

< インデックス マザーファンド コモディティ >

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

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

< インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け） >

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

その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> 運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、「別に定める日本を除く先進国株式市場を代表する指数」その他これに類する標章の使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。 組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税などについては、その都度、信託財産から支払われます。 <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2016年8月23日設定）
決算日	毎月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

その他

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

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

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

< インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け） >

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

その他報酬	<ul style="list-style-type: none"> ・有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額 ・投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> ・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、「別に定める日本を除く先進国リート市場を代表する指数」その他これに類する標章の使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。 ・組入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については、その都度、信託財産から支払われます。 <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2016年8月23日設定）
決算日	毎月15日（休業日の場合は翌営業日）

（ご参考）＜海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、S & P先進国REIT指数（除く日本、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。

<インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）>

運用の基本方針

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

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 ・投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
ファンドに係る費用	
信託報酬	純資産総額に対し年率0.099%（税抜0.09%）
その他報酬	<ul style="list-style-type: none"> ・有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額 ・投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> ・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、「別に定める新興国債券市場を代表する指数」その他これに類する標章の使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。 ・組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税などについては、その都度、信託財産から支払われます。 <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2016年8月23日設定）
決算日	毎月16日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、新興国の現地通貨建債券に投資し、J Pモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、新興国の現地通貨建債券の騰落率に償還価額などが連動する債券を活用することもあります。 ・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、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券、新株予約権証券および新株引受権付社債券を含みます。）への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2008年3月31日設定）
決算日	毎年5月16日（休業日の場合は翌営業日）

* J Pモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバースファイドは、J Pモルガンが発表している、エマージング・カントリーの債券市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

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

<円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）>

運用の基本方針

基本方針	インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行いません。
主な投資対象	ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド受益証券に投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行いません。 ・マザーファンド受益証券の組入比率は、この信託の純資産総額に対して50%以上となることを原則とし、金利動向等に応じて機動的に変更できるものとします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の10%以下とします。 ・投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。
ファンドに係る費用	
信託報酬	純資産総額に対し年率0.088%（税抜0.08%）
その他報酬	<ul style="list-style-type: none"> ・有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額 ・投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限り、他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> ・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。 ・組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税などについては、その都度、信託財産から支払われます。 <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社

受託会社	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2016年8月22日設定）
決算日	毎年8月10日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> 運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。 組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税などについては、その都度、信託財産から支払われます。 <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	2027年7月8日まで（2017年9月29日設定）
決算日	毎年7月8日（休業日の場合は翌営業日）

（ご参考）＜ゴールド・マザーファンド＞

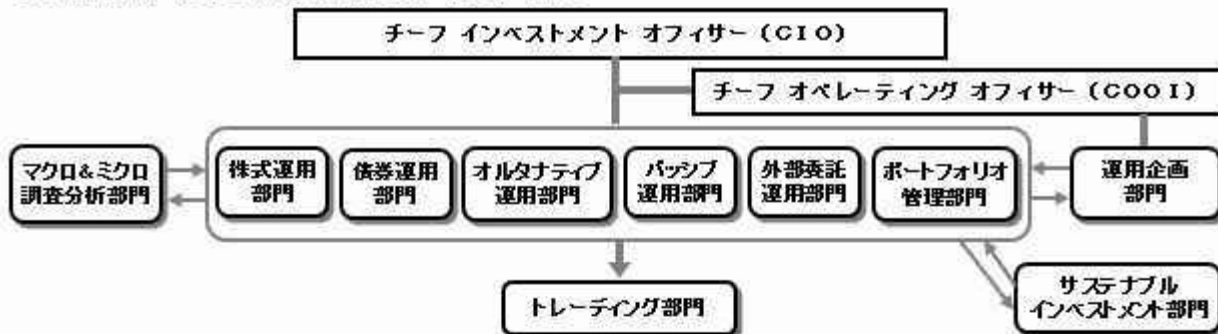
運用の基本方針	
基本方針	主に金地金価格への連動をめざす上場投資信託証券に投資を行ない、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	金地金価格への連動をめざす上場投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場されている投資信託証券であって、金地金価格への連動をめざす投資信託証券に投資を行ない、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。なお、ファンドの状況や投資環境に応じて、金地金価格への連動をめざすために、金先物価格への連動をめざす上場投資信託証券や上場投資信託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

その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社
信託期間	無期限(2013年3月25日設定)
決算日	毎年3月8日(休業日の場合は翌営業日)

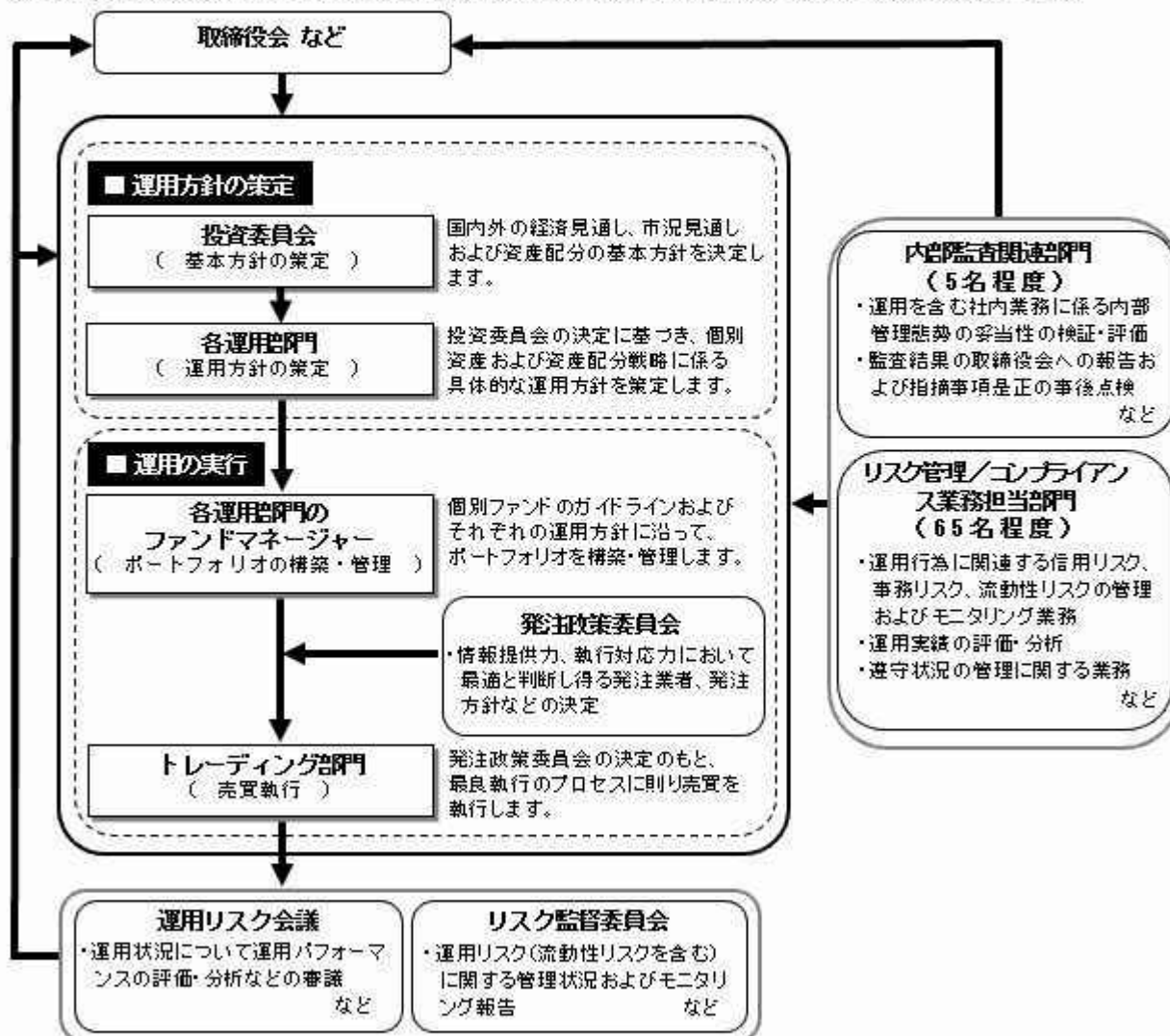
(3) 【運用体制】

<日興アセットマネジメント株式会社(委託会社)における運用体制>

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

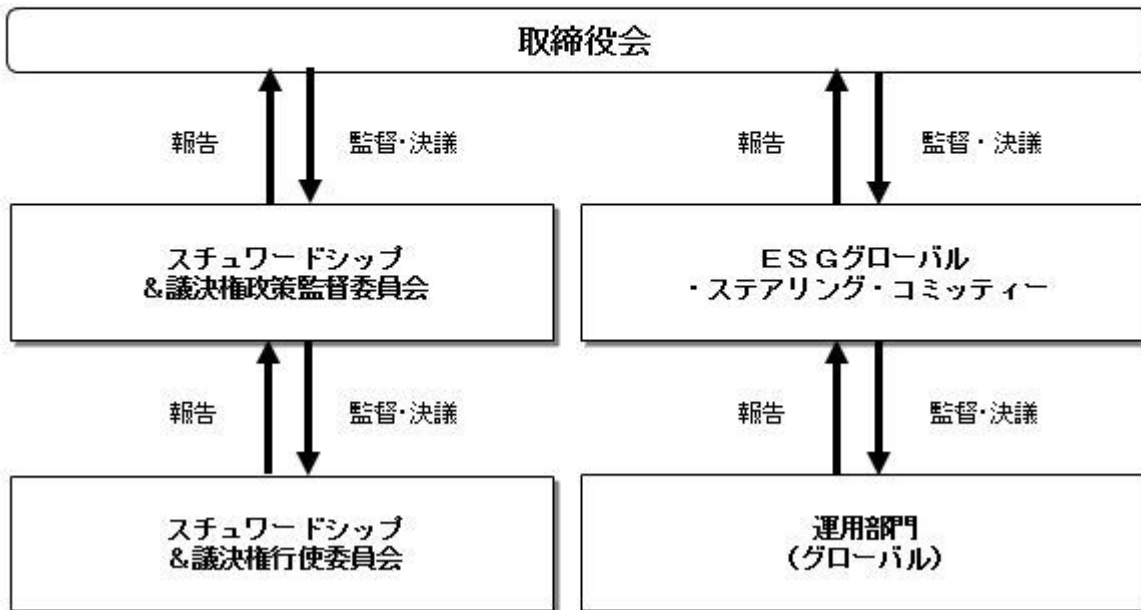
「受託会社」に対しては、日々の純資産照会、月次の勘定残高照会などを行っております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行っており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

「投資顧問会社」については、投資顧問会社の管理体制およびリスク管理状況のモニタリングをリスク管理業務担当部門にて行なっています。また、外部委託運用部門では外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているなどのモニタリングを行っております。

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

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

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



上記体制は2023年7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

収益分配金の支払い

<分配金再投資コース>

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

<分配金受取りコース>

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

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

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

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

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

火災、自然災害などに伴う不動産の滅失・毀損などにより、その価格が影響を受ける可能性もあります。不動産投信の財務状況、業績や市況環境が悪化する場合、不動産投信の分配金や価格は下がり、ファンドに損失が生じるリスクがあります。

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

流動性リスク

- ・市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。
- ・一般に新興国の債券および株式は、先進国の債券および株式に比べて市場規模や取引量が少ないため、流動性リスクが高まる場合があります。

信用リスク

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

為替変動リスク

- ・一部の資産を除き、原則として、為替ヘッジを行わないため、外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
- ・一部の資産において、為替ヘッジを行なうにあたっては、円の金利が為替ヘッジを行なう通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替および金利の動向によっては、為替ヘッジに伴うヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。
- ・一般に新興国の通貨は、先進国の通貨に比べて為替変動が大きくなる場合があります。

カントリー・リスク

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

する場合があります。

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

有価証券の貸付などにおけるリスク

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

< 繰上償還に関する事項 >

- ・1万円当たり基準価額が13,000円以上となった場合には、信託約款の規定に基づき、繰上償還します（償還価額が13,000円以上であることを保証するものではありません。）。
- ・13,000円は、あくまでも安定運用に切り替えるための価額水準であり、ファンドの基準価額が13,000円以上となることを示唆あるいは保証するものではありません。また、資産価格の変動の影響および外国為替予約取引等の決済を速やかに行なえないなどの事由により、基準価額が13,000円以上となった日の翌営業日以降（安定運用への切り替え完了後も含みます。）の基準価額が13,000円を下回る場合があります。

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

< その他の留意事項 >

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。

- ・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

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

- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

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

- ・運用制限や規制上の制限に関する事項

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

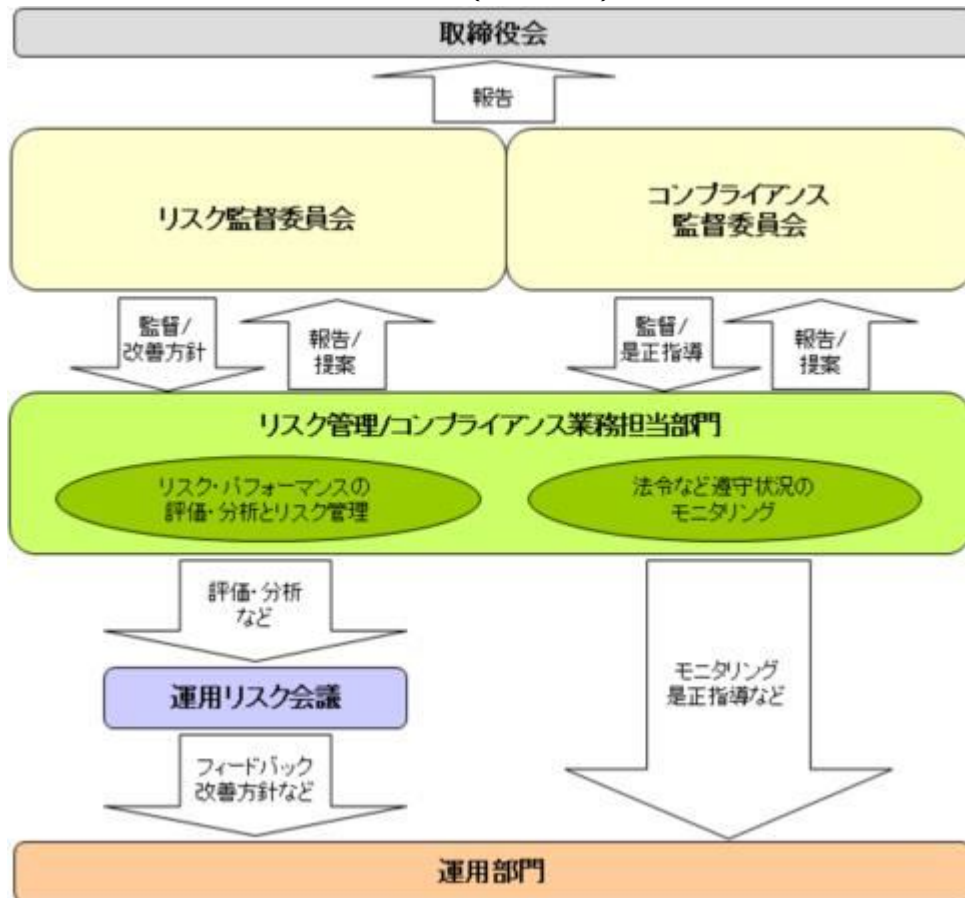
響を及ぼす可能性があります。

- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

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

（２）リスク管理体制

<日興アセットマネジメント株式会社（委託会社）におけるリスク管理体制>



全社的リスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別会議においては、法令遵守状況や各種リスク（運用リスク（流動性リスクを含む）、市場リスク、カウンターパーティーリスク、オペレーショナルリスク（事務リスクを含む）など）に関するモニタリングとその報告に加えて、重要事故への対応と各種リスク対応、事故防止のための施策やその管理手法の構築などの支援に努めております。

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

ファンド財産について運用状況の評価・分析および運用リスク（流動性リスクを含む）の管理状況をモニタリングします。運用パフォーマンスおよび運用リスクに係る評価と分析の結果については運用リスク会議に報告し、運用リスク（流動性リスクを含む）の管理状況についてはリスク監督委員会へ報告され、問題点の原因の究明や改善策の策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2023年7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

本書提出日現在、取得申込みの受付は行なっておりません。

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬

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

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

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

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

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

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

*2 この他に、実質的に不動産投信や上場投資信託証券などに投資する場合には、運用などに係る費用がかかりますが、投資する銘柄は固定されていないため、事前に料率、上限額などを表示することができません。

信託報酬の配分

当ファンドの信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.83%	0.40%	0.40%	0.03%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

支払時期

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

ときに、信託財産から支払います。

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

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

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

格付の取得に要する費用。

ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

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

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

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料。

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

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

< 投資対象とする投資信託証券に係る費用 >

「円キャッシュ・アルファ・マスターファンド（適格機関投資家向け）」

「FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」

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

用を含みます。)、監査費用などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。

- ・組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税などについては、その都度、信託財産から支払われます。
- 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

「インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）」

「インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）」

「インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）」

- ・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、「各信託約款に定めるベンチマーク指数」その他これに類する標章の使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。
 - ・組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税などについては、その都度、信託財産から支払われます。
- 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

「インデックス マザーファンド TOPIX」

「ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド」

「インデックス マザーファンド リート」

「インデックス マザーファンド 海外先進国債券」

「先進国資本エマージング株式マザーファンド」

「インデックス マザーファンド コモディティ」

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

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

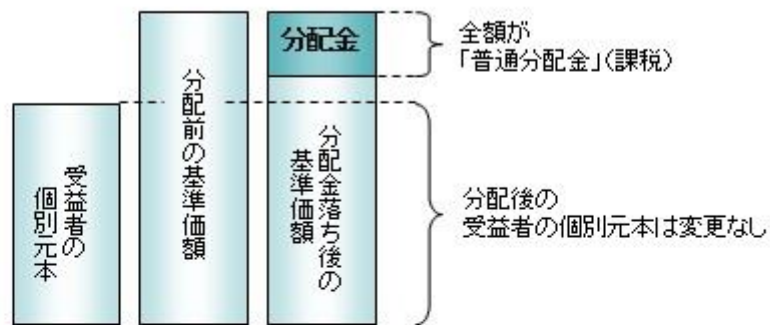
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

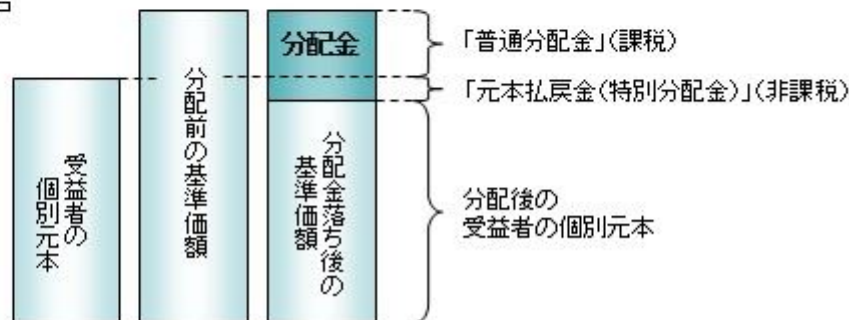
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<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10月18日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【時間分散型バランスファンド（安定指向）2016 - 11】

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	23,659,485	23.00
親投資信託受益証券	日本	76,851,272	74.72
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		2,343,217	2.28
合計(純資産総額)		102,853,974	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

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

日本	親投資信託受益証券	ソブリン(円ヘッジ)マザーファンド	34,897,823	1.0974	38,296,870	1.0957	38,237,544	37.18
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	5,251,498	3.0968	16,262,840	3.1938	16,772,234	16.31
日本	投資信託受益証券	インデックスファンド海外先進国株式(適格機関投資家向け)	4,595,864	2.7489	12,633,570	2.8218	12,968,609	12.61
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド 海外先進国債券	7,897,364	1.2536	9,900,136	1.2576	9,931,724	9.66
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド J リート	6,371,817	1.3944	8,884,862	1.4114	8,993,182	8.74
日本	投資信託受益証券	F O F s 用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	4,099,033	1.2838	5,262,338	1.2839	5,262,748	5.12
日本	投資信託受益証券	インデックスファンド海外先進国リート(適格機関投資家向け)	2,666,947	1.5871	4,232,711	1.5988	4,263,914	4.15
日本	親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド コモディティ	1,123,019	1.3305	1,494,177	1.3853	1,555,718	1.51
日本	親投資信託受益証券	先進国資本エマージング株式マザーファンド	862,621	1.5241	1,314,721	1.5776	1,360,870	1.32
日本	投資信託受益証券	インデックスファンド海外新興国債券(適格機関投資家向け)	837,263	1.3694	1,146,547	1.3905	1,164,214	1.13

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	23.00
親投資信託受益証券	74.72
合計	97.72

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2017年 7月18日)	1,070	1,070	1.0159	1.0159
第2計算期間末 (2018年 7月17日)	242	242	1.0570	1.0570
第3計算期間末 (2019年 7月17日)	178	178	1.0751	1.0751
第4計算期間末 (2020年 7月17日)	132	132	1.0873	1.0873
第5計算期間末 (2021年 7月19日)	123	123	1.2381	1.2381
第6計算期間末 (2022年 7月19日)	109	109	1.2050	1.2050
第7計算期間末 (2023年 7月18日)	102	102	1.2316	1.2316

2022年 7月末日	112		1.2318
8月末日	110		1.2114
9月末日	102		1.1596
10月末日	105		1.1970
11月末日	105		1.2034
12月末日	101		1.1557
2023年 1月末日	103		1.1829
2月末日	102		1.1758
3月末日	103		1.1878
4月末日	105		1.2009
5月末日	101		1.2139
6月末日	103		1.2424
7月末日	102		1.2443

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2016年11月21日～2017年 7月18日	0.0000
第2期	2017年 7月19日～2018年 7月17日	0.0000
第3期	2018年 7月18日～2019年 7月17日	0.0000
第4期	2019年 7月18日～2020年 7月17日	0.0000
第5期	2020年 7月18日～2021年 7月19日	0.0000
第6期	2021年 7月20日～2022年 7月19日	0.0000
第7期	2022年 7月20日～2023年 7月18日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2016年11月21日～2017年 7月18日	1.59
第2期	2017年 7月19日～2018年 7月17日	4.05
第3期	2018年 7月18日～2019年 7月17日	1.71
第4期	2019年 7月18日～2020年 7月17日	1.13
第5期	2020年 7月18日～2021年 7月19日	13.87
第6期	2021年 7月20日～2022年 7月19日	2.67
第7期	2022年 7月20日～2023年 7月18日	2.21

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2016年11月21日～2017年7月18日	1,371,718,426	318,353,054
第2期	2017年7月19日～2018年7月17日	0	823,765,086
第3期	2018年7月18日～2019年7月17日	0	63,196,318
第4期	2019年7月18日～2020年7月17日	0	44,886,784
第5期	2020年7月18日～2021年7月19日	0	21,709,005
第6期	2021年7月20日～2022年7月19日	0	8,764,072
第7期	2022年7月20日～2023年7月18日	0	7,455,393

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考)

インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）

以下の運用状況は2023年7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	64,644,033	99.02
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		641,568	0.98
合計（純資産総額）		65,285,601	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	12,620,365	5.1094	64,482,492	5.1222	64,644,033	99.02

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.02
合計	99.02

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

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

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	215,016,074,401	68.97
	カナダ	10,546,171,791	3.38
	ドイツ	7,745,553,036	2.48
	イタリア	1,678,007,039	0.54
	フランス	10,022,864,750	3.21
	オランダ	6,086,491,224	1.95
	スペイン	2,252,195,078	0.72
	ベルギー	669,723,500	0.21
	オーストリア	155,525,173	0.05
	ルクセンブルク	172,564,893	0.06
	フィンランド	968,685,919	0.31
	アイルランド	5,859,925,839	1.88
	ポルトガル	158,981,021	0.05
	イギリス	12,513,842,448	4.01
	スイス	10,062,247,537	3.23
	スウェーデン	2,690,812,567	0.86
	ノルウェー	584,838,205	0.19
	デンマーク	2,632,399,825	0.84
	ケイマン	530,214,920	0.17
	オーストラリア	6,008,118,492	1.93
	バミューダ	264,314,282	0.08
	ニュージーランド	238,984,033	0.08
	香港	1,791,165,829	0.57
	シンガポール	1,008,441,381	0.32
	イスラエル	650,281,629	0.21
	ジャージー	911,436,351	0.29
アラブ首長国連邦	0	0.00	
マン島	61,713,458	0.02	
小計		301,281,574,621	96.64
投資証券	アメリカ	5,361,820,917	1.72

	カナダ	15,188,329	0.00
	フランス	113,685,484	0.04
	ベルギー	32,639,252	0.01
	イギリス	111,164,534	0.04
	オーストラリア	372,838,313	0.12
	香港	83,049,684	0.03
	シンガポール	132,559,713	0.04
	小計	6,222,946,226	2.00
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		4,268,124,261	1.37
合計（純資産総額）		311,772,645,108	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	3,896,269,830	1.25
	買建	ドイツ	755,933,100	0.24

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		3,516,480,105	1.13

(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	628,384	21,557.47	13,546,372,591	27,606.15	17,347,266,166	5.56
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	281,014	35,666.27	10,022,722,227	47,700.01	13,404,373,111	4.30
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	366,610	16,779.54	6,151,548,375	18,637.64	6,832,746,557	2.19
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	98,080	20,395.90	2,000,430,419	65,903.47	6,463,812,828	2.07
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	236,440	14,731.41	3,483,095,326	18,689.80	4,419,016,927	1.42
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	113,275	30,769.81	3,485,450,316	37,560.04	4,254,614,301	1.36
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	87,920	19,917.99	1,751,190,307	45,882.91	4,034,025,940	1.29

アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	213,210	14,799.21	3,155,340,966	18,750.41	3,997,776,984	1.28
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サービス	37,110	75,663.23	2,807,862,552	70,895.22	2,630,921,714	0.84
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	116,320	17,470.57	2,032,177,369	22,119.60	2,572,952,186	0.83
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	51,655	41,204.45	2,128,415,889	49,312.71	2,547,248,329	0.82
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	103,401	24,019.33	2,483,623,613	24,596.44	2,543,297,071	0.82
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	160,811	14,952.83	2,404,581,055	14,683.43	2,361,257,898	0.76
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	64,652	27,778.71	1,795,949,352	33,233.67	2,148,623,718	0.69
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	16,575	67,997.35	1,127,056,131	126,843.39	2,102,429,294	0.67
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	32,144	49,983.63	1,606,674,040	64,631.92	2,077,528,616	0.67
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	93,869	18,644.91	1,750,179,164	22,049.11	2,069,728,629	0.66
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	109,460	17,537.11	1,919,612,293	17,392.31	1,903,763,347	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	40,295	41,120.90	1,656,966,904	46,713.22	1,882,309,558	0.60
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	33,865	44,577.15	1,509,605,269	55,395.57	1,875,971,019	0.60
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	15,982	78,556.65	1,255,492,525	101,443.54	1,621,270,816	0.52
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	71,351	24,605.78	1,755,647,299	22,395.90	1,597,970,139	0.51
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	101,043	13,936.50	1,408,186,143	14,990.74	1,514,710,332	0.49
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	69,956	21,122.71	1,477,660,899	21,265.32	1,487,637,041	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	54,611	25,190.52	1,375,679,666	26,828.00	1,465,103,946	0.47
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	65,935	17,175.00	1,132,434,261	22,034.28	1,452,830,252	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	163,632	8,344.75	1,365,469,588	8,807.80	1,441,238,846	0.46
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	耐久消費財・アパレル	10,949	104,054.25	1,139,290,090	130,680.42	1,430,819,919	0.46
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	17,624	70,483.41	1,242,199,739	79,411.22	1,399,543,348	0.45
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	18,184	46,013.54	836,710,306	74,554.80	1,355,704,554	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	4.82
		素材	4.09
		資本財	6.57
		商業・専門サービス	1.51
		運輸	1.90
		自動車・自動車部品	2.26
		耐久消費財・アパレル	1.65
		消費者サービス	2.13
		メディア・娯楽	5.95
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.33
		生活必需品流通・小売り	1.72
		食品・飲料・タバコ	3.92
		家庭用品・パーソナル用品	1.68
		ヘルスケア機器・サービス	4.48
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.18
		銀行	5.42
		金融サービス	6.46
		保険	2.97
		ソフトウェア・サービス	9.22
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.92
電気通信サービス	1.15		
公益事業	2.80		
半導体・半導体製造装置	6.16		
不動産管理・開発	0.35		
投資証券			2.00
合計			98.63

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	120	米ドル	26,668,492.5	3,759,457,388	27,639,000	3,896,269,830	1.25
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2309	買建	120	ユーロ	4,775,350	741,850,622	4,866,000	755,933,100	0.24

(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	21,100,000.00	2,935,568,600	2,952,416,540	0.95
	ユーロ	買建	3,650,000.00	562,276,420	564,063,565	0.18

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

インデックスファンド海外先進国リート(適格機関投資家向け)

以下の運用状況は2023年7月31日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	21,429,059	99.07
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		201,648	0.93
合計(純資産総額)		21,630,707	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド	7,247,382	2.9348	21,269,616	2.9568	21,429,059	99.07

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.07
合計	99.07

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 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	44,694,463,905	77.32
	カナダ	964,703,696	1.67
	ドイツ	24,424,624	0.04
	イタリア	7,805,556	0.01
	フランス	999,328,242	1.73
	オランダ	110,907,520	0.19
	スペイン	240,545,130	0.42
	ベルギー	602,801,951	1.04
	アイルランド	20,195,708	0.03
	イギリス	2,634,619,510	4.56
	オーストラリア	3,805,981,785	6.58
	ニュージーランド	168,972,786	0.29
	香港	767,012,672	1.33
	シンガポール	2,145,600,857	3.71
	韓国	129,993,188	0.22
	イスラエル	67,352,681	0.12
ガーンジー	120,822,788	0.21	
	小計	57,505,532,599	99.49
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		297,442,959	0.51
合計（純資産総額）		57,802,975,558	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		14,493,808	0.03
	売建		21,142,215	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）	投資比率（％）
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	287,718	17,245.29	4,961,782,776	17,430.94	5,015,195,339	8.68
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	29,145	109,568.13	3,193,363,306	112,403.83	3,276,009,894	5.67

アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	49,316	40,081.70	1,976,669,369	39,687.28	1,957,218,103	3.39
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	209,922	8,634.47	1,812,566,805	8,665.42	1,819,063,536	3.15
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	101,909	15,709.77	1,600,967,765	17,547.94	1,788,293,588	3.09
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	154,887	11,490.78	1,779,772,550	11,419.97	1,768,806,396	3.06
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	90,795	14,948.32	1,357,233,542	17,308.29	1,571,506,790	2.72
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	312,793	4,566.59	1,428,397,630	4,481.43	1,401,761,905	2.43
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	65,819	20,208.78	1,330,121,785	19,854.21	1,306,784,564	2.26
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	44,271	26,846.28	1,188,511,735	26,238.74	1,161,615,529	2.01
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	533,346	1,852.57	988,063,052	1,926.17	1,027,320,398	1.78
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	106,335	9,369.28	996,282,703	9,136.26	971,504,813	1.68
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	181,212	4,808.34	871,329,674	5,000.20	906,097,312	1.57
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	49,050	17,183.15	842,833,622	17,834.11	874,763,326	1.51
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	124,684	6,549.74	816,648,792	6,784.88	845,966,739	1.46
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	90,874	8,027.37	729,479,296	8,537.14	775,804,351	1.34
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	36,368	21,626.25	786,503,747	20,967.87	762,559,780	1.32
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	38,774	18,885.05	732,249,045	18,537.55	718,775,158	1.24
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	20,020	32,963.83	659,935,914	33,453.59	669,740,886	1.16
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	66,766	9,865.50	658,680,097	9,604.28	641,239,766	1.11
香港	投資証券	LINK REIT	796,980	843.10	671,937,568	797.32	635,454,469	1.10
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	221,622	2,461.40	545,501,825	2,562.83	567,980,530	0.98
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	192,984	2,730.10	526,866,454	2,844.77	548,995,981	0.95
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	81,940	7,061.06	578,584,011	6,690.43	548,214,342	0.95
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	54,624	9,554.29	521,893,692	10,035.65	548,187,581	0.95
アメリカ	投資証券	UDR INC	96,557	6,077.06	586,783,062	5,672.63	547,732,405	0.95
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	170,796	2,923.69	499,354,599	3,063.27	523,195,646	0.91
イギリス	投資証券	SEGO PLC	381,210	1,371.00	522,642,379	1,366.61	520,965,551	0.90
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	97,957	4,920.52	482,000,267	5,214.48	510,794,847	0.88
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	33,282	15,757.02	524,425,331	15,296.65	509,103,262	0.88

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.49
合計	99.49

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	英ポンド	買建	80,000.00	14,488,560	14,493,808	0.03
	米ドル	売建	150,000.00	21,138,285	21,142,215	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。

インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	5,903,979	99.01
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		58,858	0.99
合計（純資産総額）		5,962,837	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド	3,639,938	1.5970	5,812,981	1.6220	5,903,979	99.01

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.01
合計	99.01

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	メキシコ	1,073,318,376	9.80
	ブラジル	1,078,346,967	9.84
	チリ	242,182,890	2.21
	コロンビア	495,664,906	4.52
	ペルー	263,448,375	2.40
	ウルグアイ	20,803,378	0.19
	ドミニカ共和国	24,911,202	0.23
	トルコ	82,155,773	0.75
	チェコ	581,072,333	5.30
	ハンガリー	314,325,523	2.87
	ポーランド	806,679,792	7.36
	ロシア	0	0.00
	ルーマニア	396,741,507	3.62
	マレーシア	1,078,012,017	9.84
	タイ	1,089,452,532	9.94
	インドネシア	1,047,412,527	9.56
	中国	1,070,726,608	9.77
	エジプト	74,136,838	0.68
	南アフリカ	945,849,186	8.63
セルビア	32,358,595	0.30	
	小計	10,717,599,325	97.81
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		240,099,595	2.19
合計（純資産総額）		10,957,698,920	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		698,745	0.01
	売建		700,759	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（％）	償還期限	投資比率（％）
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	8,600,000	2,224.28	191,288,347	2,240.63	192,694,974		2026/7/1	1.76
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	7,000,000	2,248.41	157,389,155	2,351.77	164,624,161		2026/1/1	1.50

南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	19,300,000	827.35	159,679,110	838.16	161,766,293	10.500	2026/12/21	1.48
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	5,040,000	2,913.06	146,818,492	2,950.23	148,692,006	10.000	2025/1/1	1.36
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	18,630,000	698.59	130,148,090	719.46	134,036,450	8.000	2030/1/31	1.22
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	5,400,000	2,384.58	128,767,625	2,467.96	133,270,189		2025/7/1	1.22
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	4,500,000	2,877.02	129,466,215	2,952.47	132,861,542	10.000	2027/1/1	1.21
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	4,090,000	2,816.87	115,210,081	2,902.52	118,713,471	10.000	2029/1/1	1.08
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,400,000	766.85	118,095,770	770.18	118,609,145	5.750	2026/3/5	1.08
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,550,000	797.48	116,034,450	790.96	115,085,887	7.750	2031/5/29	1.05
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	18,950,000	579.99	109,908,136	593.38	112,445,836	8.750	2048/2/28	1.03
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	15,150,000	661.79	100,261,679	686.46	104,000,194	8.250	2032/3/31	0.95
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,600,000	649.53	94,832,308	668.32	97,575,358	8.875	2035/2/28	0.89
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	12,130,000	803.56	97,471,975	796.33	96,595,848	7.500	2027/6/3	0.88
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	3,450,000	2,611.41	90,093,914	2,698.85	93,110,446		2024/7/1	0.85
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,260,000	835.51	85,723,687	829.90	85,148,439	8.500	2029/5/31	0.78
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,410,000	605.10	81,144,778	623.54	83,617,613	8.500	2037/1/31	0.76
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000	814.91	81,491,616	820.48	82,048,484	8.000	2024/9/5	0.75
マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	2,730,000	3,031.43	82,758,261	2,972.23	81,142,021	3.757	2040/5/22	0.74
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,610,000	836.83	80,419,735	839.71	80,696,852	10.000	2024/12/5	0.74
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000	2,004.85	80,194,332	2,010.61	80,424,792	3.020	2025/10/22	0.73
マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	2,520,000	3,148.64	79,345,909	3,134.46	78,988,640	3.955	2025/9/15	0.72
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000	1,958.67	78,347,087	1,970.41	78,816,714	2.690	2032/8/15	0.72
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,500,000	747.85	78,524,642	745.23	78,249,317	5.500	2027/3/4	0.71
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,360,000	3,184.67	75,158,358	3,252.50	76,759,152	2.500	2026/7/25	0.70
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,440,000	2,954.49	72,089,556	3,054.93	74,540,348	2.750	2029/10/25	0.68
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,730,000	585.73	68,706,265	597.52	70,090,205	8.750	2044/1/31	0.64
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,080,000	765.53	69,510,606	766.77	69,623,204	8.000	2047/11/7	0.64
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,160,000	749.95	68,695,900	751.64	68,850,708	7.750	2042/11/13	0.63
インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	6,300,000,000	1.06	67,362,750	1.08	68,043,780	8.375	2034/3/15	0.62

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.81

合 計	97.81
-----	-------

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	買建	4,957.47	692,267	698,745	0.01
	ルーマニアレイ	売建	22,265.00	692,267	700,759	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。

FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	4,194,181,446	100.25
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		10,339,417	0.25
合計（純資産総額）		4,183,842,029	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建		4,151,918,765	99.24

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・マザーファンド	2,410,726,202	1.7278	4,165,334,025	1.7398	4,194,181,446	100.25

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.25
合 計	100.25

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	29,586,000.00	4,120,883,051	4,151,918,765	99.24

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

ゴールド・マザーファンド

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	190,174,192,201	100.01
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		16,174,853	0.01
合計(純資産総額)		190,158,017,348	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		90,206,784	0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR GOLD MINISHARES TRUST-ETF	15,400,000	5,105.69	78,627,634,426	5,480.91	84,406,069,440	44.39
アメリカ	投資信託受益証券	i シェアーズ ゴールド・トラスト	14,925,000	4,846.54	72,334,737,855	5,232.80	78,099,635,520	41.07

アメリカ	投資信託受益証券	SPDR GOLD TRUST-ETF	568,100	25,129.43	14,276,030,067	25,636.80	14,564,268,466	7.66
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST MICRO-ETF	4,750,000	2,554.37	12,133,287,900	2,758.78	13,104,218,775	6.89

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	100.01
合 計	100.01

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	640,000.00	90,202,880	90,206,784	0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

インデックス マザーファンド T O P I X

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	51,935,005,710	99.79
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		110,298,033	0.21
合計(純資産総額)		52,045,303,743	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	116,350,000	0.22

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

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	863,400	1,881.01	1,624,068,548	2,386.00	2,060,072,400	3.96
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	111,200	11,734.42	1,304,868,204	13,315.00	1,480,628,000	2.84
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	969,900	966.93	937,832,780	1,146.00	1,111,505,400	2.14
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,700	59,510.43	934,313,761	63,760.00	1,001,032,000	1.92
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	5,052,100	154.55	780,814,684	162.90	822,987,090	1.58
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	110,100	5,774.45	635,766,945	6,694.00	737,009,400	1.42
日本	株式	三菱商事	卸売業	101,400	4,653.77	471,892,916	7,265.00	736,671,000	1.42
日本	株式	日立製作所	電気機器	77,200	7,013.71	541,459,144	9,298.00	717,805,600	1.38
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	33,300	15,447.71	514,408,849	21,245.00	707,458,500	1.36
日本	株式	三井物産	卸売業	118,100	3,966.05	468,391,617	5,541.00	654,392,100	1.26
日本	株式	任天堂	その他製品	99,300	5,239.72	520,304,466	6,450.00	640,485,000	1.23
日本	株式	信越化学工業	化学	130,900	3,860.92	505,394,939	4,679.00	612,481,100	1.18
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	139,600	4,180.79	583,639,206	4,341.00	606,003,600	1.16
日本	株式	第一三共	医薬品	137,400	4,178.64	574,145,748	4,347.00	597,277,800	1.15
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	119,700	4,375.20	523,712,410	4,933.00	590,480,100	1.13
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	102,500	4,159.28	426,326,925	5,750.00	589,375,000	1.13
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	127,800	3,333.21	425,984,450	4,513.00	576,761,400	1.11
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	77,800	5,820.31	452,820,181	7,242.00	563,427,600	1.08
日本	株式	HOYA	精密機器	33,300	13,736.87	457,438,002	16,530.00	550,449,000	1.06
日本	株式	ダイキン工業	機械	19,000	23,028.41	437,539,950	28,690.00	545,110,000	1.05
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	224,000	2,107.48	472,076,584	2,404.00	538,496,000	1.03
日本	株式	KDDI	情報・通信業	121,900	3,995.56	487,059,322	4,187.00	510,395,300	0.98
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	153,100	2,690.79	411,960,849	3,259.00	498,952,900	0.96
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	85,600	4,295.75	367,716,796	5,450.00	466,520,000	0.90
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	253,500	1,526.23	386,901,678	1,578.00	400,023,000	0.77
日本	株式	村田製作所	電気機器	47,700	7,514.23	358,429,001	8,325.00	397,102,500	0.76
日本	株式	S M C	機械	5,100	67,749.71	345,523,521	74,150.00	378,165,000	0.73
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	57,300	6,040.94	346,146,290	5,893.00	337,668,900	0.65
日本	株式	三菱電機	電気機器	164,200	1,524.59	250,338,845	2,051.00	336,774,200	0.65
日本	株式	ファナック	電気機器	76,700	4,539.20	348,157,363	4,348.00	333,491,600	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	0.33
		建設業	2.04
		食料品	3.25

繊維製品	0.43
パルプ・紙	0.17
化学	5.97
医薬品	4.94
石油・石炭製品	0.43
ゴム製品	0.70
ガラス・土石製品	0.67
鉄鋼	0.94
非鉄金属	0.68
金属製品	0.52
機械	5.51
電気機器	17.97
輸送用機器	8.07
精密機器	2.52
その他製品	2.29
電気・ガス業	1.30
陸運業	2.90
海運業	0.59
空運業	0.51
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	8.08
卸売業	6.94
小売業	4.34
銀行業	6.55
証券、商品先物取引業	0.74
保険業	2.30
その他金融業	1.16
不動産業	1.81
サービス業	4.91
合 計	99.79

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	5	日本円	112,212,750	116,350,000	0.22

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

ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	ベルギー	15,883,422,467	44.19
	スウェーデン	392,678,292	1.09
	小計	16,276,100,759	45.28
地方債証券	オーストラリア	4,119,604,423	11.46
特殊債券	カナダ	3,376,742,627	9.39
	ドイツ	784,729,293	2.18
	オランダ	239,390,893	0.67
	ノルウェー	2,280,276,648	6.34
	国際機関	8,014,242,139	22.30
小計	14,695,381,600	40.88	
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		854,745,635	2.38
合計（純資産総額）		35,945,832,417	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		36,286,369,464	100.95

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（％）	償還期限	投資比率（％）
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	38,600,000	15,531.01	5,994,971,102	15,259.06	5,889,999,989	3.000	2034/6/22	16.39
国際機関	特殊債券	EUROFIMA	58,560,000	8,756.11	5,127,581,008	8,653.82	5,067,680,796	3.350	2029/5/21	14.10
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	36,000,000	13,347.37	4,805,056,127	13,239.89	4,766,360,461	1.250	2033/4/22	13.26
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	18,600,000	15,497.35	2,882,507,132	15,357.58	2,856,510,206	3.000	2033/6/22	7.95
ノルウェー	特殊債券	KOMMUNALBANKEN AS	27,990,000	8,212.38	2,298,647,623	8,146.75	2,280,276,648	2.400	2029/11/21	6.34
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	16,100,000	12,376.73	1,992,654,255	12,299.52	1,980,223,614	0.350	2032/6/22	5.51
国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK	129,000,000	1,405.16	1,812,666,204	1,361.52	1,756,371,198	3.750	2032/6/1	4.89
カナダ	特殊債券	CANADA HOUSING TRUST	19,400,000	8,907.03	1,727,965,449	8,614.50	1,671,214,492	1.100	2031/3/15	4.65

国際機関	特殊債券	NORDIC INVESTMENT BANK	92,500,000	1,318.06	1,219,209,015	1,286.69	1,190,190,145	2.940	2031/10/17	3.31
カナダ	特殊債券	CANADA HOUSING TRUST	10,000,000	9,171.05	917,105,935	8,836.53	883,653,498	1.600	2031/12/15	2.46
カナダ	特殊債券	CANADA HOUSING TRUST	8,000,000	10,704.85	856,388,348	10,273.43	821,874,637	3.550	2032/9/15	2.29
オーストラリア	地方債証券	NEW S WALES TREASURY CRP	11,000,000	7,493.35	824,268,739	7,417.47	815,922,403	2.000	2033/3/8	2.27
オーストラリア	地方債証券	TREASURY CORP VICTORIA	9,000,000	9,296.82	836,714,084	9,043.28	813,895,503	4.250	2032/12/20	2.26
ドイツ	特殊債券	LANDWIRTSCH. RENTENBANK	10,000,000	7,912.31	791,231,597	7,847.29	784,729,293	1.900	2030/1/30	2.18
オーストラリア	地方債証券	WESTERN AUST TREAS CORP	10,000,000	7,743.67	774,367,939	7,649.05	764,905,077	1.750	2031/10/22	2.13
オーストラリア	地方債証券	QUEENSLAND TREASURY CORP	7,700,000	7,516.20	578,747,774	7,374.59	567,843,780	2.000	2033/8/22	1.58
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	3,580,000	11,013.95	394,299,738	10,903.02	390,328,197	1.600	2047/6/22	1.09
オーストラリア	地方債証券	NEW S WALES TREASURY CRP	6,000,000	6,198.91	371,935,022	6,132.30	367,938,454	2.250	2041/5/7	1.02
スウェーデン	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	29,000,000	1,247.95	361,906,254	1,251.30	362,878,892	1.750	2033/11/11	1.01
オーストラリア	地方債証券	NEW S WALES TREASURY CRP	4,740,000	7,427.27	352,052,824	7,321.97	347,061,391	1.500	2032/2/20	0.97
オーストラリア	地方債証券	TREASURY CORP VICTORIA	4,300,000	7,544.04	324,394,081	7,430.11	319,495,136	1.500	2031/9/10	0.89
オランダ	特殊債券	NEDER WATERSCHAPSBANK	2,750,000	8,783.38	241,542,972	8,705.12	239,390,893	3.300	2029/5/2	0.67
オーストラリア	地方債証券	QUEENSLAND TREASURY CORP	2,000,000	6,344.06	126,881,216	6,127.13	122,542,679	2.250	2041/11/20	0.34
スウェーデン	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	2,000,000	1,500.29	30,005,987	1,489.97	29,799,400	3.500	2039/3/30	0.08

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	45.28
地方債証券	11.46
特殊債券	40.88
合計	97.62

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	加ドル	売建	31,511,026.71	3,363,949,694	3,316,461,427	9.23
	ユーロ	売建	110,542,448.69	17,097,542,969	17,062,658,295	47.47
	スウェーデンクローナ	売建	261,293,211.11	3,423,022,408	3,459,808,895	9.63
	豪ドル	売建	133,411,464.00	12,400,259,649	12,447,440,847	34.63

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

インデックス マザーファンド リート

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	44,994,526,950	97.78
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,022,762,063	2.22
合計（純資産総額）		46,017,289,013	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	1,021,746,000	2.22

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

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	4,946	564,207.96	2,790,572,570	596,000	2,947,816,000	6.41
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	4,355	541,183.33	2,356,853,425	572,000	2,491,060,000	5.41
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	13,709	161,507.87	2,214,111,389	169,200	2,319,562,800	5.04
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	7,385	297,079.55	2,193,932,510	290,700	2,146,819,500	4.67
日本	投資証券	G L P 投資法人 投資証券	14,319	145,569.61	2,084,411,249	140,100	2,006,091,900	4.36
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	20,320	97,395.16	1,979,069,651	97,500	1,981,200,000	4.31
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	6,390	287,264.52	1,835,620,282	280,000	1,789,200,000	3.89
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	8,447	180,496.59	1,524,654,695	180,900	1,528,062,300	3.32
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	9,483	147,321.17	1,397,046,655	153,500	1,455,640,500	3.16
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	4,027	359,455.19	1,447,526,050	346,500	1,395,355,500	3.03
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	20,524	56,892.74	1,167,666,640	58,900	1,208,863,600	2.63
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	12,738	79,828.55	1,016,856,069	84,400	1,075,087,200	2.34

日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,899	352,013.44	1,020,486,962	354,000	1,026,246,000	2.23
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	1,464	663,000	970,632,000	674,000	986,736,000	2.14
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法 人 投資証券	13,671	72,596.98	992,473,313	70,600	965,172,600	2.10
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	6,468	156,877.07	1,014,680,888	148,800	962,438,400	2.09
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	2,224	406,046.51	903,047,438	414,000	920,736,000	2.00
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投 資法人 投資証券	1,675	513,974.92	860,908,000	506,000	847,550,000	1.84
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	2,467	324,560.17	800,689,939	338,000	833,846,000	1.81
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資 証券	5,419	161,220.25	873,652,534	152,100	824,229,900	1.79
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法 人 投資証券	2,715	319,937.06	868,629,117	300,500	815,857,500	1.77
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	5,200	155,639.14	809,323,532	149,700	778,440,000	1.69
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資 証券	1,573	489,435.51	769,882,057	472,500	743,242,500	1.62
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,985	151,083.68	753,152,144	144,700	721,329,500	1.57
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネ クスト投資法人 投資証券	3,112	215,836.52	671,683,255	222,500	692,420,000	1.50
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	2,030	350,500.67	711,516,362	340,500	691,215,000	1.50
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証 券	5,881	113,907.73	669,891,400	113,900	669,845,900	1.46
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資 証券	3,966	156,034.7	618,833,620	165,000	654,390,000	1.42
日本	投資証券	森トラストリート投資法人 投資証 券	8,171	70,879.32	579,154,960	73,300	598,934,300	1.30
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人 投資 証券	1,464	423,362.36	619,802,500	407,000	595,848,000	1.29

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.78
合計	97.78

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証REIT指数先物 2023年09月	買建	548	日本円	1,014,681,920	1,021,746,000	2.22

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

インデックス マザーファンド 海外先進国債券

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	27,869,044	48.24
	カナダ	1,098,331	1.90
	メキシコ	498,925	0.86
	ドイツ	3,682,481	6.37
	イタリア	4,330,261	7.49
	フランス	4,704,946	8.14
	オランダ	942,593	1.63
	スペイン	2,892,729	5.01
	ベルギー	1,108,347	1.92
	オーストリア	660,490	1.14
	フィンランド	255,989	0.44
	アイルランド	259,511	0.45
	イギリス	2,768,674	4.79
	スウェーデン	125,864	0.22
	ノルウェー	101,902	0.18
	デンマーク	202,657	0.35
	ポーランド	292,725	0.51
	オーストラリア	845,853	1.46
	シンガポール	212,467	0.37
	マレーシア	277,704	0.48
中国	3,387,574	5.86	
イスラエル	353,422	0.61	
	小計	56,872,489	98.43
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		904,415	1.57
合計（純資産総額）		57,776,904	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		451,614	0.78

(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	42,000	13,207.67	5,547,224	13,115.43	5,508,484	2.375	2027/5/15	9.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,000	13,670.39	4,921,343	13,668.72	4,920,740	2.375	2024/8/15	8.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	31,000	12,789.44	3,964,729	12,745.66	3,951,157	0.250	2025/10/31	6.84
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	31,000	12,383.88	3,839,003	12,273.47	3,804,776	1.250	2028/5/31	6.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,000	14,971.71	2,096,040	14,723.92	2,061,349	4.375	2038/2/15	3.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,000	12,143.78	1,821,568	12,011.63	1,801,745	1.500	2030/2/15	3.12
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,000	11,671.04	1,633,946	11,518.23	1,612,553	1.375	2031/11/15	2.79
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	9,000	16,827.72	1,514,495	16,943.92	1,524,953	5.250	2029/11/1	2.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	19,000	8,065.57	1,532,459	7,910.01	1,502,902	1.375	2050/8/15	2.60
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,000	16,938.30	1,185,681	16,972.41	1,188,069	5.150	2028/10/31	2.06
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	6,000	17,983.68	1,079,021	17,947.56	1,076,854	4.750	2035/4/25	1.86
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	6,000	18,036.53	1,082,192	17,947.01	1,076,821	4.500	2041/4/25	1.86
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	6,000	17,626.23	1,057,574	17,656.63	1,059,398	5.500	2029/4/25	1.83
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	50,000	2,026.21	1,013,106	2,024.45	1,012,228	3.010	2028/5/13	1.75
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	50,000	1,981.94	990,970	1,981.74	990,874	2.760	2032/5/15	1.72
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000	10,742.35	966,812	10,535.84	948,226	2.500	2046/2/15	1.64
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000	17,632.56	881,628	17,609.98	880,499	4.900	2040/7/30	1.52
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	40,000	1,979.61	791,846	1,979.36	791,747	2.680	2030/5/21	1.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000	11,513.00	805,910	11,283.10	789,817	2.875	2049/5/15	1.37
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000	14,957.10	747,855	15,006.10	750,305	2.000	2025/12/1	1.30
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000	18,716.05	748,642	18,724.60	748,984	5.500	2031/1/4	1.30
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5,000	14,761.26	738,063	14,796.28	739,814	0.500	2025/5/25	1.28
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000	18,046.65	721,866	18,000.20	720,008	4.000	2037/1/4	1.25
イギリス	国債証券	UK TREASURY	4,000	17,316.92	692,677	17,568.25	702,730	4.250	2040/12/7	1.22
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,000	16,198.92	647,957	16,292.10	651,684	4.750	2044/9/1	1.13
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	5,000	12,216.13	610,806	12,239.70	611,985	0.000	2031/11/25	1.06
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,000	14,296.70	571,868	14,380.05	575,202	3.350	2035/3/1	1.00
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000	11,569.44	578,472	11,349.18	567,459	2.750	2042/8/15	0.98
イギリス	国債証券	UK TREASURY	3,000	18,496.10	554,883	18,660.93	559,828	4.750	2030/12/7	0.97
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,000	13,922.00	556,880	13,995.25	559,810	0.950	2027/9/15	0.97

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.43
合計	98.43

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	売建	1,000.00	139,400	140,948	0.24
	ユーロ	売建	2,000.00	306,139	310,666	0.54

(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。

先進国資本エマージング株式マザーファンド

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	メキシコ	284,854,213	3.09
	ブラジル	1,179,479,775	12.78
	チリ	630,241,569	6.83
	ギリシャ	197,665,764	2.14
	トルコ	146,710,916	1.59
	チェコ	215,666,569	2.34
	ポーランド	184,949,271	2.00
	ケイマン	249,088,522	2.70
	香港	52,397,286	0.57
	マレーシア	239,126,659	2.59
	タイ	175,390,345	1.90
	フィリピン	123,140,995	1.33
	インドネシア	591,047,489	6.41
	韓国	218,369,437	2.37
	台湾	80,669,050	0.87
	中国	1,251,300,061	13.56
	インド	2,398,491,514	26.00
	エジプト	35,169,621	0.38
	南アフリカ	698,275,899	7.57
	サウジアラビア	140,012,681	1.52
	小計	9,092,047,636	98.54
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		134,629,052	1.46
合計（純資産総額）		9,226,676,688	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		113,669,385	1.23

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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 (%)
ブラジル	株式	TELEFONICA BRASIL-ADR	電気通信 サービス	250,890	1,275.77	320,080,069	1,270.13	318,665,350	3.45
インド	株式	ABB INDIA LTD	資本財	39,643	7,524.87	298,308,801	7,767.86	307,941,432	3.34
インド	株式	SIEMENS LTD	資本財	46,304	6,552.63	303,413,090	6,635.24	307,238,338	3.33
ブラジル	株式	TIM SA-ADR	電気通信 サービス	134,406	2,190.67	294,439,702	2,155.43	289,702,899	3.14
ブラジル	株式	AMBEV SA-ADR	食品・飲料・ タバコ	619,022	438.41	271,389,582	441.23	273,134,853	2.96
インド	株式	MPHASIS LTD	ソフト ウェア・ サービス	67,785	3,220.87	218,326,809	3,870.60	262,368,757	2.84
インド	株式	NESTLE INDIA LIMITED	食品・飲料・ タバコ	6,539	39,463.28	258,050,417	38,667.14	252,844,481	2.74
インド	株式	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	自動車・ 自動車部 品	14,395	16,304.94	234,709,704	16,632.91	239,430,826	2.59
インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LTD	家庭用 品・パー ソナル用 品	53,841	4,601.67	247,758,558	4,445.51	239,350,812	2.59
インドネシア	株式	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	資本財	3,739,600	63.92	239,035,232	62.27	232,883,590	2.52
南アフリカ	株式	KUMBA IRON ORE LTD	素材	59,593	3,932.58	234,354,812	3,861.54	230,120,807	2.49
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信 サービス	142,331	1,435.11	204,261,552	1,539.57	219,128,822	2.37
チリ	株式	ENEL CHILE SA-ADR	公益事業	451,047	468.02	211,099,198	483.52	218,093,448	2.36
チリ	株式	BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	銀行	73,129	2,688.29	196,592,537	2,975.87	217,622,887	2.36
チェコ	株式	KOMERCNI BANKA AS	銀行	46,942	4,310.20	202,329,588	4,594.31	215,666,569	2.34
南アフリカ	株式	VODACOM GROUP LTD	電気通信 サービス	218,396	967.60	211,321,717	953.91	208,330,325	2.26
ブラジル	株式	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	公益事業	155,950	1,348.61	210,315,802	1,324.78	206,599,975	2.24
中国	株式	YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	食品・飲料・ タバコ	250,434	804.30	201,425,413	821.65	205,770,948	2.23
中国	株式	ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	耐久消費 財・アパ レル	201,124	970.72	195,236,494	982.16	197,536,660	2.14
チリ	株式	ENEL AMERICAS SA	公益事業	10,212,363	19.01	194,195,501	19.04	194,525,234	2.11
南アフリカ	株式	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	素材	26,099	7,835.06	204,487,273	7,160.93	186,893,373	2.03
ポーランド	株式	SANTANDER BANK POLSKA SA	銀行	13,057	13,460.39	175,752,390	14,164.75	184,949,271	2.00

インド	株式	COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	家庭用品・パーソナル用品	52,325	2,841.87	148,701,357	3,524.79	184,434,951	2.00
インド	株式	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	保険	177,750	969.43	172,316,692	998.37	177,460,978	1.92
メキシコ	株式	WALMART DE MEXICO -SER V	生活必需品流通・小売り	272,000	572.41	155,697,300	592.69	161,213,591	1.75
中国	株式	SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	食品・飲料・タバコ	117,490	1,247.96	146,623,394	1,356.61	159,388,363	1.73
中国	株式	HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	食品・飲料・タバコ	321,731	483.49	155,553,806	493.54	158,789,224	1.72
インドネシア	株式	UNILEVER INDONESIA TBK PT	家庭用品・パーソナル用品	4,177,200	40.42	168,842,424	36.37	151,958,182	1.65
サウジアラビア	株式	SAUDI AWWAL BANK	銀行	94,651	1,432.20	135,559,351	1,479.25	140,012,681	1.52
韓国	株式	POSCO HOLDINGS INC	素材	1,986	42,797.69	84,996,216	68,399.50	135,841,407	1.47

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	素材	8.77
		資本財	9.79
		自動車・自動車部品	5.27
		耐久消費財・アパレル	2.14
		メディア・娯楽	0.79
		一般消費財・サービス流通・小売り	1.10
		生活必需品流通・小売り	2.61
		食品・飲料・タバコ	14.39
		家庭用品・パーソナル用品	8.64
		ヘルスケア機器・サービス	2.01
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.25
		銀行	13.66
		保険	1.92
		ソフトウェア・サービス	2.84
		電気通信サービス	15.76
		公益事業	6.71
半導体・半導体製造装置	0.87		
合計			98.54

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	390,000.00	54,951,000	54,961,179	0.60
	メキシコペソ	売建	1,440,000.00	12,155,889	12,163,680	0.13
	インドネシアルピア	売建	1,391,365,713.00	13,031,531	13,078,837	0.14
	南アフリカランド	売建	2,530,000.00	20,245,060	20,255,433	0.22
	香港・オフショア人民元	売建	670,000.00	13,209,452	13,210,256	0.14

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

インデックス マザーファンド コモディティ

以下の運用状況は2023年 7月31日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	ドイツ	8,116,144	98.62
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		113,567	1.38
合計(純資産総額)		8,229,711	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		217,466	2.64

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
ドイツ	投資信託受益証券	ISH DIV COMDTY SWAP DE-ETF	2,050	3,756.36	7,700,544	3,959.09	8,116,144	98.62

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.62
合計	98.62

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	ユーロ	売建	1,400.00	214,297	217,466	2.64

(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。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

本書提出日現在、取得申込みの受付は行なってありません。

2【換金（解約）手続等】

< 解約請求による換金 >

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

ニューヨーク証券取引所の休業日

英国証券取引所の休業日

ニューヨークの銀行休業日

ロンドンの銀行休業日

(4) 解約制限

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

(5) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。

税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(7) 解約単位

1口単位

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

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して7営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

- ・委託会社は、投資対象とする投資信託証券からの換金ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少など、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
- ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

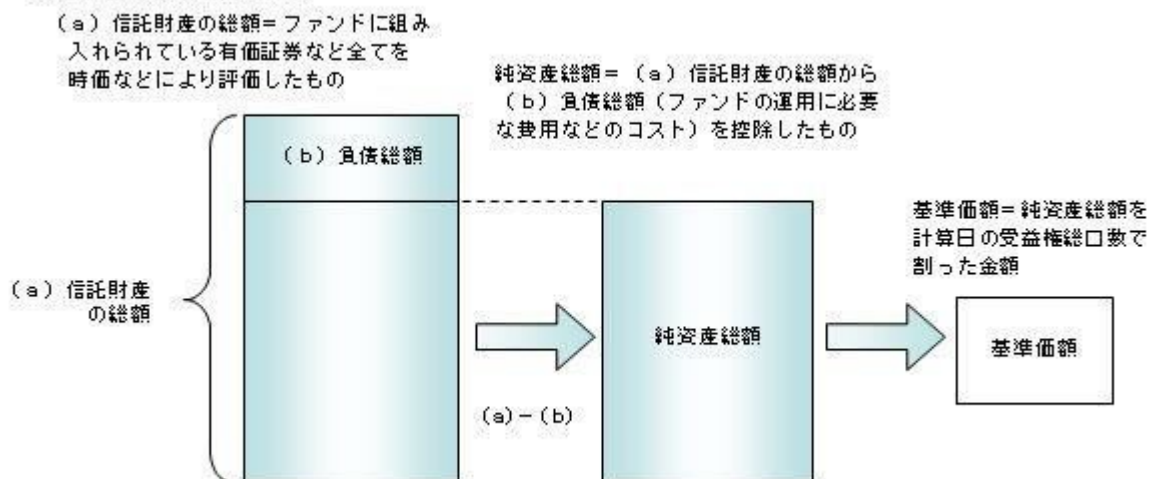
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

投資信託証券（国内籍）

原則として、基準価額計算日の基準価額で評価します。

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年7月18日から翌年7月17日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) 【その他】

信託の終了(繰上償還)

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 受益者の解約により純資産総額が10億円を下回ることとなった場合
 - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、委託会社は書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行いません。(後述の「書面決議」をご覧ください。)
- 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 2026年6月30日以前の毎営業日において、この信託の1万口当たり基準価額が13,000円以上となった場合
 - ロ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合
 - ハ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ニ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。)
 - ホ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 4) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

信託約款の変更など

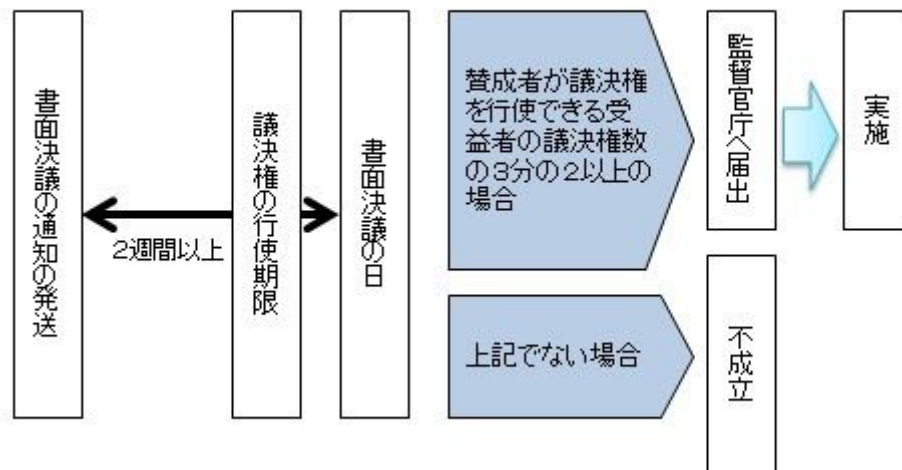
- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合(以下「併合」といいます。)を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものまたは併合(受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。)については、書面決議を行いません。(後述の「書面決議」をご覧ください。)

- 3) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「書面決議」の規定を適用します。

書面決議

- 1) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の2週間前までに知っている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- 2) 受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。
- 3) 書面決議は、議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行いません。
- 4) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行いません。
- 5) 当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
- 6) 当ファンドは、受益者からの換金請求に対して、投資信託契約の一部を解約することにより応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、書面決議において反対した受益者からの買取請求は受け付けません。

<書面決議の主な流れ>



公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

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

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

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

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間(2022年7月20日から2023年7月18日まで)の財務諸表について、PWCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-11】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第6期 2022年 7月19日現在	第7期 2023年 7月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,966,342	3,408,656
投資信託受益証券	26,159,547	23,275,166
親投資信託受益証券	79,858,257	76,790,422
未収入金	338,768	-
流動資産合計	111,322,914	103,474,244
資産合計	111,322,914	103,474,244
負債の部		
流動負債		
未払金	1,040,762	-
未払受託者報酬	18,651	16,975
未払委託者報酬	498,990	454,493
未払利息	2	4
その他未払費用	56,585	51,520
流動負債合計	1,614,990	522,992
負債合計	1,614,990	522,992
純資産の部		
元本等		
元本	91,044,107	83,588,714
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	18,663,817	19,362,538
(分配準備積立金)	22,065,638	21,539,382
元本等合計	109,707,924	102,951,252
純資産合計	109,707,924	102,951,252
負債純資産合計	111,322,914	103,474,244

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第6期		第7期	
	自	2021年 7月20日 至 2022年 7月19日	自	2022年 7月20日 至 2023年 7月18日
営業収益				
受取利息		1		2
有価証券売買等損益		1,756,373		3,322,835
営業収益合計		1,756,372		3,322,837
営業費用				
支払利息		380		1,110
受託者報酬		38,834		34,438
委託者報酬		1,038,680		921,819
その他費用		117,791		104,506
営業費用合計		1,195,685		1,061,873
営業利益又は営業損失()		2,952,057		2,260,964
経常利益又は経常損失()		2,952,057		2,260,964
当期純利益又は当期純損失()		2,952,057		2,260,964
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()		58,715		33,886
期首剰余金又は期首欠損金()		23,761,006		18,663,817
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,086,417		1,528,357
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,086,417		1,528,357
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		18,663,817		19,362,538

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年7月18日から翌年7月17日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2022年7月20日から2023年7月18日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

		第6期 2022年7月19日現在	第7期 2023年7月18日現在
1.	期首元本額	99,808,179円	91,044,107円
	期中追加設定元本額	- 円	- 円
	期中一部解約元本額	8,764,072円	7,455,393円
2.	受益権の総数	91,044,107口	83,588,714口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第6期 自 2021年7月20日 至 2022年7月19日		第7期 自 2022年7月20日 至 2023年7月18日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	643,076円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 1,280,672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	12,331円	C 信託約款に定める収益調整金 11,321円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	21,422,562円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 20,258,710円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	22,077,969円	E 分配対象収益(A+B+C+D) 21,550,703円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,424円	F 分配対象収益(1万口当たり) 2,578円
G	分配金額	0円	G 分配金額 0円
H	分配金額(1万口当たり)	0円	H 分配金額(1万口当たり) 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第6期 自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19日	第7期 自 2022年 7月20日 至 2023年 7月18日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第6期 2022年 7月19日現在	第7期 2023年 7月18日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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)

第6期(2022年 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	1,214,765
親投資信託受益証券	4,166,124
合計	2,951,359

第7期（2023年 7月18日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	2,716,683
親投資信託受益証券	140,273
合計	2,856,956

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第6期 2022年 7月19日現在		第7期 2023年 7月18日現在	
1口当たり純資産額	1.2050円	1口当たり純資産額	1.2316円
(1万口当たり純資産額)	(12,050円)	(1万口当たり純資産額)	(12,316円)

(4) 【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	F O F s 用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	4,099,033	5,262,338	
	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）	4,595,864	12,633,570	
	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）	2,666,947	4,232,711	
	インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）	837,263	1,146,547	
投資信託受益証券 合計		12,199,107	23,275,166	
親投資信託受益証券	インデックス マザーファンド T O P I X	5,381,885	16,666,621	
	ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド	34,897,823	38,296,870	
	インデックス マザーファンド Jリート	6,423,002	8,956,233	
	先進国資本エマージング株式マザーファンド	891,955	1,359,428	
	インデックス マザーファンド 海外先進国債券	7,965,984	9,986,157	
	インデックス マザーファンド コモディティ	1,146,271	1,525,113	
親投資信託受益証券 合計		56,706,920	76,790,422	
合計		68,906,027	100,065,588	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

当ファンドは、「インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）」「インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）」「インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）」「F O F s 用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は同投資信託です。なお、同投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

また、当ファンドは、「インデックス マザーファンド T O P I X」「ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド」「インデックス マザーファンド Jリート」「インデックス マザーファンド 海外先進国債券」「先進国資本エマージング株式マザーファンド」「インデックス マザーファンド コモディティ」を主要投

資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

（参考）

インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	688,142	647,960
親投資信託受益証券	61,642,176	63,777,494
未収入金	1,199,065	-
流動資産合計	63,529,383	64,425,454
資産合計	63,529,383	64,425,454
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,215,570	-
未払受託者報酬	1,212	1,276
未払委託者報酬	2,440	2,564
その他未払費用	50,880	43,832
流動負債合計	1,270,102	47,672
負債合計	1,270,102	47,672
純資産の部		
元本等		
元本	27,243,816	23,419,078
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	35,015,465	40,958,704
（分配準備積立金）	29,161,181	31,544,676
元本等合計	62,259,281	64,377,782
純資産合計	62,259,281	64,377,782
負債純資産合計	63,529,383	64,425,454

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）

		2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
1.	期首	2021年 7月20日	2022年 7月20日
	期首元本額	54,480,642円	27,243,816円
	期首からの追加設定元本額	3,363,413円	1,367,380円
	期首からの一部解約元本額	30,600,239円	5,192,118円
2.	受益権の総数	27,243,816口	23,419,078口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19日	自 2022年 7月20日 至 2023年 7月18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 7月19日現在	2023年 7月18日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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 7月19日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（2023年 7月18日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	593,256
合計	593,256

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2022年 7月19日現在		2023年 7月18日現在	
1口当たり純資産額	2.2853円	1口当たり純資産額	2.7489円
(1万口当たり純資産額)	(22,853円)	(1万口当たり純資産額)	(27,489円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI - KOKUSA I (ヘッジなし) マザーファンド	12,785,673	63,777,494	
	合計	12,785,673	63,777,494	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）」は、「海外株式インデックスMSCI - KOKUSA I（ヘッジなし）マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

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

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
資産の部		
流動資産		
預金	452,385,570	639,320,458
コール・ローン	2,730,080,206	2,439,415,496
株式	239,771,048,701	290,889,760,098
投資証券	6,090,965,329	6,108,385,189
派生商品評価勘定	144,422,675	140,993,543
未収入金	764,932	-
未収配当金	178,382,581	193,505,083
差入委託証拠金	441,773,392	781,018,499
流動資産合計	249,809,823,386	301,192,398,366
資産合計	249,809,823,386	301,192,398,366
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	38,318,184	45,321,851
未払解約金	6,971,538	22,427,416
未払利息	1,026	2,638
流動負債合計	45,290,748	67,751,905

負債合計	45,290,748	67,751,905
純資産の部		
元本等		
元本	60,494,412,485	60,367,955,755
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	189,270,120,153	240,756,690,706
元本等合計	249,764,532,638	301,124,646,461
純資産合計	249,764,532,638	301,124,646,461
負債純資産合計	249,809,823,386	301,192,398,366

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 7月19日現在	2023年 7月18日現在
1. 期首	2021年 7月20日	2022年 7月20日
期首元本額	63,462,796,864円	60,494,412,485円
期首からの追加設定元本額	9,270,216,157円	10,806,345,026円
期首からの一部解約元本額	12,238,600,536円	10,932,801,756円
元本の内訳		
インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	28,551,471,403円	32,111,938,408円
DCインデックスバランス（株式20）	120,181,833円	117,388,765円

DCインデックスバランス(株式40)	318,610,273円	321,107,856円
DCインデックスバランス(株式60)	626,764,448円	670,972,363円
DCインデックスバランス(株式80)	679,784,429円	780,077,023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	1,459,858,283円	1,320,132,887円
日興五大陸株式ファンド	3,762,309,764円	3,519,038,446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)	14,930,166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)	89,961,945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)	5,954,670,878円	5,817,219,961円
グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	12,526,533,975円	9,600,586,972円
Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	- 円	5,681,129円
インデックスファンドMSCIオール・カンントリー(全世界株式)	- 円	32,245,966円
Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス(全世界株式)	- 円	199,202,357円
Niつみインデックスラップ世界10指数(均等型)	- 円	250,051円
Niつみインデックスラップ世界10指数(安定成長型)	- 円	121,418円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	3,492,987円	- 円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,026,041円	- 円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	3,783,811円	- 円
アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	3,246,717円	- 円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,955,861,635円	1,446,650,048円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	19,197,996円	16,952,440円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	53,519,130円	47,097,274円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	81,033,822円	75,262,837円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	79,602,959円	76,092,142円
インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	4,186,569,990円	4,113,750,529円
計	60,494,412,485円	60,367,955,755円
2. 受益権の総数	60,494,412,485口	60,367,955,755口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19日	自 2022年 7月20日 至 2023年 7月18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 7月19日現在	2023年 7月18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 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	44,922,611,201
投資証券	975,774,276
合計	45,898,385,477

（2023年 7月18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	38,999,072,143
投資証券	339,566,722
合計	39,338,638,865

（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 7月19日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,916,577,963	-	3,925,186,859	8,608,896
合計		3,916,577,963	-	3,925,186,859	8,608,896

（2023年 7月18日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,049,409,197	-	4,154,661,819	105,252,622
合計		4,049,409,197	-	4,154,661,819	105,252,622

(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 7月19日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,992,596,800	-	3,090,156,425	97,559,625
	米ドル	2,509,726,720	-	2,606,796,680	97,069,960
	ユーロ	482,870,080	-	483,359,745	489,665
	売建	13,946,000	-	14,010,030	64,030
	ユーロ	13,946,000	-	14,010,030	64,030
	合計	3,006,542,800	-	3,104,166,455	97,495,595

(2023年 7月18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	2,867,208,680	-	2,857,627,750	9,580,930
	米ドル	2,430,660,470	-	2,414,592,980	16,067,490
	ユーロ	436,548,210	-	443,034,770	6,486,560
	合計	2,867,208,680	-	2,857,627,750	9,580,930

(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 7月19日現在		2023年 7月18日現在	
1口当たり純資産額	4,128.7円	1口当たり純資産額	4,988.2円
(1万口当たり純資産額)	(41,287円)	(1万口当たり純資産額)	(49,882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	36.33	463,207.50	
	BAKER HUGHES CO	40,615	34.65	1,407,309.75	
	CHENIERE ENERGY INC	9,180	154.99	1,422,808.20	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	3,750	80.85	303,187.50	
	CHEVRON CORP	70,751	153.44	10,856,033.44	
	CONOCOPHILLIPS	47,526	106.44	5,058,667.44	
	COTERRA ENERGY INC	32,460	25.52	828,379.20	
	DEVON ENERGY CORPORATION	25,260	48.92	1,235,719.20	

DIAMONDBACK ENERGY INC	6,540	135.47	885,973.80
EOG RESOURCES INC	22,952	118.68	2,723,943.36
EQT CORP	12,660	38.46	486,903.60
EXXON MOBIL CORP	159,671	101.38	16,187,445.98
HALLIBURTON CO	37,607	37.36	1,404,997.52
HESS CORP	10,470	134.50	1,408,215.00
HF SINCLAIR CORP	5,940	46.06	273,596.40
KINDER MORGAN INC	81,490	17.13	1,395,923.70
MARATHON OIL CORP	28,380	23.96	679,984.80
MARATHON PETROLEUM CORP	17,692	118.13	2,089,955.96
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	28,351	59.29	1,680,930.79
ONEOK INC	16,840	63.41	1,067,824.40
OVINTIV INC	9,400	39.32	369,608.00
PHILLIPS 66	18,855	99.04	1,867,399.20
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,130	207.00	1,889,910.00
SCHLUMBERGER LTD	56,141	56.51	3,172,527.91
TARGA RESOURCES CORP	8,180	77.70	635,586.00
TEXAS PACIFIC LAND CORP	245	1,401.26	343,308.70
VALERO ENERGY CORP	14,682	113.71	1,669,490.22
WILLIAMS COS INC	46,304	33.01	1,528,495.04
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,505	299.28	2,545,376.40
ALBEMARLE CORP	4,750	237.66	1,128,885.00
ALCOA CORP	6,700	35.57	238,319.00
AMCOR PLC	65,600	9.88	648,128.00
AVERY DENNISON CORP	3,040	176.78	537,411.20
BALL CORP	12,500	55.97	699,625.00
CELANESE CORP	4,090	121.04	495,053.60
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,820	73.93	578,132.60
CLEVELAND-CLIFFS INC	21,150	16.82	355,743.00
CORTEVA INC	28,172	54.59	1,537,909.48
CROWN HOLDINGS INC	4,565	88.67	404,778.55
DOW INC	28,025	52.43	1,469,350.75
DUPONT DE NEMOURS INC	19,162	72.58	1,390,777.96
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,815	86.51	416,545.65
ECOLAB INC	10,200	187.57	1,913,214.00

FMC CORP	4,840	95.41	461,784.40
FREEMPORT-MCMORAN INC	56,338	40.46	2,279,435.48
INTERNATIONAL PAPER CO	13,670	30.99	423,633.30
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,675	79.48	848,449.00
LINDE PLC	19,260	382.11	7,359,438.60
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,570	90.89	960,707.30
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,360	458.12	1,081,163.20
MOSAIC CO/THE	13,580	35.76	485,620.80
NEWMONT CORP	30,452	44.62	1,358,768.24
NUCOR CORP	9,959	167.43	1,667,435.37
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	133.99	479,684.20
PPG INDUSTRIES INC	9,394	151.20	1,420,372.80
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	2,210	285.38	630,689.80
RPM INTERNATIONAL INC	4,960	92.03	456,468.80
SEALED AIR CORP	5,746	44.43	255,294.78
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,336	267.83	2,500,460.88
STEEL DYNAMICS INC	6,010	106.94	642,709.40
VULCAN MATERIALS CO	5,563	223.71	1,244,498.73
WESTLAKE CORP	1,360	125.00	170,000.00
WESTROCK CO	9,989	29.41	293,776.49
3M CO	20,666	101.70	2,101,732.20
AECOM	4,930	87.32	430,487.60
AERCAP HOLDINGS NV	6,970	64.83	451,865.10
ALLEGION PLC	3,340	124.19	414,794.60
AMETEK INC	9,033	157.90	1,426,310.70
AXON ENTERPRISE INC	2,540	196.16	498,246.40
BOEING CO/THE	22,342	211.87	4,733,599.54
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	5,240	142.96	749,110.40
CARLISLE COS INC	2,250	268.74	604,665.00
CARRIER GLOBAL CORP	32,338	54.56	1,764,361.28
CATERPILLAR INC	20,376	257.46	5,246,004.96
CUMMINS INC	5,535	255.12	1,412,089.20
DEERE & CO	11,110	420.60	4,672,866.00
DOVER CORP	5,350	148.90	796,615.00
EATON CORP PLC	15,566	205.96	3,205,973.36

EMERSON ELECTRIC CO	22,490	91.32	2,053,786.80
FASTENAL CO	22,796	57.28	1,305,754.88
FERGUSON PLC	8,440	159.57	1,346,770.80
FORTIVE CORP	13,454	74.74	1,005,551.96
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	5,050	74.44	375,922.00
GENERAC HOLDINGS INC	2,440	142.88	348,627.20
GENERAL DYNAMICS CORP	9,397	216.37	2,033,228.89
GENERAL ELECTRIC CO	42,747	111.14	4,750,901.58
GRACO INC	6,310	87.40	551,494.00
HEICO CORP	1,800	173.42	312,156.00
HEICO CORP-CLASS A	3,120	137.79	429,904.80
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	26,266	208.17	5,467,793.22
HOWMET AEROSPACE INC	14,463	50.20	726,042.60
HUBBELL INC	1,980	331.96	657,280.80
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,530	233.08	356,612.40
IDEX CORP	2,880	210.60	606,528.00
ILLINOIS TOOL WORKS	11,925	251.17	2,995,202.25
INGERSOLL-RAND INC	16,398	66.29	1,087,023.42
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,570	50.24	330,076.80
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	27,484	69.37	1,906,565.08
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,750	197.97	1,534,267.50
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,385	340.46	471,537.10
LOCKHEED MARTIN CORP	8,931	469.97	4,197,302.07
MASCO CORP	9,849	60.47	595,569.03
NORDSON CORP	2,345	247.27	579,848.15
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,784	454.24	2,627,324.16
OTIS WORLDWIDE CORP	17,124	88.54	1,516,158.96
OWENS CORNING	3,550	134.89	478,859.50
PACCAR INC	20,706	87.56	1,813,017.36
PARKER HANNIFIN CORP	5,265	400.95	2,111,001.75
PENTAIR PLC	6,918	65.94	456,172.92
QUANTA SERVICES INC	5,710	199.31	1,138,060.10
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	57,416	96.32	5,530,309.12
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,618	342.58	1,582,034.44
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,420	46.24	296,860.80

SMITH (A.O.) CORP	5,020	75.00	376,500.00	
SNAP-ON INC	1,975	294.76	582,151.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,806	97.23	564,517.38	
TEXTRON INC	7,956	67.45	536,632.20	
TORO CO	3,890	103.03	400,786.70	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,066	198.85	1,802,774.10	
TRANSDIGM GROUP INC	2,070	886.25	1,834,537.50	
UNITED RENTALS INC	2,805	451.49	1,266,429.45	
WABTEC CORP	6,470	112.66	728,910.20	
WATSCO INC	1,240	371.04	460,089.60	
WW GRAINGER INC	1,847	764.00	1,411,108.00	
XYLEM INC	9,468	110.63	1,047,444.84	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	16,226	233.72	3,792,340.72	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,070	114.34	579,703.80	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,400	166.73	733,612.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,280	70.64	372,979.20	
CINTAS CORP	3,592	503.67	1,809,182.64	
CLARIVATE PLC	14,250	9.71	138,367.50	
COPART INC	16,860	93.74	1,580,456.40	
EQUIFAX INC	4,764	237.14	1,129,734.96	
JACOBS SOLUTIONS INC	4,880	122.10	595,848.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	4,960	90.48	448,780.80	
PAYCHEX INC	13,072	121.03	1,582,104.16	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,945	358.99	698,235.55	
PAYLOCITY HOLDING CORP	1,730	217.53	376,326.90	
REPUBLIC SERVICES INC	8,920	150.14	1,339,248.80	
ROBERT HALF INC	4,415	83.38	368,122.70	
ROLLINS INC	8,265	44.59	368,536.35	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	60.62	513,451.40	
TRANSUNION	7,270	79.94	581,163.80	
VERISK ANALYTICS INC	5,810	229.97	1,336,125.70	
WASTE CONNECTIONS INC	10,606	141.48	1,500,536.88	
WASTE MANAGEMENT INC	16,034	167.76	2,689,863.84	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,930	94.85	467,610.50	
CSX CORP	80,059	33.22	2,659,559.98	

DELTA AIR LINES INC	4,745	46.80	222,066.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,467	122.01	789,038.67
FEDEX CORP	9,448	254.73	2,406,689.04
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	77,000	3.62	278,740.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,140	183.38	575,813.20
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,140	54.00	331,560.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,915	233.18	2,078,799.70
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,655	383.28	1,400,888.40
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	36.27	198,396.90
U-HAUL HOLDING CO	3,375	53.90	181,912.50
UBER TECHNOLOGIES INC	71,590	45.51	3,258,060.90
UNION PACIFIC CORP	24,011	209.86	5,038,948.46
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	28,507	182.74	5,209,369.18
APTIV PLC	11,080	109.23	1,210,268.40
BORGWARNER INC	9,120	45.40	414,048.00
FORD MOTOR COMPANY	159,205	14.09	2,243,198.45
GENERAL MOTORS CORP	52,765	38.75	2,044,643.75
LEAR CORP	2,290	148.19	339,355.10
LUCID GROUP INC	36,360	7.03	255,610.80
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	25,650	23.99	615,343.50
TESLA INC	112,325	290.38	32,616,933.50
DECKERS OUTDOOR CORP	990	547.45	541,975.50
DR HORTON INC	12,896	128.05	1,651,332.80
GARMIN LTD	5,865	106.40	624,036.00
HASBRO INC	5,188	64.00	332,032.00
LENNAR CORP-CL A	10,040	130.39	1,309,115.60
LULULEMON ATHLETICA INC	4,710	383.69	1,807,179.90
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,878	112.80	211,838.40
NIKE INC -CL B	48,338	108.71	5,254,823.98
NVR INC	118	6,408.98	756,259.64
PULTE GROUP INC	8,850	81.70	723,045.00
VF CORP	12,170	19.11	232,568.70
WHIRLPOOL CORP	2,079	151.70	315,384.30
AIRBNB INC-CLASS A	16,340	145.36	2,375,182.40
ARAMARK	8,880	43.52	386,457.60

BOOKING HOLDINGS INC	1,473	2,949.66	4,344,849.18
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,970	52.47	418,185.90
CARNIVAL CORP	38,787	17.71	686,917.77
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,065	2,127.51	2,265,798.15
DARDEN RESTAURANTS INC	4,853	169.25	821,370.25
DOMINO'S PIZZA INC	1,375	389.74	535,892.50
DOORDASH INC - A	9,130	85.34	779,154.20
EXPEDIA GROUP INC	6,032	121.14	730,716.48
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,650	149.00	1,586,850.00
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,680	119.10	200,088.00
LAS VEGAS SANDS CORP	14,390	59.40	854,766.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,673	191.29	2,041,638.17
MCDONALD'S CORP	28,681	294.68	8,451,717.08
MGM RESORTS INTERNATIONAL	12,900	48.19	621,651.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,748	98.76	863,952.48
STARBUCKS CORP	45,054	100.93	4,547,300.22
VAIL RESORTS INC	1,520	244.03	370,925.60
WYNN RESORTS LTD	4,180	107.02	447,343.60
YUM! BRANDS INC	11,394	135.74	1,546,621.56
ACTIVISION BLIZZARD INC	29,720	93.21	2,770,201.20
ALPHABET INC-CL A	234,390	124.65	29,216,713.50
ALPHABET INC-CL C	211,760	125.06	26,482,705.60
CHARTER COMMUNICATION-A	3,926	374.81	1,471,504.06
COMCAST CORP-CLASS A	165,084	42.09	6,948,385.56
ELECTRONIC ARTS INC	10,834	138.25	1,497,800.50
FOX CORP - CLASS A	13,084	33.44	437,528.96
FOX CORP- CLASS B	5,466	31.35	171,359.10
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,096	40.29	608,217.84
LIBERTY BROADBAND-C	4,850	81.86	397,021.00
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	5,726	33.95	194,397.70
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	7,780	74.88	582,566.40
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,420	94.29	605,341.80
MATCH GROUP INC	10,912	48.49	529,122.88
META PLATFORMS INC-CLASS A	87,250	310.62	27,101,595.00
NETFLIX INC	17,490	450.05	7,871,374.50

NEWS CORP - CLASS A	14,750	20.40	300,900.00
OMNICOM GROUP	6,937	98.23	681,421.51
PARAMOUNT GLOBAL	22,823	15.36	350,561.28
PINTEREST INC- CLASS A	22,100	29.15	644,215.00
ROBLOX CORP -CLASS A	14,450	44.46	642,447.00
ROKU INC	4,700	75.84	356,448.00
SEA LTD-ADR	14,470	62.74	907,847.80
SIRIUS XM HOLDINGS INC	30,280	4.94	149,583.20
SNAP INC - A	45,300	13.47	610,191.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,240	152.71	1,105,620.40
THE WALT DISNEY CO.	71,712	85.56	6,135,678.72
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	17,500	90.69	1,587,075.00
WARNER BROS DISCOVERY INC	94,890	12.31	1,168,095.90
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	9,840	28.89	284,277.60
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,328	69.48	161,749.44
AMAZON.COM INC	363,430	133.56	48,539,710.80
AUTOZONE INC	722	2,544.23	1,836,934.06
BATH & BODY WORKS INC	9,270	36.15	335,110.50
BEST BUY CO INC	7,814	82.27	642,857.78
BURLINGTON STORES INC	2,585	168.31	435,081.35
CARMAX INC	5,949	83.69	497,871.81
CHEWY INC - CLASS A	3,410	37.90	129,239.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,270	133.68	303,453.60
EBAY INC	21,897	47.19	1,033,319.43
ETSY INC	4,800	93.40	448,320.00
GENUINE PARTS CO	5,751	166.67	958,519.17
HOME DEPOT INC	39,815	316.05	12,583,530.75
LKQ CORP	10,260	58.62	601,441.20
LOWE'S COS INC	23,462	227.97	5,348,632.14
MERCADOLIBRE INC	1,790	1,179.17	2,110,714.30
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,420	968.96	2,344,883.20
POOL CORP	1,540	360.02	554,430.80
ROSS STORES INC	12,642	110.25	1,393,780.50
TJX COMPANIES INC	45,146	85.10	3,841,924.60
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,530	210.81	954,969.30

ULTA BEAUTY INC	2,100	472.72	992,712.00
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	10,260	22.00	225,720.00
COSTCO WHOLESALE CORP	17,429	552.96	9,637,539.84
DOLLAR GENERAL CORP	8,725	161.13	1,405,859.25
DOLLAR TREE INC	8,986	149.11	1,339,902.46
KROGER CO	26,880	46.54	1,250,995.20
SYSCO CORP	19,996	73.41	1,467,906.36
TARGET CORP	17,980	130.01	2,337,579.80
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	30,782	29.12	896,371.84
WALMART INC	58,252	154.85	9,020,322.20
ALTRIA GROUP INC	69,878	45.38	3,171,063.64
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,143	79.56	1,761,697.08
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,770	66.68	851,503.60
BUNGE LTD	5,847	101.71	594,698.37
CAMPBELL SOUP CO	7,885	44.94	354,351.90
COCA-COLA CO/THE	161,512	60.81	9,821,544.72
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	7,710	65.14	502,229.40
CONAGRA BRANDS INC	20,640	32.28	666,259.20
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,270	254.56	1,596,091.20
DARLING INGREDIENTS INC	5,880	65.70	386,316.00
GENERAL MILLS INC	23,059	74.31	1,713,514.29
HERSHEY CO/THE	5,765	239.45	1,380,429.25
HORMEL FOODS CORP	11,500	39.39	452,985.00
JM SMUCKER CO/THE	4,100	148.48	608,768.00
KELLOGG CO	9,818	66.72	655,056.96
KEURIG DR PEPPER INC	35,300	31.61	1,115,833.00
KRAFT HEINZ CO/THE	29,531	35.51	1,048,645.81
LAMB WESTON HOLDING INC	6,150	113.00	694,950.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,420	85.75	893,515.00
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,570	67.99	514,684.30
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	53,395	71.94	3,841,236.30
MONSTER BEVERAGE CORP	31,280	57.29	1,792,031.20
PEPSICO INC	54,131	185.63	10,048,337.53
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	60,908	98.95	6,026,846.60
TYSON FOODS INC-CL A	10,906	51.88	565,803.28

CHURCH & DWIGHT CO INC	10,310	98.39	1,014,400.90
CLOROX COMPANY	5,266	153.51	808,383.66
COLGATE-PALMOLIVE CO	30,440	75.58	2,300,655.20
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,200	192.65	1,772,380.00
KIMBERLY-CLARK CORP	13,663	134.54	1,838,220.02
PROCTER & GAMBLE CO	92,769	148.99	13,821,653.31
ABBOTT LABORATORIES	68,256	107.00	7,303,392.00
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,060	370.36	1,133,301.60
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,014	192.14	1,347,669.96
BAXTER INTERNATIONAL INC	19,439	46.55	904,885.45
BECTON DICKINSON AND CO	11,227	256.64	2,881,297.28
BOSTON SCIENTIFIC CORP	56,748	52.61	2,985,512.28
CARDINAL HEALTH INC	10,305	93.47	963,208.35
CENTENE CORP	22,367	65.07	1,455,420.69
CIGNA GROUP/THE	11,760	281.16	3,306,441.60
COOPER COS INC/THE	2,025	393.97	797,789.25
CVS HEALTH CORP	50,098	71.17	3,565,474.66
DAVITA INC	2,108	104.53	220,349.24
DENTSPLY SIRONA INC	8,222	40.57	333,566.54
DEXCOM INC	15,500	137.45	2,130,475.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	24,120	92.65	2,234,718.00
ELEVANCE HEALTH INC	9,306	437.17	4,068,304.02
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	15,815	81.19	1,284,019.85
HCA HEALTHCARE INC	8,190	291.86	2,390,333.40
HENRY SCHEIN INC	5,280	80.23	423,614.40
HOLOGIC INC	9,858	78.96	778,387.68
HUMANA INC	4,955	434.41	2,152,501.55
IDEXX LABORATORIES INC	3,360	551.84	1,854,182.40
INSULET CORP	2,745	287.96	790,450.20
INTUITIVE SURGICAL INC	13,835	353.84	4,895,376.40
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,415	212.59	725,994.85
MASIMO CORP	2,020	147.16	297,263.20
MCKESSON CORP	5,439	411.67	2,239,073.13
MEDTRONIC PLC	52,158	86.71	4,522,620.18
MOLINA HEALTHCARE INC	2,035	299.91	610,316.85

NOVOCURE LTD	4,120	40.57	167,148.40
QUEST DIAGNOSTICS	4,386	139.91	613,645.26
RESMED INC	5,830	220.77	1,287,089.10
STERIS PLC	4,240	228.35	968,204.00
STRYKER CORP	13,503	298.62	4,032,265.86
TELEFLEX INC	1,820	247.25	449,995.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	36,710	484.08	17,770,576.80
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,920	153.44	294,604.80
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	5,790	206.87	1,197,777.30
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,412	140.66	1,183,231.92
ABBVIE INC	69,396	134.83	9,356,662.68
AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,120	118.25	1,314,940.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,040	202.83	1,022,263.20
AMGEN INC	20,941	227.84	4,771,197.44
AVANTOR INC	27,110	20.63	559,279.30
BIO-RAD LABORATORIES-A	860	387.71	333,430.60
BIO-TECHNE CORP	5,920	82.80	490,176.00
BIOGEN INC	5,543	278.40	1,543,171.20
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,140	86.67	618,823.80
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	82,505	61.85	5,102,934.25
CATALENT INC	6,520	46.46	302,919.20
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,910	209.34	399,839.40
DANAHER CORP	27,189	237.76	6,464,456.64
ELI LILLY & CO	31,834	447.14	14,234,254.76
EXACT SCIENCES CORP	7,370	97.57	719,090.90
GILEAD SCIENCES INC	48,914	77.48	3,789,856.72
HORIZON THERAPEUTICS PLC	8,450	104.00	878,800.00
ILLUMINA INC	6,275	184.14	1,155,478.50
INCYTE CORP	7,670	61.08	468,483.60
IQVIA HOLDINGS INC	7,438	221.37	1,646,550.06
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,450	126.18	309,141.00
JOHNSON & JOHNSON	102,201	159.07	16,257,113.07
MERCK & CO. INC.	99,823	105.57	10,538,314.11
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	890	1,328.46	1,182,329.40
MODERNA INC	12,875	122.60	1,578,475.00

NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,630	96.00	348,480.00
PFIZER INC	221,720	35.86	7,950,879.20
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,240	721.61	3,059,626.40
REPLIGEN CORP	2,250	152.12	342,270.00
REVVITY INC	4,910	121.00	594,110.00
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	14,330	30.65	439,214.50
SEAGEN INC	5,620	197.60	1,110,512.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43,590	8.02	349,591.80
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	15,149	525.26	7,957,163.74
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,900	234.26	445,094.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10,170	357.98	3,640,656.60
VIATRIS INC	45,819	10.01	458,648.19
WATERS CORP	2,331	269.83	628,973.73
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,960	383.62	1,135,515.20
ZOETIS INC	18,225	170.73	3,111,554.25
BANK OF AMERICA CORP	282,579	29.40	8,307,822.60
CITIGROUP INC	77,087	46.26	3,566,044.62
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,310	28.08	542,224.80
FIFTH THIRD BANCORP	26,459	27.31	722,595.29
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	450	1,364.00	613,800.00
FIRST HORIZON CORP	19,800	12.55	248,490.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,720	11.40	612,408.00
JPMORGAN CHASE & CO	115,300	153.38	17,684,714.00
KEYCORP	36,108	10.29	371,551.32
M & T BANK CORP	6,913	131.35	908,022.55
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	16,200	127.16	2,059,992.00
REGIONS FINANCIAL CORP	35,844	19.20	688,204.80
TRUIST FINANCIAL CORP	53,220	33.43	1,779,144.60
US BANCORP	57,831	35.26	2,039,121.06
WEBSTER FINANCIAL CORP	6,370	41.38	263,590.60
WELLS FARGO & CO	148,260	44.74	6,633,152.40
ALLY FINANCIAL INC	12,240	27.60	337,824.00
AMERICAN EXPRESS CO	24,784	175.39	4,346,865.76
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,225	343.00	1,449,175.00
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,800	80.94	1,278,852.00

ARES MANAGEMENT CORP-A	7,150	100.95	721,792.50
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	30,612	43.54	1,332,846.48
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	51,065	344.25	17,579,126.25
BLACKROCK INC	5,875	727.87	4,276,236.25
BLACKSTONE INC	27,850	104.39	2,907,261.50
BLOCK INC	21,450	78.06	1,674,387.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15,435	113.43	1,750,792.05
CARLYLE GROUP INC/THE	7,650	34.06	260,559.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,940	141.03	555,658.20
CME GROUP INC	14,250	185.25	2,639,812.50
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	6,900	105.55	728,295.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,750	120.37	1,293,977.50
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,420	27.69	399,289.80
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,590	420.10	667,959.00
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	24,198	58.36	1,412,195.28
FISERV INC	24,374	128.51	3,132,302.74
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,880	258.48	744,422.40
FRANKLIN RESOURCES INC	11,755	28.90	339,719.50
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	46.56	116,400.00
GLOBAL PAYMENTS INC	10,989	112.30	1,234,064.70
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,083	327.20	4,280,757.60
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	21,690	116.64	2,529,921.60
INVESCO LTD	13,527	17.60	238,075.20
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,200	168.32	538,624.00
KKR & CO INC -A	24,780	60.68	1,503,650.40
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,185	225.84	719,300.40
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,420	255.30	362,526.00
MASTERCARD INC - A	33,465	402.20	13,459,623.00
MOODY'S CORP	6,502	356.41	2,317,377.82
MORGAN STANLEY	49,153	86.37	4,245,344.61
MSCI INC	3,175	499.25	1,585,118.75
NASDAQ INC	11,725	50.90	596,802.50
NORTHERN TRUST CORP	7,690	70.47	541,914.30
PAYPAL HOLDINGS INC	42,267	73.49	3,106,201.83
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,720	106.62	823,106.40

S&P GLOBAL INC	12,865	417.39	5,369,722.35
SCHWAB (CHARLES) CORP	58,883	58.64	3,452,899.12
SEI INVESTMENTS COMPANY	3,375	62.18	209,857.50
STATE STREET CORP	12,947	66.51	861,104.97
SYNCHRONY FINANCIAL	19,010	35.51	675,045.10
T ROWE PRICE GROUP INC	8,675	117.87	1,022,522.25
TOAST INC-CLASS A	10,580	25.85	273,493.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,200	69.54	292,068.00
VISA INC-CLASS A SHARES	63,902	243.99	15,591,448.98
AFLAC INC	23,424	70.38	1,648,581.12
ALLSTATE CORP	10,513	102.41	1,076,636.33
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,660	116.18	309,038.80
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	30,345	59.10	1,793,389.50
AON PLC	8,077	337.49	2,725,906.73
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,535	80.61	1,171,666.35
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,610	217.20	1,870,092.00
ASSURANT INC	1,960	124.65	244,314.00
BROWN & BROWN INC	9,090	69.89	635,300.10
CHUBB LTD	16,205	191.67	3,106,012.35
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,880	98.36	578,356.80
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	940	205.66	193,320.40
EVEREST GROUP LTD	1,469	359.02	527,400.38
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	11,071	37.97	420,365.87
GLOBE LIFE INC	3,586	110.92	397,759.12
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,382	72.22	894,228.04
LOEWS CORP	7,145	60.11	429,485.95
MARKEL GROUP INC	530	1,394.19	738,920.70
MARSH & MCLENNAN COS	19,518	188.38	3,676,800.84
METLIFE INC	26,335	59.00	1,553,765.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,520	80.57	767,026.40
PROGRESSIVE CORP	22,900	121.95	2,792,655.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,962	92.50	1,383,985.00
TRAVELERS COS INC/THE	8,889	168.59	1,498,596.51
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,198	229.64	964,028.72
WR BERKLEY CORP	8,091	60.53	489,748.23

ACCENTURE PLC-CL A	24,808	319.78	7,933,102.24
ADOBE INC	18,049	522.00	9,421,578.00
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,030	92.46	557,533.80
ANSYS INC	3,515	347.83	1,222,622.45
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,300	177.12	230,256.00
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	6,020	180.43	1,086,188.60
AUTODESK INC	8,720	213.73	1,863,725.60
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,530	55.10	414,903.00
BILL HOLDINGS INC	3,630	130.17	472,517.10
BLACK KNIGHT INC	5,860	71.15	416,939.00
CADENCE DESIGN SYS INC	10,570	244.44	2,583,730.80
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,840	127.30	488,832.00
CLOUDFLARE INC-CLASS A	9,750	71.18	694,005.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	20,318	68.44	1,390,563.92
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	8,250	152.73	1,260,022.50
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,650	165.20	272,580.00
DATADOG INC-CLASS A	9,910	112.77	1,117,550.70
DOCUSIGN INC	8,320	52.76	438,963.20
DROPBOX INC-CLASS A	11,660	27.81	324,264.60
DYNATRACE INC	9,850	54.98	541,553.00
EPAM SYSTEMS INC	2,280	242.89	553,789.20
FAIR ISAAC CORP	970	837.24	812,122.80
FORTINET INC	26,965	80.28	2,164,750.20
GARTNER INC	3,050	371.07	1,131,763.50
GEN DIGITAL INC	24,365	18.87	459,767.55
GODADDY INC-CLASS A	6,020	77.46	466,309.20
HUBSPOT INC	1,885	557.33	1,050,567.05
INTL BUSINESS MACHINES CORP	35,572	134.24	4,775,185.28
INTUIT INC	11,016	490.82	5,406,873.12
MICROSOFT CORP	278,444	345.73	96,266,444.12
MONDAY.COM LTD	750	184.57	138,427.50
MONGODB INC	2,820	409.17	1,153,859.40
OKTA INC	5,670	70.85	401,719.50
ORACLE CORP	63,623	118.89	7,564,138.47
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	68,020	17.40	1,183,548.00

PALO ALTO NETWORKS INC	11,935	250.05	2,984,346.75	
PTC INC	4,160	146.55	609,648.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,200	476.53	2,001,426.00	
SALESFORCE INC	39,406	228.00	8,984,568.00	
SERVICENOW INC	8,045	592.38	4,765,697.10	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	10,100	184.21	1,860,521.00	
SPLUNK INC	6,120	111.07	679,748.40	
SYNOPSYS INC	6,082	461.18	2,804,896.76	
TWILIO INC - A	7,225	66.47	480,245.75	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,830	421.75	771,802.50	
UIPATH INC - CLASS A	12,800	18.45	236,160.00	
UNITY SOFTWARE INC	9,650	46.08	444,672.00	
VERISIGN INC	3,690	215.31	794,493.90	
VMWARE INC-CLASS A	9,517	159.22	1,515,296.74	
WIX.COM LTD	2,280	83.10	189,468.00	
WORKDAY INC-CLASS A	7,990	228.25	1,823,717.50	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	8,530	72.84	621,325.20	
ZSCALER INC	3,630	151.82	551,106.60	
AMPHENOL CORP-CL A	23,350	85.18	1,988,953.00	
APPLE INC	623,004	193.99	120,856,545.96	
ARISTA NETWORKS INC	10,420	170.42	1,775,776.40	
ARROW ELECTRONICS INC	2,520	143.32	361,166.40	
CDW CORP/DE	5,195	189.61	985,023.95	
CISCO SYSTEMS INC	160,900	50.81	8,175,329.00	
COGNEX CORP	6,480	58.56	379,468.80	
CORNING INC	33,518	33.60	1,126,204.80	
DELL TECHNOLOGIES -C	11,022	54.70	602,903.40	
F5 INC	2,385	148.11	353,242.35	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	50,105	17.05	854,290.25	
HP INC	34,495	32.82	1,132,125.90	
JUNIPER NETWORKS INC	11,943	29.33	350,288.19	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,160	170.43	1,220,278.80	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,610	291.49	1,926,748.90	
NETAPP INC	8,246	78.02	643,352.92	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,794	60.95	475,044.30	

TE CONNECTIVITY LTD	12,995	142.77	1,855,296.15
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,020	414.67	837,633.40
TRIMBLE INC	9,520	53.72	511,414.40
WESTERN DIGITAL CORP	11,688	39.14	457,468.32
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,075	309.51	642,233.25
AT&T INC	281,237	13.53	3,805,136.61
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,435	17.89	97,232.15
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	8,131	18.85	153,269.35
T-MOBILE US INC	23,779	138.00	3,281,502.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	165,407	31.46	5,203,704.22
AES CORP	27,958	21.38	597,742.04
ALLIANT ENERGY CORP	9,590	53.30	511,147.00
AMEREN CORPORATION	10,152	84.43	857,133.36
AMERICAN ELECTRIC POWER	20,348	85.48	1,739,347.04
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,705	144.07	1,110,059.35
ATMOS ENERGY CORP	5,310	119.69	635,553.90
CENTERPOINT ENERGY INC	23,972	29.68	711,488.96
CMS ENERGY CORP	11,090	60.00	665,400.00
CONSOLIDATED EDISON INC	14,236	92.42	1,315,691.12
CONSTELLATION ENERGY	13,168	96.18	1,266,498.24
DOMINION ENERGY INC	33,331	51.31	1,710,213.61
DTE ENERGY COMPANY	8,318	110.66	920,469.88
DUKE ENERGY CORP	30,796	91.78	2,826,456.88
EDISON INTERNATIONAL	14,439	69.89	1,009,141.71
ENERGY CORP	7,967	98.74	786,661.58
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,210	40.91	458,601.10
EVERGY INC	8,720	59.45	518,404.00
EVERSOURCE ENERGY	14,310	72.18	1,032,895.80
EXELON CORP	37,926	41.78	1,584,548.28
FIRSTENERGY CORP	23,295	39.24	914,095.80
NEXTERA ENERGY INC	79,400	72.66	5,769,204.00
NISOURCE INC	15,610	27.47	428,806.70
NRG ENERGY INC	8,760	36.35	318,426.00
P G & E CORP	69,370	17.83	1,236,867.10
PPL CORP	30,338	26.45	802,440.10

PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	19,888	62.92	1,251,352.96
SEMPRA ENERGY	12,432	146.12	1,816,563.84
SOUTHERN CO	42,685	70.18	2,995,633.30
UGI CORP	8,500	25.92	220,320.00
VISTRA CORP	14,720	26.13	384,633.60
WEC ENERGY GROUP INC	12,220	89.52	1,093,934.40
XCEL ENERGY INC	22,174	63.21	1,401,618.54
ADVANCED MICRO DEVICES	63,194	118.32	7,477,114.08
ANALOG DEVICES INC	19,817	196.36	3,891,266.12
APPLIED MATERIALS INC	33,373	145.50	4,855,771.50
BROADCOM INC	16,400	910.35	14,929,740.00
ENPHASE ENERGY INC	5,440	189.67	1,031,804.80
ENTEGRIS INC	5,660	111.74	632,448.40
FIRST SOLAR INC	3,910	206.71	808,236.10
INTEL CORP	164,612	34.37	5,657,714.44
KLA CORP	5,319	490.38	2,608,331.22
LAM RESEARCH CORP	5,327	660.07	3,516,192.89
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	5,150	96.45	496,717.50
MARVELL TECHNOLOGY INC	33,394	64.56	2,155,916.64
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,028	92.18	2,030,541.04
MICRON TECHNOLOGY INC	43,717	65.16	2,848,599.72
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,820	588.72	1,071,470.40
NVIDIA CORP	97,230	464.61	45,174,030.30
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,447	219.62	2,294,370.14
ON SEMICONDUCTOR CORP	17,340	104.33	1,809,082.20
QORVO INC	4,240	107.38	455,291.20
QUALCOMM INC	43,782	123.40	5,402,698.80
SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,440	114.92	740,084.80
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	2,310	283.85	655,693.50
TERADYNE INC	6,190	116.25	719,587.50
TEXAS INSTRUMENTS INC	35,622	183.40	6,533,074.80
WOLFSPEED INC	5,080	66.76	339,140.80
CBRE GROUP INC - A	12,560	88.14	1,107,038.40
COSTAR GROUP INC	16,800	90.61	1,522,248.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,500	3.83	155,115.00

	ZILLOW GROUP INC - C	6,370	53.75	342,387.50	
米ドル小計		13,386,528		1,546,337,191.13 (214,755,309,104)	
加ドル	ARC RESOURCES LTD	25,510	18.29	466,577.90	
	CAMECO CORP	16,352	41.71	682,041.92	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	44,054	73.68	3,245,898.72	
	CENOVUS ENERGY INC	57,213	22.27	1,274,133.51	
	ENBRIDGE INC	79,137	48.13	3,808,863.81	
	IMPERIAL OIL LTD	8,922	64.27	573,416.94	
	KEYERA CORP	8,460	30.75	260,145.00	
	PARKLAND CORP	6,170	34.73	214,284.10	
	PEMBINA PIPELINE CORP	23,552	40.34	950,087.68	
	SUNCOR ENERGY INC	53,489	37.89	2,026,698.21	
	TC ENERGY CORP	41,663	50.81	2,116,897.03	
	TOURMALINE OIL CORP	12,040	65.07	783,442.80	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	19,076	69.40	1,323,874.40	
	BARRICK GOLD CORP	69,624	22.93	1,596,478.32	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	66.19	380,592.50	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	34.10	772,365.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,125	192.68	1,565,525.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	24,510	12.65	310,051.50	
	KINROSS GOLD CORP	46,025	6.71	308,827.75	
	LUNDIN MINING CORP	25,010	11.14	278,611.40	
	NUTRIEN LTD	20,908	79.94	1,671,385.52	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	12,860	21.22	272,889.20	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,975	54.95	987,726.25	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,450	116.65	285,792.50	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,165	58.62	1,123,452.30	
	CAE INC	12,305	28.85	354,999.25	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,260	109.27	356,220.20	
	WSP GLOBAL INC	4,590	176.65	810,823.50	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,410	49.60	367,536.00	
	RB GLOBAL INC	6,440	81.52	524,988.80	
	THOMSON REUTERS CORP	6,310	174.92	1,103,745.20	
	AIR CANADA	7,190	25.18	181,044.20	

CANADIAN NATL RAILWAY CO	22,438	155.08	3,479,685.04
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	36,401	105.29	3,832,661.29
TFI INTERNATIONAL INC	3,210	145.41	466,766.10
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,668	77.87	830,717.16
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,570	107.61	168,947.70
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,040	41.43	291,667.20
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,998	101.91	1,120,806.18
QUEBECOR INC -CL B	6,110	31.89	194,847.90
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,250	184.80	415,800.00
DOLLARAMA INC	10,360	87.95	911,162.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	30,860	67.14	2,071,940.40
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	36.58	254,231.00
LOBLAW COMPANIES LTD	6,339	120.28	762,454.92
METRO INC	9,570	74.13	709,424.10
WESTON (GEORGE) LTD	2,808	153.66	431,477.28
SAPUTO INC	9,620	28.45	273,689.00
BANK OF MONTREAL	26,881	121.65	3,270,073.65
BANK OF NOVA SCOTIA	47,539	65.54	3,115,706.06
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	37,740	57.08	2,154,199.20
NATIONAL BANK OF CANADA	13,750	100.63	1,383,662.50
ROYAL BANK OF CANADA	54,429	129.07	7,025,151.03
TORONTO-DOMINION BANK	71,320	84.25	6,008,710.00
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	13,859	43.32	600,371.88
BROOKFIELD CORP	57,209	45.14	2,582,414.26
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	13,800	21.37	294,906.00
IGM FINANCIAL INC	3,335	40.92	136,468.20
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,250	46.46	104,535.00
ONEX CORPORATION	2,765	75.02	207,430.30
TMX GROUP LTD	10,850	29.88	324,198.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	972.87	875,583.00
GREAT-WEST LIFECO INC	11,324	39.12	442,994.88
IA FINANCIAL CORP INC	4,075	91.75	373,881.25
INTACT FINANCIAL CORP	7,215	195.97	1,413,923.55
MANULIFE FINANCIAL CORP	71,921	25.35	1,823,197.35
POWER CORP OF CANADA	20,479	37.38	765,505.02

	SUN LIFE FINANCIAL INC	24,774	68.00	1,684,632.00	
	CGI INC	8,030	140.59	1,128,937.70	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	810	2,751.46	2,228,682.60	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,740	105.79	395,654.60	
	OPEN TEXT CORP	11,190	55.24	618,135.60	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	47,780	90.63	4,330,301.40	
	BCE INC	3,000	57.65	172,950.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	13,875	57.95	804,056.25	
	TELUS CORP	12,662	23.92	302,875.04	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	10.66	288,672.80	
	ALTAGAS LTD	11,170	24.14	269,643.80	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	42.36	230,650.20	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	33.93	154,720.80	
	EMERA INC	10,460	54.02	565,049.20	
	FORTIS INC	19,055	56.51	1,076,798.05	
	HYDRO ONE LTD	13,230	38.00	502,740.00	
	NORTHLAND POWER INC	8,600	26.83	230,738.00	
	FIRSTSERVICE CORP	1,500	210.08	315,120.00	
加ドル小計		1,593,989		95,398,962.85	(10,040,740,839)
ユーロ	ENI SPA	89,476	13.29	1,189,493.94	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	18,755	10.92	204,804.60	
	NESTE OYJ	16,380	35.57	582,636.60	
	OMV AG	5,480	39.99	219,145.20	
	REPSOL SA	54,849	12.67	695,211.07	
	TENARIS SA	17,895	14.20	254,109.00	
	TOTALENERGIES SE	92,807	50.96	4,729,444.72	
	AIR LIQUIDE SA	20,509	159.44	3,269,954.96	
	AKZO NOBEL	6,937	73.10	507,094.70	
	ARCELORMITTAL	20,552	24.88	511,436.52	
	ARKEMA	2,215	90.62	200,723.30	
	BASF SE	37,045	45.21	1,674,804.45	
	COVESTRO AG	7,410	47.65	353,086.50	
	CRH PLC	30,060	50.82	1,527,649.20	
	DSM-FIRMENICH AG	7,552	100.94	762,298.88	

EVONIK INDUSTRIES AG	8,230	18.16	149,497.95
HEIDELBERG MATERIALS AG	5,715	71.36	407,822.40
OCI NV	4,810	22.84	109,860.40
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,050	33.46	302,813.00
SOLVAY SA	2,811	101.55	285,457.05
STORA ENSO OYJ-R SHS	19,785	11.32	223,966.20
SYMRISE AG	5,790	95.56	553,292.40
UMICORE	7,960	26.75	212,930.00
UPM-KYMMENE OYJ	21,098	28.55	602,347.90
VOESTALPINE AG	4,249	30.34	128,914.66
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,876	29.64	233,444.64
AIRBUS GROUP SE	23,238	133.52	3,102,737.76
ALSTOM	11,635	26.75	311,236.25
BOUYGUES SA	8,460	30.53	258,283.80
BRENTAG SE	5,605	68.72	385,175.60
CNH INDUSTRIAL NV	39,510	13.59	536,940.90
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	19,106	57.63	1,101,078.78
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	18,186	33.12	602,320.32
DASSAULT AVIATION SA	900	183.00	164,700.00
EIFFAGE	3,250	94.20	306,150.00
FERROVIAL SE	17,825	29.18	520,133.50
GEA GROUP AG	6,020	36.71	220,994.20
IMCD NV	2,120	135.15	286,518.00
KINGSPAN GROUP PLC	5,900	70.00	413,000.00
KNORR-BREMSE AG	2,970	65.14	193,465.80
KONE OYJ-B	13,614	47.23	642,989.22
LEGRAND SA	11,128	91.40	1,017,099.20
METSO CORPORATION	24,200	11.27	272,855.00
MTU AERO ENGINES AG	2,020	224.10	452,682.00
PRYSMIAN SPA	9,565	36.90	352,948.50
RATIONAL AG	230	627.50	144,325.00
RHEINMETALL AG	1,730	253.40	438,382.00
SAFRAN SA	13,080	137.00	1,791,960.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	21,248	160.44	3,409,029.12
SIEMENS AG-REG	29,806	149.92	4,468,515.52

SIEMENS ENERGY AG	21,343	15.44	329,642.63
THALES SA	4,015	138.10	554,471.50
VINCI SA	20,600	105.52	2,173,712.00
WARTSILA OYJ ABP	18,180	10.37	188,617.50
BUREAU VERITAS SA	10,920	23.93	261,315.60
RANDSTAD NV	4,675	51.64	241,417.00
TELEPERFORMANCE	2,240	154.30	345,632.00
WOLTERS KLUWER	10,027	113.25	1,135,557.75
ADP	1,090	129.10	140,719.00
AENA SA	2,870	141.80	406,966.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	8.72	208,424.64
DEUTSCHE POST AG-REG	39,823	45.82	1,824,888.97
GETLINK	17,310	15.71	271,940.10
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,355	106.80	1,426,314.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,210	98.25	217,132.50
CONTINENTAL AG	4,385	69.24	303,617.40
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	4,380	114.25	500,415.00
FERRARI NV	5,019	292.10	1,466,049.90
MERCEDES-BENZ GROUP AG	34,202	72.52	2,480,329.04
MICHELIN (CGDE)	23,556	27.21	640,958.76
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	53.38	302,664.60
RENAULT SA	8,247	38.22	315,200.34
STELLANTIS NV	90,796	16.60	1,507,576.78
VALEO SA	7,420	20.96	155,523.20
VOLKSWAGEN AG	1,151	150.10	172,765.10
VOLKSWAGEN AG-PFD	7,433	122.06	907,271.98
ADIDAS AG	6,571	172.64	1,134,417.44
HERMES INTERNATIONAL	1,272	1,912.20	2,432,318.40
KERING	3,007	490.25	1,474,181.75
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	10,854	859.00	9,323,586.00
MONCLER SPA	8,080	63.98	516,958.40
PUMA SE	4,200	56.38	236,796.00
SEB SA	987	96.60	95,344.20
ACCOR SA	6,056	33.90	205,298.40
AMADEUS IT GROUP SA	18,350	66.50	1,220,275.00

DELIVERY HERO SE	6,600	39.80	262,680.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,816	180.50	1,230,288.00
JUST EAT TAKEAWAY	10,350	15.01	155,415.60
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	35.46	138,294.00
SODEXO	3,240	97.54	316,029.60
BOLLORE SE	33,530	5.89	197,491.70
PUBLICIS GROUPE	9,305	72.42	673,868.10
SCOUT24 SE	2,970	58.40	173,448.00
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	27,730	21.18	587,321.40
VIVENDI SE	26,070	8.38	218,518.74
D'IETEREN GROUP	1,050	156.50	164,325.00
INDITEX	43,905	35.15	1,543,260.75
PROSUS	31,900	68.38	2,181,322.00
ZALANDO SE	8,260	28.02	231,445.20
CARREFOUR SA	22,633	17.20	389,400.76
HELLOFRESH SE	6,070	22.98	139,488.60
JERONIMO MARTINS	10,585	26.00	275,210.00
KESKO OYJ-B SHS	10,930	17.09	186,848.35
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	40,028	30.87	1,235,864.50
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	33,221	51.29	1,703,905.09
DANONE	24,624	55.21	1,359,491.04
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,850	12.71	252,392.75
HEINEKEN HOLDING NV	4,895	80.10	392,089.50
HEINEKEN NV	10,033	96.58	968,987.14
JDE PEET'S NV	4,010	26.82	107,548.20
KERRY GROUP PLC-A	6,460	88.32	570,547.20
PERNOD-RICARD SA	8,296	199.80	1,657,540.80
REMY COINTREAU	810	140.75	114,007.50
BEIERSDORF AG	4,015	116.20	466,543.00
HENKEL AG & CO KGAA	4,520	63.36	286,387.20
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,793	71.64	486,650.52
L'OREAL	9,436	413.95	3,906,032.20
AMPLIFON SPA	4,830	31.88	153,980.40
BIOMERIEUX	1,690	93.32	157,710.80
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	100.25	161,402.50

DIASORIN ITALIA SPA	930	92.20	85,746.00
ESSILORLUXOTTICA	11,505	175.08	2,014,295.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,613	47.61	362,454.93
FRESENIUS SE & CO KGAA	15,695	26.12	409,953.40
KONINKLIJKE PHILIPS NV	36,772	20.20	742,978.26
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,640	51.50	547,960.00
ARGENX SE	2,235	437.60	978,036.00
BAYER AG-REG	39,064	50.22	1,961,794.08
EUROFINS SCIENTIFIC	5,050	58.74	296,637.00
GRIFOLS SA	12,050	12.85	154,842.50
IPSEN	1,600	109.40	175,040.00
MERCK KGAA	5,150	148.80	766,320.00
ORION OYJ-CLASS B	4,500	33.00	148,500.00
QIAGEN N.V.	10,384	40.80	423,667.20
RECORDATI SPA	3,720	43.01	159,997.20
SANOFI	44,786	94.16	4,217,049.76
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	960	307.70	295,392.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	229.10	247,428.00
UCB SA	4,928	80.16	395,028.48
ABN AMRO BANK NV-CVA	15,170	15.10	229,067.00
AIB GROUP PLC	41,300	4.00	165,200.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	241,763	7.09	1,716,033.77
BANCO SANTANDER SA	662,389	3.44	2,284,248.46
BANK OF IRELAND GROUP PLC	44,790	9.24	414,217.92
BNP PARIBAS	43,422	56.71	2,462,461.62
CAIXABANK S.A	163,050	3.82	623,829.30
COMMERZBANK AG	40,474	11.13	450,677.99
CREDIT AGRICOLE SA	49,662	10.97	544,792.14
ERSTE GROUP BANK AG	13,018	33.18	431,937.24
FINECOBANK SPA	23,540	13.46	316,966.10
ING GROEP NV-CVA	146,925	12.89	1,893,863.25
INTESA SANPAOLO	658,093	2.43	1,602,456.45
KBC GROEP NV	9,719	66.50	646,313.50
MEDIOBANCA SPA	16,330	11.34	185,182.20
SOCIETE GENERALE	30,909	23.82	736,252.38

UNICREDIT SPA	73,256	22.02	1,613,097.12
ADYEN NV	865	1,547.20	1,338,328.00
AMUNDI SA	2,140	55.45	118,663.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	80,935	9.83	796,157.59
DEUTSCHE BOERSE AG	7,600	164.50	1,250,200.00
EDENRED	9,626	58.96	567,548.96
EURAZEO SE	1,487	61.15	90,930.05
EURONEXT NV	3,470	62.25	216,007.50
EXOR NV	4,164	82.08	341,781.12
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,452	71.80	247,853.60
NEXI SPA	21,240	7.40	157,176.00
SOFINA	655	191.60	125,498.00
WENDEL	1,000	91.75	91,750.00
WORLDLINE SA	8,950	33.70	301,615.00
AEGON NV	69,679	4.68	326,585.47
AGEAS	5,924	37.09	219,721.16
ALLIANZ SE-REG	15,793	210.20	3,319,688.60
ASSICURAZIONI GENERALI	42,248	18.88	797,853.48
AXA SA	75,752	26.46	2,004,397.92
HANNOVER RUECK SE-REG	2,275	191.20	434,980.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,626	335.40	1,886,960.40
NN GROUP NV	10,270	33.69	345,996.30
POSTE ITALIANE SPA	19,560	9.93	194,348.16
SAMPO OYJ-A SHS	19,639	38.42	754,530.38
TALANX AG	2,500	53.00	132,500.00
BECHTLE AG	3,070	38.24	117,396.80
CAP GEMINI SA	6,509	174.20	1,133,867.80
DASSAULT SYSTEMES SE	27,400	40.79	1,117,783.00
NEMETSCHEK SE	2,350	65.54	154,019.00
SAP SE	41,102	128.40	5,277,496.80
NOKIA OYJ	213,336	3.45	736,329.20
CELLNEX TELECOM SA	21,660	37.19	805,535.40
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	126,686	19.75	2,502,301.87
ELISA OYJ	6,005	49.65	298,148.25
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	11.97	181,584.90

	KONINKLIJKE KPN NV	122,956	3.26	401,451.34	
	ORANGE S.A.	72,804	10.50	765,024.43	
	TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.26	104,854.30	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	46,470	2.49	116,035.59	
	TELEFONICA SA	195,629	3.66	716,784.65	
	ACCIONA SA	830	137.95	114,498.50	
	E.ON SE	90,999	11.37	1,035,113.62	
	EDP RENOVAVEIS SA	11,156	17.97	200,473.32	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	126,131	4.30	542,741.69	
	ELIA GROUP SA/NV	1,356	111.10	150,651.60	
	ENAGAS SA	8,610	15.95	137,372.55	
	ENDESA SA	12,050	19.57	235,878.75	
	ENEL SPA	309,737	6.23	1,929,661.51	
	ENGIE	71,874	14.98	1,076,672.52	
	FORTUM OYJ	16,755	11.82	198,044.10	
	IBERDROLA SA	227,652	11.22	2,554,255.44	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	4,522	26.76	121,008.72	
	REDEIA CORP SA	15,580	15.00	233,777.90	
	RWE AG	25,835	39.23	1,013,507.05	
	SNAM SPA	91,120	4.69	427,626.16	
	TERNA SPA	53,627	7.54	404,454.83	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	25,530	28.94	738,838.20	
	VERBUND AG	2,780	72.30	200,994.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	1,935	410.90	795,091.50	
	ASML HOLDING NV	15,847	664.70	10,533,500.90	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	51,775	37.94	1,964,343.50	
	STMICROELECTRONICS NV	27,283	46.81	1,277,117.23	
	LEG IMMOBILIEN SE	3,010	59.34	178,613.40	
	VONOVIA SE	27,119	18.98	514,854.21	
ユーロ小計		7,143,876		187,218,287.60	(29,237,879,974)
英債券	BP PLC	693,248	4.52	3,136,253.95	
	SHELL PLC-NEW	268,977	23.08	6,207,989.16	
	ANGLO AMERICAN PLC	48,104	22.90	1,101,822.12	
	ANTOFAGASTA PLC	14,330	14.99	214,806.70	

CRODA INTERNATIONAL PLC	6,131	55.92	342,845.52
ENDEAVOUR MINING PLC	6,490	18.73	121,557.70
GLENCORE PLC	417,803	4.53	1,895,363.30
JOHNSON MATTHEY PLC	7,339	17.65	129,570.04
MONDI PLC	18,370	12.76	234,401.20
RIO TINTO PLC	44,725	50.86	2,274,713.50
ASHTED GROUP PLC	17,770	53.68	953,893.60
BAE SYSTEMS PLC ORD	124,235	9.18	1,140,725.77
BUNZL PLC	12,896	27.85	359,153.60
DCC PLC	3,820	43.72	167,010.40
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	321,031	1.46	469,186.80
SMITHS GROUP PLC	13,603	16.19	220,300.58
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,890	106.75	308,507.50
EXPERIAN PLC	37,408	29.92	1,119,247.36
INTERTEK GROUP PLC	6,025	41.20	248,230.00
RELX PLC	76,445	25.52	1,950,876.40
RENTOKIL INITIAL PLC	95,400	6.23	594,532.80
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	4.08	166,300.48
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,515	40.18	181,412.70
BURBERRY GROUP PLC	15,504	20.88	323,723.52
PERSIMMON PLC	12,440	10.47	130,246.80
TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.04	129,177.69
COMPASS GROUP PLC	72,268	21.24	1,534,972.32
ENTAIN PLC	24,860	12.52	311,247.20
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	8,263	53.70	443,723.10
PEARSON PLC	26,089	8.40	219,147.60
WHITBREAD PLC	8,110	33.38	270,711.80
AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	6.36	232,085.76
INFORMA PLC	56,580	7.36	416,768.28
WPP PLC	41,144	8.50	349,724.00
JD SPORTS FASHION PLC	97,350	1.52	148,556.10
KINGFISHER PLC	78,137	2.32	181,824.79
NEXT PLC	5,667	68.94	390,682.98
OCADO GROUP PLC	22,670	5.81	131,712.70
SAINSBURY (J) PLC	70,601	2.71	191,328.71

TESCO PLC	288,058	2.48	716,976.36
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,125	20.67	271,293.75
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	83,017	25.22	2,094,103.82
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	23.30	179,177.00
DIAGEO PLC	89,282	33.47	2,988,714.95
IMPERIAL BRANDS PLC	38,792	17.58	681,963.36
HALEON PLC	194,651	3.16	616,459.71
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	28,605	57.70	1,650,508.50
UNILEVER PLC	99,572	40.19	4,002,296.54
NMC HEALTH PLC	8,090	-	-
SMITH & NEPHEW PLC	33,906	11.82	400,768.92
ASTRAZENECA PLC	61,192	102.00	6,241,584.00
GSK PLC	160,770	13.18	2,119,913.22
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,740	18.18	104,353.20
BARCLAYS PLC	639,751	1.56	998,395.41
HSBC HOLDINGS PLC	784,161	6.17	4,845,330.81
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,649,936	0.44	1,188,231.30
NATWEST GROUP PLC	204,035	2.46	503,150.31
STANDARD CHARTERED PLC	95,420	6.88	657,252.96
3I GROUP PLC	36,819	19.27	709,502.13
ABRDN PLC	88,515	2.20	195,264.09
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	8.32	108,430.56
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	15,067	83.00	1,250,561.00
M&G PLC	99,522	1.88	187,947.29
SCHRODERS PLC	30,300	4.37	132,532.20
ST JAMES'S PLACE PLC	20,540	10.92	224,399.50
WISE PLC - A	21,400	6.72	143,850.80
ADMIRAL GROUP PLC	6,795	20.55	139,637.25
AVIVA PLC	94,524	3.87	365,902.40
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	225,651	2.23	505,232.58
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,230	5.38	162,879.24
PRUDENTIAL PLC	104,652	10.58	1,107,741.42
SAGE GROUP PLC/THE	38,840	9.27	360,279.84
HALMA PLC	14,690	22.12	324,942.80
BT GROUP PLC	267,752	1.23	329,334.96

	VODAFONE GROUP PLC	996,528	0.71	716,403.97	
	CENTRICA PLC	209,200	1.23	258,780.40	
	NATIONAL GRID PLC	140,528	10.17	1,429,872.40	
	SEVERN TRENT PLC	9,023	24.51	221,153.73	
	SSE PLC	43,667	17.78	776,617.59	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	9.51	248,415.18	
英債券小計		11,001,689		69,104,489.98	(12,556,285,829)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,990	13.28	106,107.20	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	690.00	186,300.00	
	GIVAUDAN-REG	378	2,944.00	1,112,832.00	
	HOLCIM LTD	22,219	58.66	1,303,366.54	
	SIG GROUP AG	10,900	25.06	273,154.00	
	SIKA AG-REG	5,505	253.00	1,392,765.00	
	ABB LTD-REG	61,275	33.89	2,076,609.75	
	GEBERIT AG-REG	1,490	465.40	693,446.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,070	196.50	210,255.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	203.40	301,032.00	
	VAT GROUP AG	1,015	374.30	379,914.50	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,817	32.95	224,620.15	
	SGS SA-REG	5,950	81.86	487,067.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,160	270.40	584,064.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	20,449	137.90	2,819,917.10	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,125	275.80	310,275.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,950	52.30	101,985.00	
	DUFREY AG-REG	3,460	43.29	149,783.40	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	130	1,635.00	212,550.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	40	10,810.00	432,400.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	106,400.00	425,600.00	
	NESTLE SA-REG	108,130	104.74	11,325,536.20	
	ALCON INC	19,554	72.62	1,420,011.48	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,051	234.70	481,369.70	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,370	141.20	617,044.00	
	BACHEM HOLDING AG	1,400	76.60	107,240.00	
	LONZA GROUP AG-REG	2,973	541.20	1,608,987.60	

	NOVARTIS AG-REG	80,943	84.92	6,873,679.56	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,020	289.20	294,984.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	27,743	268.20	7,440,672.60	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	970	96.05	93,168.50	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,420	56.92	479,266.40	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	900	920.00	828,000.00	
	UBS GROUP AG-REG	127,602	18.13	2,313,424.26	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,740	131.50	228,810.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	1,320	124.50	164,340.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,285	528.20	678,737.00	
	SWISS RE AG	12,289	90.38	1,110,679.82	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,881	408.30	2,401,212.30	
	TEMENOS AG	2,280	72.98	166,394.40	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	54.76	364,701.60	
	SWISSCOM AG-REG	1,024	555.80	569,139.20	
	BKW AG	840	152.40	128,016.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,441	81.50	280,441.50	
	スイスフラン小計	578,513		53,759,899.76	(8,682,761,410)
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	10,290	326.55	3,360,199.50	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,520	400.70	1,410,464.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	22,680	140.95	3,196,746.00	
	ALFA LAVAL AB	10,710	372.90	3,993,759.00	
	ASSA ABLOY AB-B	42,940	255.80	10,984,052.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	111,390	151.45	16,870,015.50	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	56,870	130.75	7,435,752.50	
	BEIJER REF AB	11,900	133.50	1,588,650.00	
	EPIROC AB-A	24,905	200.30	4,988,471.50	
	EPIROC AB-B	15,450	173.00	2,672,850.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	99.62	1,494,300.00	
	INDUTRADE AB	10,180	220.10	2,240,618.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	202.60	1,377,680.00	
	LIFCO AB-B SHS	8,470	203.50	1,723,645.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	63,000	94.20	5,934,600.00	
	SAAB AB-B	2,780	567.40	1,577,372.00	

	SANDVIK AB	40,890	204.10	8,345,649.00	
	SKANSKA AB-B SHS	14,390	155.15	2,232,608.50	
	SKF AB-B SHARES-B	14,079	186.30	2,622,917.70	
	VOLVO AB-A SHS	9,530	226.40	2,157,592.00	
	VOLVO AB-B SHS-B	58,430	220.70	12,895,501.00	
	SECURITAS AB-B SHS	17,788	87.08	1,548,979.04	
	VOLVO CAR AB-B	20,400	47.84	975,936.00	
	EVOLUTION AB	7,140	1,338.00	9,553,320.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,848	178.50	4,970,868.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	23,695	282.90	6,703,315.50	
	GETINGE AB-B SHS	9,470	184.15	1,743,900.50	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	7,130	205.80	1,467,354.00	
	NORDEA BANK ABP	131,132	119.02	15,607,330.64	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	62,450	123.50	7,712,575.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60,120	92.78	5,577,933.60	
	SWEDBANK AB - A SHARES	34,550	189.85	6,559,317.50	
	EQT AB	10,840	223.30	2,420,572.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	288.90	1,439,877.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	288.40	1,724,632.00	
	INVESTOR AB-A SHS	20,870	204.10	4,259,567.00	
	INVESTOR AB-B SHS	69,350	206.05	14,289,567.50	
	KINNEVIK AB - B	8,285	135.75	1,124,688.75	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,590	443.30	1,591,447.00	
	ERICSSON LM-B SHS	108,515	50.36	5,464,815.40	
	HEXAGON AB-B SHS	80,990	117.75	9,536,572.50	
	TELE2 AB-B SHS	23,245	88.48	2,056,717.60	
	TELIA CO AB	118,530	24.02	2,847,090.60	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	23,220	43.37	1,007,051.40	
	SAGAX AB-B	7,910	216.30	1,710,933.00	
	スウェーデンクローナ小計	1,442,236		210,997,805.33 (2,861,130,240)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	12,100	265.00	3,206,500.00	
	EQUINOR ASA	39,014	294.90	11,505,228.60	
	NORSK HYDRO A S	50,660	65.02	3,293,913.20	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,670	380.80	2,539,936.00	

	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,900	440.00	1,716,000.00	
	ADEVINTA ASA	11,400	68.55	781,470.00	
	MOWI ASA	16,360	169.00	2,764,840.00	
	ORKLA ASA	32,290	79.18	2,556,722.20	
	SALMAR ASA	3,590	425.30	1,526,827.00	
	DNB BANK ASA	35,845	201.10	7,208,429.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,410	154.10	1,141,881.00	
	TELENOR ASA	23,915	104.70	2,503,900.50	
ノルウェークローネ小計		243,154		40,745,648.00	(562,289,942)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,840	494.80	1,900,032.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,165	330.50	2,698,532.50	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	315	1,755.00	552,825.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	41,480	182.58	7,573,418.40	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	115	13,300.00	1,529,500.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	195	13,575.00	2,647,125.00	
	DSV A/S	7,250	1,469.50	10,653,875.00	
	PANDORA A/S	3,310	658.00	2,177,980.00	
	CARLSBERG AS-B	3,630	1,018.50	3,697,155.00	
	COLOPLAST-B	4,485	795.60	3,568,266.00	
	DEMANT A/S	3,640	263.60	959,504.00	
	GENMAB A/S	2,580	2,686.00	6,929,880.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	65,345	1,072.00	70,049,840.00	
	DANSKE BANK A/S	26,635	165.50	4,408,092.50	
TRYG A/S	13,945	132.65	1,849,804.25		
ORSTED A/S	7,570	624.80	4,729,736.00		
デンマーククローネ小計		192,500		125,925,565.65	(2,639,399,856)
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	30.18	264,829.50	
	SANTOS LTD	121,660	7.56	919,749.60	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	75,946	35.94	2,729,499.24	
	BHP GROUP LTD	199,987	45.26	9,051,411.62	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	20.07	367,481.70	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	65,915	22.49	1,482,428.35	
	IGO LTD	24,300	15.40	374,220.00	

JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	16,955	40.19	681,421.45	
MINERAL RESOURCES LTD	6,240	72.30	451,152.00	
NEWCREST MINING LTD	35,809	27.63	989,402.67	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42,190	13.41	565,767.90	
ORICA LIMITED	17,675	15.10	266,892.50	
PILBARA MINERALS LTD	124,830	5.12	639,129.60	
RIO TINTO LTD	13,468	117.85	1,587,203.80	
SOUTH32 LTD	207,787	3.94	818,680.78	
REECE LTD	10,200	18.79	191,658.00	
BRAMBLES LTD	54,798	14.16	775,939.68	
COMPUTERSHARE LTD	20,910	23.99	501,630.90	
AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	4.00	294,280.00	
QANTAS AIRWAYS LTD	35,030	6.42	224,892.60	
TRANSURBAN GROUP	129,996	14.14	1,838,143.44	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,520	39.39	926,452.80	
IDP EDUCATION LTD	10,150	22.69	230,303.50	
LOTTERY CORP LTD/THE	85,554	5.15	440,603.10	
REA GROUP LTD	1,820	149.26	271,653.20	
SEEK LTD	12,860	24.20	311,212.00	
WESFARMERS LTD	42,585	49.15	2,093,052.75	
COLES GROUP LTD	57,925	18.17	1,052,497.25	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	50,462	5.64	284,605.68	
WOOLWORTHS GROUP LTD	49,102	39.04	1,916,942.08	
TREASURY WINE ESTATES LTD	27,906	11.02	307,524.12	
COCHLEAR LTD	2,527	232.52	587,578.04	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,105	56.87	404,061.35	
SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	36.03	636,289.80	
CSL LTD	19,212	258.82	4,972,449.84	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	120,799	24.54	2,964,407.46	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	66,357	101.87	6,759,787.59	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	124,183	27.12	3,367,842.96	
WESTPAC BANKING CORP	140,651	21.43	3,014,150.93	
ASX LTD	7,105	61.37	436,033.85	
MACQUARIE GROUP LTD	14,604	183.02	2,672,824.08	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,370	31.78	265,998.60	

	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	5.70	542,212.50	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	108,430	3.47	376,252.10	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	55,210	15.06	831,462.60	
	SUNCORP GROUP LTD	44,036	13.78	606,816.08	
	WISETECH GLOBAL LTD	5,920	80.38	475,849.60	
	XERO LTD	4,930	124.41	613,341.30	
	TELSTRA GROUP LTD	164,284	4.31	708,064.04	
	APA GROUP	45,818	9.87	452,223.66	
	ORIGIN ENERGY LTD	68,320	8.58	586,185.60	
豪ドル小計		2,786,881		64,124,493.79 (6,070,024,582)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,165	8.31	391,941.15	
	EBOS GROUP LTD	5,630	38.00	213,940.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,130	24.58	568,535.40	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	5.01	384,033.65	
	MERCURY NZ LTD	34,100	6.40	218,240.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	57,830	5.40	312,282.00	
ニュージーランドドル小計		244,432		2,088,972.20 (183,641,546)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	103,208	47.70	4,923,021.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	52,500	87.05	4,570,125.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	71,000	12.04	854,840.00	
	MTR CORP	62,500	35.70	2,231,250.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	15.44	802,880.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	81,000	54.45	4,410,450.00	
	SANDS CHINA LTD	96,600	28.80	2,782,080.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	18.86	1,280,594.00	
	WH GROUP LTD	299,894	4.13	1,238,562.22	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	148,000	23.25	3,441,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	29,100	110.90	3,227,190.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	48,300	301.40	14,557,620.00	
	AIA GROUP LTD	460,390	80.50	37,061,395.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	9.11	1,366,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	40.85	1,021,250.00	
CLP HOLDINGS LTD	63,000	61.25	3,858,750.00		

	HONG KONG & CHINA GAS	456,237	6.52	2,974,665.24	
	POWER ASSETS HOLDINGS	58,000	40.65	2,357,700.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	80,538	44.35	3,571,860.30	
	ESR GROUP LTD	75,800	13.24	1,003,592.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	11.68	911,040.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	23.40	1,354,883.40	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	61,666	18.82	1,160,554.12	
	SINO LAND CO	123,050	9.54	1,173,897.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,480	97.45	5,893,776.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	17,517	62.45	1,093,936.65	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	19.02	791,232.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	39.80	2,539,240.00	
香港ドル小計		2,984,981		112,453,884.53	(1,998,305,528)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	53,360	6.84	364,982.40	
	SEATRUM LTD	1,488,177	0.14	209,832.95	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	63,300	3.64	230,412.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	7.42	399,938.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.94	199,489.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	3.78	279,568.80	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	71,195	32.47	2,311,701.65	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	134,240	12.45	1,671,288.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	49,900	27.71	1,382,729.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	32,800	9.47	310,616.00	
	VENTURE CORP LTD	9,900	15.04	148,896.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	354,480	2.58	914,558.40	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	105,000	3.41	358,050.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	6.98	120,754.00	
UOL GROUP LTD	15,550	6.76	105,118.00		
シンガポールドル小計		2,734,162		9,007,934.70	(946,643,857)
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	26,090	21.42	558,847.80	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,010	768.70	776,387.00	
	BANK HAPUALIM BM	46,265	31.54	1,459,198.10	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	62,565	28.71	1,796,241.15	

	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	48,330	19.02	919,236.60	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,900	130.40	899,760.00	
	NICE LTD	2,440	761.00	1,856,840.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	4,700	137.40	645,780.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,780	208.90	371,842.00	
イスラエルシュケル小計		200,080		9,284,132.65 (355,347,391)	
合 計		44,533,021		290,889,760,098 (290,889,760,098)	

(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	734,250.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	12,110	440,319.60	
		AMERICAN TOWER CORP	18,249	3,399,058.74	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	18,847	379,013.17	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,790	1,123,665.30	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,717	348,222.47	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,700	409,775.00	
		CROWN CASTLE INC	16,330	1,796,136.70	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,695	1,382,465.95	
		EQUINIX INC	3,658	2,954,091.06	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,550	440,291.00	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	15,450	1,048,282.50	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	601,474.40	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,290	827,461.80	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,340	547,835.40	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	14,810	279,612.80	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	431,338.75	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	27,179	474,001.76	
		INVITATION HOMES INC	25,700	907,981.00	
		IRON MOUNTAIN INC	10,815	662,743.20	

		KIMCO REALTY CORP	23,760	490,406.40	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,300	660,007.00	
		PROLOGIS INC	36,195	4,632,236.10	
		PUBLIC STORAGE	6,319	1,899,301.83	
		REALTY INCOME CORP	25,471	1,561,117.59	
		REGENCY CENTERS CORP	6,005	383,359.20	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,175	944,176.25	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	13,394	1,629,380.10	
		SUN COMMUNITIES INC	4,640	619,254.40	
		UDR INC	12,100	518,364.00	
		VENTAS INC	17,025	815,667.75	
		VICI PROPERTIES INC	39,120	1,234,236.00	
		WELLTOWER INC	20,360	1,614,140.80	
		WEYERHAEUSER CO	29,998	1,029,831.34	
		WP CAREY INC	8,610	599,772.60	
米ドル小計			493,807	37,819,271.96	(5,252,340,489)
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	147,028.00	
加ドル小計			2,800	147,028.00	(15,474,697)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	85,932.00	
		GECINA SA	1,950	190,320.00	
		KLEPIERRE	8,402	200,135.64	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,990	260,278.40	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,730	209,483.00	
ユーロ小計			24,997	946,149.04	(147,760,095)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	30,601	97,586.58	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	161,607.68	
		SEGRO PLC	45,033	330,272.02	
英ポンド小計			102,258	589,466.28	(107,106,023)
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	42,067	343,687.39	
		GOODMAN GROUP	70,642	1,464,408.66	
		GPT GROUP	71,335	303,887.10	

		LENDLEASE GROUP	23,367	199,787.85	
		MIRVAC GROUP	159,875	375,706.25	
		SCENTRE GROUP	198,271	547,227.96	
		STOCKLAND	102,400	428,032.00	
		VICINITY CENTRES	154,902	298,960.86	
豪ドル小計			822,859	3,961,698.07 (375,014,339)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	104,160	4,557,000.00	
香港ドル小計			104,160	4,557,000.00 (80,977,890)	
シンガ ポール ドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,243	388,462.83	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	419,112.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	144,556	248,636.32	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	106,000	178,080.00	
シンガポールドル小計			598,355	1,234,291.15 (129,711,656)	
合計				6,108,385,189 (6,108,385,189)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 604銘柄	97.6%		72.5%
	投資証券 35銘柄		2.4%	1.8%
加ドル	株式 85銘柄	99.8%		3.4%
	投資証券 1銘柄		0.2%	0.0%
ユーロ	株式 219銘柄	99.5%		9.8%
	投資証券 5銘柄		0.5%	0.0%
英ポンド	株式 80銘柄	99.2%		4.2%
	投資証券 3銘柄		0.8%	0.0%
スイスフラン	株式 44銘柄	100.0%		2.9%
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	94.2%		2.0%
	投資証券	8銘柄		5.8%	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	96.1%		0.7%
	投資証券	1銘柄		3.9%	0.0%
シンガポールドル	株式	15銘柄	87.9%		0.3%
	投資証券	4銘柄		12.1%	0.0%
イスラエルシケル	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。

インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	339,440	217,043
親投資信託受益証券	31,865,996	21,269,616
未収入金	107,772	-
流動資産合計	32,313,208	21,486,659
資産合計	32,313,208	21,486,659
負債の部		
流動負債		
未払解約金	108,801	-
未払受託者報酬	115	625
未払委託者報酬	230	1,268
その他未払費用	19,303	11,974
流動負債合計	128,449	13,867
負債合計	128,449	13,867
純資産の部		
元本等		
元本	20,495,177	13,529,256

剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	11,689,582	7,943,536
（分配準備積立金）	14,013,050	9,239,254
元本等合計	32,184,759	21,472,792
純資産合計	32,184,759	21,472,792
負債純資産合計	32,313,208	21,486,659

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）

		2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
1.	期首	2021年 7月20日	2022年 7月20日
	期首元本額	32,023,021円	20,495,177円
	期首からの追加設定元本額	1,819,544円	1,238,466円
	期首からの一部解約元本額	13,347,388円	8,204,387円
2.	受益権の総数	20,495,177口	13,529,256口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19日	自 2022年 7月20日 至 2023年 7月18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 7月19日現在	2023年 7月18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 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	357,921
合計	357,921

(2023年 7月18日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	530,508
合計	530,508

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2022年 7月19日現在		2023年 7月18日現在	
1口当たり純資産額	1.5704円	1口当たり純資産額	1.5871円
(1万口当たり純資産額)	(15,704円)	(1万口当たり純資産額)	(15,871円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	7,247,382	21,269,616	
合計		7,247,382	21,269,616	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

あります。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
資産の部		
流動資産		
預金	430,957,940	259,183,866
コール・ローン	36,906,989	21,508,378
投資証券	57,561,082,946	54,682,739,536
未収入金	-	96,626
未収配当金	92,708,732	105,227,520
流動資産合計	58,121,656,607	55,068,755,926
資産合計	58,121,656,607	55,068,755,926
負債の部		
流動負債		
未払解約金	229,792	102,878
未払利息	13	23
流動負債合計	229,805	102,901
負債合計	229,805	102,901
純資産の部		
元本等		
元本	20,086,743,422	18,764,184,479
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	38,034,683,380	36,304,468,546
元本等合計	58,121,426,802	55,068,653,025
純資産合計	58,121,426,802	55,068,653,025
負債純資産合計	58,121,656,607	55,068,755,926

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 7月19日現在	2023年 7月18日現在
1.	期首	2021年 7月20日	2022年 7月20日
	期首元本額	29,567,818,913円	20,086,743,422円
	期首からの追加設定元本額	3,107,333,234円	5,400,996,903円
	期首からの一部解約元本額	12,588,408,725円	6,723,555,846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	2,079,035,201円	2,252,709,436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）	11,012,959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）	17,723,269,179円	16,270,798,059円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	- 円	7,030,624円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	- 円	428,355円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	- 円	418,705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）	273,426,083円	225,551,918円
	計	20,086,743,422円	18,764,184,479円
2.	受益権の総数	20,086,743,422口	18,764,184,479口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19日	自 2022年 7月20日 至 2023年 7月18日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 7月19日現在	2023年 7月18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 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1,851,543,863
合計	1,851,543,863

(2023年 7月18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	1,446,426,109
合計	1,446,426,109

(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 7月19日現在		2023年 7月18日現在	
1口当たり純資産額	2.8935円	1口当たり純資産額	2.9348円
(1万口当たり純資産額)	(28,935円)	(1万口当たり純資産額)	(29,348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	28,058	425,078.70	
		AGREE REALTY CORPORATION	27,936	1,835,953.92	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	21,451	403,064.29	
		ALEXANDER'S INC	614	110,962.08	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	46,982	5,519,445.36	

ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	4,274	69,922.64	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	15,887	331,243.95	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	93,779	3,409,804.44	
AMERICOLD REALTY TRUST INC	80,680	2,629,361.20	
APARTMENT INCOME REIT CO	44,682	1,597,381.50	
APARTMENT INVT&MGMT CO -A	44,370	388,237.50	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	63,490	965,048.00	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	19,895	244,111.65	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,534	46,501.14	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	42,409	8,230,314.63	
BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,014	16,391.31	
BOSTON PROPERTIES INC	42,602	2,594,887.82	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	14,272	55,232.64	
BRANDYWINE REALTY TRUST	51,006	232,077.30	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	89,573	2,028,828.45	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	55,948	892,370.60	
BRT APARTMENTS CORP	3,398	68,469.70	
CAMDEN PROPERTY TRUST	31,871	3,529,713.25	
CARETRUST REIT INC	29,799	601,045.83	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,316	164,829.48	
CENTERSPACE	4,468	285,058.40	
CHATHAM LODGING TRUST	13,778	131,993.24	
CITY OFFICE REIT INC	11,825	65,510.50	
CLIPPER REALTY INC	5,351	32,480.57	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	7,131	256,216.83	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	33,805	850,871.85	
COUSINS PROPERTIES INC	45,190	1,069,195.40	
CTO REALTY GROWTH INC	5,718	100,350.90	
CUBESMART	67,072	3,122,201.60	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	62,170	495,494.90	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	99,300	49,153.50	
DIGITAL REALTY TRUST INC	86,976	10,281,432.96	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	71,305	191,097.40	
DOUGLAS EMMETT INC	50,784	684,568.32	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	68,595.90	

EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	28,253	405,713.08	
EASTGROUP PROPERTIES INC	13,252	2,461,691.52	
ELME COMMUNITIES	26,242	429,319.12	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	39,125	311,435.00	
EPR PROPERTIES	22,458	1,013,978.70	
EQUINIX INC	27,919	22,546,546.83	
EQUITY COMMONWEALTH	33,470	681,783.90	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	52,304	3,515,874.88	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	101,856	6,910,929.60	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	44,333	1,104,778.36	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	19,176	4,650,755.28	
EXTRA SPACE STORAGE INC	40,309	6,305,133.78	
FARMLAND PARTNERS INC	14,550	186,676.50	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	21,900	2,206,863.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	39,516	2,154,017.16	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	26,131	686,200.06	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	26,426	43,602.90	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	78,455	3,790,161.05	
GETTY REALTY CORPORATION	13,601	448,560.98	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	12,252	162,339.00	
GLADSTONE LAND CORP	9,246	157,459.38	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	17,698	174,856.24	
GLOBAL NET LEASE INC	31,787	346,160.43	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	113,926	2,150,922.88	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	163,656	3,464,597.52	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	11,024	69,671.68	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	31,493	797,087.83	
HOST HOTELS & RESORTS INC	212,218	3,701,081.92	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	37,276	190,480.36	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	66,513	1,177,945.23	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	18,190	70,759.10	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	8,329	640,666.68	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	20,149	485,389.41	
INVITATION HOMES INC	173,559	6,131,839.47	
IRON MOUNTAIN INC	87,019	5,332,524.32	

JBG SMITH PROPERTIES	29,176	463,314.88	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	219,100	73,398.50	
KILROY REALTY CORPORATION	31,445	1,027,937.05	
KIMCO REALTY CORP	184,813	3,814,540.32	
KITE REALTY GROUP TRUST	65,310	1,502,130.00	
LIFE STORAGE INC	25,381	3,548,771.42	
LTC PROPERTIES INC	12,450	424,794.00	
LXP INDUSTRIAL TRUST	87,480	907,167.60	
MACERICH CO/THE	64,224	762,338.88	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	511,247	86,400.74	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	178,472	1,757,949.20	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	34,833	5,346,517.17	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	24,462	887,725.98	
NATL HEALTH INVESTORS INC	12,993	699,023.40	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	39,971	290,589.17	
NETSTREIT CORP	18,310	322,072.90	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	9,913	126,192.49	
NEXPOINT RESIDENTIAL	6,746	323,335.78	
NNN REIT INC	54,551	2,354,966.67	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	15,503	125,884.36	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	70,098	2,258,557.56	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,571	94,939.67	
ORION OFFICE REIT INC	16,327	107,758.20	
PARAMOUNT GROUP INC	48,659	238,429.10	
PARK HOTELS & RESORTS INC	64,244	839,026.64	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	36,506	506,703.28	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	35,128	1,190,136.64	
PHYSICIANS REALTY TRUST	71,499	1,025,295.66	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	36,915	286,460.40	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	11,731	271,455.34	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	5,728	85,805.44	
PRIME US REIT	184,200	40,524.00	
PROLOGIS INC	275,632	35,275,383.36	
PUBLIC STORAGE	47,240	14,198,926.80	
REALTY INCOME CORP	201,085	12,324,499.65	

REGENCY CENTERS CORP	45,948	2,933,320.32	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	37,117	520,009.17	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	59,871	3,244,409.49	
RLJ LODGING TRUST	47,501	475,485.01	
RPT REALTY	25,552	280,049.92	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	17,614	1,644,443.04	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	69,238	871,706.42	
SAFEHOLD INC	12,062	288,281.80	
SAUL CENTERS INC	3,710	140,868.70	
SERVICE PROPERTIES TRUST	49,184	435,770.24	
SIMON PROPERTY GROUP INC	97,626	11,876,202.90	
SITE CENTERS CORP	54,116	765,741.40	
SL GREEN REALTY CORP	19,199	605,344.47	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	42,196	1,729,192.08	
STAG INDUSTRIAL INC	53,579	2,034,394.63	
STAR HOLDINGS	4,193	61,133.94	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	31,927	203,055.72	
SUN COMMUNITIES INC	37,141	4,956,837.86	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	61,796	614,252.24	
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	31,459	728,275.85	
TERRENO REALTY CORP	22,093	1,319,614.89	
UDR INC	92,484	3,962,014.56	
UMH PROPERTIES INC	17,055	277,655.40	
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	3,797	182,483.82	
URBAN EDGE PROPERTIES	34,938	572,633.82	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	8,655	190,929.30	
VENTAS INC	119,438	5,722,274.58	
VERIS RESIDENTIAL INC	24,424	408,125.04	
VICI PROPERTIES INC	299,596	9,452,253.80	
VORNADO REALTY TRUST	48,155	893,756.80	
WELLTOWER INC	148,365	11,762,377.20	
WHITESTONE REIT	13,565	134,293.50	
WP CAREY INC	63,957	4,455,244.62	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	32,979	408,280.02	
	8,089,497	306,721,967.60	

米ドル小計				(42,597,546,860)
加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	19,184	419,937.76
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,987	114,307.05
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	6,925	81,091.75
		BOARDWALK EQUITIES INC	6,678	440,347.32
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	5,270	96,493.70
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	12,031	39,702.30
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	24,734	1,298,782.34
		CHOICE PROPERTIES REIT	48,761	650,471.74
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,026	218,915.16
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	16,654	254,306.58
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	38,160	547,214.40
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	4,671	63,525.60
		EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	13,127	37,543.22
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	31,571	454,622.40
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	9,291	726,927.84
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	39,122	404,130.26
		INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	7,000	24,850.00
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	20,318	259,054.50
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	16,982	301,600.32
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,756	87,260.96
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	5,901	98,723.73
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	9,851	83,634.99
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	35,019	231,125.40
		PRIMARIS REIT	13,930	184,711.80
		PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	7,180	38,628.40
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	44,188	872,271.12
SLATE GROCERY REIT	7,517	100,502.29		
SLATE OFFICE REIT	11,959	23,439.64		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	21,172	522,524.96		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	12,783	32,213.16		
加ドル小計			527,748	8,708,860.69
				(916,607,587)
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	14,055	884,762.25
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	2,768	14,227.52

		ALTAREA	1,386	142,758.00	
		CARE PROPERTY INVEST	10,835	137,171.10	
		CARMILA	17,404	268,021.60	
		COFINIMMO	9,201	667,072.50	
		COVIVIO	13,846	618,085.44	
		CROMWELL REIT EUR	108,060	171,815.40	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	12,607	274,328.32	
		GECINA SA	16,275	1,588,440.00	
		HAMBORNER REIT AG	21,815	138,743.40	
		ICADE	9,502	350,813.84	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	15,466	38,278.35	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	90,068	489,519.58	
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	8,508	118,261.20	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	134,022	123,970.35	
		KLEPIERRE	58,174	1,385,704.68	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	19,678	118,068.00	
		MERCIALYS	22,993	193,256.16	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	100,151	818,734.42	
		MONTEA	4,032	295,142.40	
		NSI NV	5,548	108,740.80	
		RETAIL ESTATES	3,368	197,364.80	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	31,934	1,665,677.44	
		VASTNED RETAIL	5,153	101,617.16	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	46,157	1,250,854.70	
		WERELDHAVE NV	11,782	179,557.68	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	7,427	204,613.85	
			802,215	12,545,600.94	
				(1,959,246,498)	
ユーロ小計					
英債券	投資証券	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	112,049	54,119.66	
		AEW UK REIT PLC	45,713	43,975.90	
		ASSURA PLC	893,682	411,808.66	
		BALANCED COMM PROPERTY TRUST	242,843	163,433.33	
		BIG YELLOW GROUP PLC	52,156	549,202.68	
		BRITISH LAND COMPANY PLC	280,320	893,940.48	
		CLS HOLDINGS PLC	52,986	73,014.70	

		CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	131,268	111,052.72	
		DERWENT LONDON PLC	33,627	684,645.72	
		EDISTON PROPERTY INVESTMENT	76,805	45,468.56	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	188,560	164,990.00	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	75,428	302,466.28	
		HAMMERSON PLC	1,177,699	281,234.52	
		HELICAL PLC	33,388	84,972.46	
		HOME REIT PLC	256,438	97,574.65	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	122,092	108,173.51	
		INTU PROPERTIES PLC	758,746		
		LAND SECURITIES GROUP PLC	224,356	1,361,840.92	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	292,968	497,752.63	
		LXI REIT PLC	511,272	459,377.89	
		NEWRIVER REIT PLC	90,272	76,640.92	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	161,766	112,912.66	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	404,010	374,113.26	
		PRS REIT PLC/THE	163,652	133,049.07	
		REGIONAL REIT LTD	147,696	65,946.26	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	64,695	550,554.45	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	181,830	76,186.77	
		SEGRO PLC	365,316	2,679,227.54	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	582,977	654,100.19	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	382,697	280,516.90	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	122,256	67,974.33	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	557,236	721,620.62	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	254,031	127,015.50	
		UNITE GROUP PLC	119,085	1,083,078.07	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	136,542	157,569.46	
		WAREHOUSE REIT PLC	119,144	96,149.20	
		WORKSPACE GROUP PLC	40,886	194,290.27	
英ポンド小計			9,456,487	13,839,990.74 (2,514,726,317)	
豪ドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	125,940	340,038.00	
		ARENA REIT	103,938	379,373.70	
		BWP TRUST	149,523	551,739.87	

		CENTURIA CAPITAL GROUP	205,811	346,791.53	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	166,023	519,651.99	
		CENTURIA OFFICE REIT	145,435	207,244.87	
		CHARTER HALL GROUP	141,191	1,616,636.95	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	198,134	816,312.08	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	155,493	583,098.75	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	98,339	290,100.05	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	422,166	236,412.96	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	61,940	170,335.00	
		DEXUS/AU	323,857	2,645,911.69	
		GDI PROPERTY GROUP	181,454	120,666.91	
		GOODMAN GROUP	510,877	10,590,480.21	
		GPT GROUP	576,077	2,454,088.02	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	88,622	252,572.70	
		HEALTHCO REIT	135,075	186,403.50	
		HMC CAPITAL LTD	72,110	372,808.70	
		HOMEKO DAILY NEEDS REIT	461,202	548,830.38	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	56,982	176,644.20	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	113,336	447,677.20	
		MIRVAC GROUP	1,185,091	2,784,963.85	
		NATIONAL STORAGE REIT	369,868	850,696.40	
		RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	132,547	91,457.43	
		REGION RE LTD	348,986	827,096.82	
		RURAL FUNDS GROUP	113,146	222,897.62	
		SCENTRE GROUP	1,557,855	4,299,679.80	
		STOCKLAND	715,213	2,989,590.34	
		VICINITY CENTRES	1,161,559	2,241,808.87	
		WAYPOINT REIT	208,543	542,211.80	
豪ドル小計			10,286,333	38,704,222.19	(3,663,741,672)
ニュー ジーラン ドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	398,655	885,014.10	
		STRIDE PROPERTY GROUP	282,133	394,986.20	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	216,357	506,275.38	
ニュージーランドドル小計			897,145	1,786,275.68	(157,031,495)

香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	573,000	1,627,320.00	
		FORTUNE REIT	436,900	2,516,544.00	
		LINK REIT	763,180	33,389,125.00	
		PROSPERITY REIT	411,000	706,920.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	331,000	973,140.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	733,110	1,209,631.50	
香港ドル小計			3,248,190	40,422,680.50	(718,311,032)
シンガポールドル	投資証券	AIMS APAC REIT	177,217	219,749.08	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,009,332	2,836,222.92	
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	664,792	737,919.12	
		CAPITALAND CHINA TRUST	353,785	367,936.40	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,506,992	3,013,984.00	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	249,600	302,016.00	
		DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	173,500	104,100.00	
		EC WORLD REIT	70,300	21,090.00	
		ESR-LOGOS REIT	1,936,019	667,926.55	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	311,400	199,296.00	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	428,740	113,616.10	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	324,705	707,856.90	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	862,660	1,104,204.80	
		KEPPEL DC REIT	398,677	881,076.17	
		KEPPEL REIT	596,500	545,797.50	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	570,652	385,190.10	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	602,208	1,360,990.08	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	991,587	1,705,529.64	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	690,131	1,159,420.08	
		QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	729,735	226,217.85	
PARAGON REIT	332,100	315,495.00			
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	118,700	453,434.00			
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	169,400	121,121.00			
STARHILL GLOBAL REIT	426,600	221,832.00			
SUNTEC REIT	682,300	886,990.00			
シンガポールドル小計			14,377,632	18,659,011.29	(1,960,875,496)

韓国ウォン	投資証券	D&D PLATFORM REIT CO LTD	16,715	53,655,150.00	
		E KOCREF CR-REIT CO LTD	8,770	45,340,900.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	49,349	197,149,255.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,591	53,028,825.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT-RIGHTS	4,636	607,316.00	
		JR REIT XXVII	46,352	193,751,360.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	13,627	76,720,010.00	
		LOTTE REIT CO LTD	39,257	143,680,620.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	8,226	34,878,240.00	
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,699	43,748,055.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	23,648	146,144,640.00	
		SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	9,014	29,791,270.00	
		SK REITS CO LTD	24,438	122,434,380.00	
韓国ウォン小計			268,322	1,140,930,021.00 (125,388,209)	
イスラエルシェケル	投資証券	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	197,292	327,110.13	
		REIT 1 LTD	60,560	987,128.00	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	63,926	495,426.50	
イスラエルシェケル小計			321,778	1,809,664.63 (69,264,370)	
合計				54,682,739,536 (54,682,739,536)	

(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 144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%	3.6%
英ポンド	投資証券 37銘柄	100.0%	4.6%
豪ドル	投資証券 31銘柄	100.0%	6.7%
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%	1.3%
シンガポールドル	投資証券	25銘柄	100.0%	3.6%
韓国ウォン	投資証券	13銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	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。

インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	118,473	60,277
親投資信託受益証券	8,448,946	5,852,909
流動資産合計	8,567,419	5,913,186
資産合計	8,567,419	5,913,186
負債の部		
流動負債		
未払解約金	26,864	-
未払受託者報酬	241	164
未払委託者報酬	519	341
その他未払費用	5,833	3,698
流動負債合計	33,457	4,203
負債合計	33,457	4,203
純資産の部		
元本等		
元本	7,307,768	4,315,172
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,226,194	1,593,811
（分配準備積立金）	2,256,665	1,629,246
元本等合計	8,533,962	5,908,983
純資産合計	8,533,962	5,908,983
負債純資産合計	8,567,419	5,913,186

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）

		2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
1.	期首	2021年 7月20日	2022年 7月20日
	期首元本額	9,085,632円	7,307,768円
	期首からの追加設定元本額	902,799円	33,725円
	期首からの一部解約元本額	2,680,663円	3,026,321円
2.	受益権の総数	7,307,768口	4,315,172口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19日	自 2022年 7月20日 至 2023年 7月18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 7月19日現在	2023年 7月18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 7月19日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（2023年 7月18日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	75,132
合計	75,132

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2022年 7月19日現在		2023年 7月18日現在	
1口当たり純資産額	1.1678円	1口当たり純資産額	1.3694円
(1万口当たり純資産額)	(11,678円)	(1万口当たり純資産額)	(13,694円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド	3,664,940	5,852,909	
合計		3,664,940	5,852,909	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
資産の部		

流動資産		
預金	50,716,637	83,363,241
コール・ローン	46,887,690	26,565,690
国債証券	7,367,156,915	10,545,916,162
派生商品評価勘定	92,021	-
未収利息	112,888,029	153,223,417
前払費用	8,801,671	17,568,345
流動資産合計	7,586,542,963	10,826,636,855
資産合計		
	7,586,542,963	10,826,636,855
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	40,906	-
未払金	28,636,947	62,923,471
未払解約金	-	10,917,673
未払利息	17	28
流動負債合計	28,677,870	73,841,172
負債合計	28,677,870	73,841,172
純資産の部		
元本等		
元本	5,576,007,441	6,733,074,792
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,981,857,652	4,019,720,891
元本等合計	7,557,865,093	10,752,795,683
純資産合計	7,557,865,093	10,752,795,683
負債純資産合計	7,586,542,963	10,826,636,855

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 7月19日現在	2023年 7月18日現在
1.	期首	2021年 7月20日	2022年 7月20日
	期首元本額	5,006,114,052円	5,576,007,441円
	期首からの追加設定元本額	855,749,540円	1,312,972,255円
	期首からの一部解約元本額	285,856,151円	155,904,904円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外新興国（エマージング）債券（1年決算型）	5,569,773,896円	6,727,871,145円
	インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）	6,233,545円	3,664,940円
	N i つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	- 円	783,596円
	N i つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	- 円	755,111円
	計	5,576,007,441円	6,733,074,792円
2.	受益権の総数	5,576,007,441口	6,733,074,792口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19日	自 2022年 7月20日 至 2023年 7月18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 7月19日現在	2023年 7月18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 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	47,301,369
合計	47,301,369

(2023年 7月18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	118,738,778
合計	118,738,778

(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 7月19日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	20,333,770	-	20,378,203	44,433
	米ドル	929,512	-	921,558	7,954
	チェココルナ	8,441,236	-	8,466,002	24,766
	ポーランドズロチ	4,797,400	-	4,857,973	60,573
	南アフリカランド	6,165,622	-	6,132,670	32,952
	売建	929,512	-	922,830	6,682
	エジプトボンド	929,512	-	922,830	6,682
合計		21,263,282	-	21,301,033	51,115

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

(3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(2023年 7月18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 7月19日現在		2023年 7月18日現在	
1口当たり純資産額	1.3554円	1口当たり純資産額	1.5970円
(1万口当たり純資産額)	(13,554円)	(1万口当たり純資産額)	(15,970円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	10,000,000.00	9,696,875.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	9,610,000.00	9,546,934.37	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-25/03/06	8,400,000.00	7,764,750.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	15,400,000.00	14,066,937.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	10,500,000.00	9,305,625.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	12,130,000.00	11,508,337.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	10,260,000.00	10,160,606.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	14,550,000.00	13,745,203.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-33/05/26	6,000,000.00	5,525,625.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	4,000,000.00	3,722,500.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	3,030,000.00	3,338,681.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	8,190,000.00	7,982,690.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	9,160,000.00	8,229,687.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	9,080,000.00	8,345,087.50	
MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-53/07/31	4,300,000.00	3,922,406.25			
メキシコペソ小計			134,610,000.00	126,861,946.86 (1,053,486,979)	

ブラジル リアル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL-10.25%- 28/01/10	250,000.00	243,046.87	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-24/07/01	3,450,000.00	3,108,265.95	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-25/07/01	5,400,000.00	4,449,070.57	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-26/01/01	7,000,000.00	5,494,308.17	
		LETRA TESOIRO NACIONAL-0.0%-26/07/01	8,600,000.00	6,431,761.54	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%- 25/01/01	5,040,000.00	4,980,974.64	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%- 27/01/01	4,500,000.00	4,457,287.30	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%- 29/01/01	4,090,000.00	3,995,829.54	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%- 31/01/01	1,800,000.00	1,741,023.34	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL-10.0%- 33/01/01	1,650,000.00	1,580,957.20	
ブラジルリアル小計			41,780,000.00	36,482,525.12	(1,053,141,052)
チリペソ	国債証券	BONOS TESORERIA PESOS-2.5%-25/03/01	215,000,000.00	202,623,546.50	
		BONOS TESORERIA PESOS-4.5%-26/03/01	185,000,000.00	180,144,101.50	
		BONOS TESORERIA PESOS-5.0%-28/10/01	150,000,000.00	147,853,440.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-2.3%-28/10/01	100,000,000.00	86,559,100.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-4.7%-30/09/01	180,000,000.00	174,185,352.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-6.0%-33/04/01	175,000,000.00	185,316,985.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-7.0%-34/05/01	75,000,000.00	85,917,063.75	
		BONOS TESORERIA PESOS-5.0%-35/03/01	210,000,000.00	207,466,497.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-6.0%-43/01/01	145,000,000.00	160,234,744.00	
チリペソ小計			1,435,000,000.00	1,430,300,829.75	(242,754,947)
コロンビ アペソ	国債証券	TITULOS DE TESORERIA-5.75%-27/11/03	1,300,000,000.00	1,125,312,500.00	
		TITULOS DE TESORERIA-7.0%-31/03/26	1,410,000,000.00	1,194,975,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA-13.25%-33/02/09	600,000,000.00	712,710,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA-6.25%-36/07/09	450,000,000.00	328,359,375.00	
		TITULOS DE TESORERIA-9.25%-42/05/28	1,400,000,000.00	1,277,062,500.00	
		TITULOS DE TESORERIA-7.25%-50/10/26	1,450,000,000.00	1,049,437,500.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-10.0%-24/07/24	1,085,000,000.00	1,095,171,875.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-6.25%-25/11/26	900,000,000.00	840,937,500.00	

		TITULOS DE TESORERIA B-7.5%-26/08/26	1,720,000,000.00	1,625,400,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-6.0%-28/04/28	1,580,000,000.00	1,363,243,750.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.75%-30/09/18	1,335,000,000.00	1,197,745,312.50	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-32/06/30	1,320,000,000.00	1,092,712,500.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.25%-34/10/18	1,340,000,000.00	1,091,262,500.00	
コロンビアペソ小計			15,890,000,000.00	13,994,330,312.50	(480,901,166)
ペルーヌエボソル	国債証券	BONOS DE TESORERIA-5.7%-24/08/12	310,000.00	307,622.61	
		BONOS DE TESORERIA-6.35%-28/08/12	810,000.00	816,559.38	
		BONOS DE TESORERIA-5.94%-29/02/12	1,200,000.00	1,179,297.00	
		BONOS DE TESORERIA-6.15%-32/08/12	1,050,000.00	1,010,119.95	
		BONOS DE TESORERIA-5.4%-34/08/12	800,000.00	714,807.59	
		BONOS DE TESORERIA-5.35%-40/08/12	450,000.00	384,348.15	
		PERU BONO SOBERANO-8.2%-26/08/12	640,000.00	676,280.32	
		PERU BONO SOBERANO-6.95%-31/08/12	840,000.00	856,876.44	
		PERU BONO SOBERANO-6.9%-37/08/12	770,000.00	775,600.98	
ペルーヌエボソル小計			6,870,000.00	6,721,512.42	(262,237,118)
ウルグアイペソ	国債証券	REPUBLICA ORIENT URUGUAY-8.5%-28/03/15	1,300,000.00	1,256,419.12	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY-8.25%-31/05/21	4,500,000.00	4,216,568.85	
ウルグアイペソ小計			5,800,000.00	5,472,987.97	(19,955,061)
ドミニカペソ	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC-13.625%-33/02/03	8,000,000.00	9,940,000.00	
ドミニカペソ小計			8,000,000.00	9,940,000.00	(24,651,200)
セルビアディナール	国債証券	SERBIA TREASURY BONDS-4.5%-26/01/11	5,600,000.00	5,515,725.60	
		SERBIA TREASURY BONDS-5.875%-28/02/08	9,300,000.00	9,564,185.10	
		SERBIA TREASURY BONDS-4.5%-32/08/20	10,500,000.00	9,340,327.50	
セルビアディナール小計			25,400,000.00	24,420,238.20	(32,509,442)
トルコリラ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND-10.4%-24/03/20	350,000.00	339,325.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-9.0%-24/07/24	1,160,000.00	1,094,460.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-8.0%-25/03/12	820,000.00	763,830.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-12.6%-25/10/01	2,300,000.00	2,432,250.00	

		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.6%-26/02/11	1,160,000.00	1,069,520.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-16.9%-26/09/02	2,500,000.00	2,675,000.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-11.0%-27/02/24	810,000.00	729,000.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.5%-27/08/11	3,640,000.00	3,112,200.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-12.4%-28/03/08	3,050,000.00	2,610,800.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-11.7%-30/11/13	1,950,000.00	1,791,075.00	
トルコリラ小計			17,740,000.00	16,617,460.00	(87,539,117)
チェココ ルナ	国債証券	CZECH REPUBLIC-5.7%-24/05/25	3,920,000.00	3,919,216.00	
		CZECH REPUBLIC-0.0%-24/12/12	2,300,000.00	2,127,040.00	
		CZECH REPUBLIC-1.25%-25/02/14	6,200,000.00	5,834,665.00	
		CZECH REPUBLIC-2.4%-25/09/17	6,000,000.00	5,685,240.00	
		CZECH REPUBLIC-6.0%-26/02/26	4,500,000.00	4,655,317.50	
		CZECH REPUBLIC-1.0%-26/06/26	6,900,000.00	6,234,253.50	
		CZECH REPUBLIC-0.25%-27/02/10	6,600,000.00	5,713,620.00	
		CZECH REPUBLIC-2.5%-28/08/25	6,970,000.00	6,438,049.60	
		CZECH REPUBLIC-5.5%-28/12/12	4,000,000.00	4,273,140.00	
		CZECH REPUBLIC-2.75%-29/07/23	5,900,000.00	5,472,751.50	
		CZECH REPUBLIC-0.05%-29/11/29	3,100,000.00	2,407,615.00	
		CZECH REPUBLIC-0.95%-30/05/15	6,450,000.00	5,262,555.00	
		CZECH REPUBLIC-5.0%-30/09/30	5,700,000.00	6,020,283.00	
		CZECH REPUBLIC-1.2%-31/03/13	5,300,000.00	4,312,345.00	
		CZECH REPUBLIC-1.75%-32/06/23	6,400,000.00	5,317,664.00	
		CZECH REPUBLIC-2.0%-33/10/13	7,200,000.00	5,965,812.00	
		CZECH REPUBLIC-3.5%-35/05/30	2,100,000.00	1,983,219.00	
		CZECH REPUBLIC-4.2%-36/12/04	3,300,000.00	3,302,722.50	
		CZECH REPUBLIC-1.95%-37/07/30	1,500,000.00	1,160,385.00	
CZECH REPUBLIC-1.5%-40/04/24	2,800,000.00	1,897,168.00			
チェココルナ小計			97,140,000.00	87,983,061.60	(577,899,143)
ハンガ リーフォ リント	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-24/06/26	42,000,000.00	39,138,645.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.5%-24/10/24	58,000,000.00	52,514,041.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-25/06/24	64,800,000.00	60,133,006.80	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-1.0%-25/11/26	77,000,000.00	64,498,049.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-1.5%-26/04/22	64,000,000.00	52,876,000.00	

		HUNGARY GOVERNMENT BOND-1.5%-26/08/26	40,000,000.00	32,568,780.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.75%- 26/12/22	51,000,000.00	42,570,771.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-27/10/27	67,000,000.00	56,116,486.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-4.5%-28/03/23	32,000,000.00	28,298,016.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.75%- 28/10/22	57,300,000.00	55,495,422.45	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.0%-29/05/23	47,000,000.00	36,219,234.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-30/08/21	55,000,000.00	43,329,797.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.25%- 31/10/22	75,000,000.00	58,688,775.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-4.75%- 32/11/24	54,000,000.00	46,072,152.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.25%- 33/04/20	70,000,000.00	48,667,710.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.25%- 34/06/22	30,000,000.00	19,936,560.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-38/10/27	47,500,000.00	30,531,337.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-41/04/25	28,000,000.00	17,025,722.00	
ハンガリーフォリント小計			959,600,000.00	784,680,505.75	(327,902,289)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	1,520,000.00	1,482,319.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	1,800,000.00	1,730,700.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	1,650,000.00	1,527,949.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	1,900,000.00	1,831,182.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-25/10/25	550,000.00	490,484.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,360,000.00	2,188,687.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,820,000.00	1,558,265.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	1,700,000.00	1,618,723.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	1,770,000.00	1,605,390.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	1,890,000.00	1,703,041.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-7.5%-28/07/25	1,460,000.00	1,603,956.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	2,440,000.00	2,126,216.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	1,910,000.00	1,458,476.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-32/04/25	1,900,000.00	1,424,772.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.0%-33/10/25	620,000.00	646,529.80	
			25,290,000.00	22,996,692.60	

ポーランドズロチ小計				(808,715,489)	
ロシア ルーブル	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%- 23/07/25	7,400,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-23/08/16	12,400,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-24/02/28	14,900,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-24/07/17	19,800,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-24/10/16	16,900,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-25/07/16	5,000,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-25/11/12	21,800,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-26/09/16	16,700,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-26/10/07	15,000,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-27/02/03	15,400,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-27/10/06	21,000,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-28/01/19	15,900,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-28/05/17	17,300,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-29/03/14	13,000,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-29/05/23	15,300,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-30/04/10	20,400,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-31/07/23	14,600,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-31/09/17	11,650,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-33/03/23	16,000,000.00		
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-34/05/10	15,000,000.00		
RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-35/07/18	18,000,000.00				
RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-39/03/16	14,500,000.00				
ロシアルーブル小計			337,950,000.00	()	
ルーマニ アレイ	国債証券	ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%- 24/04/29	630,000.00	615,985.65	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.5%-24/06/17	620,000.00	610,554.30	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.7%-24/11/25	700,000.00	677,323.50	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%- 25/02/24	730,000.00	712,994.65	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.65%- 25/07/28	610,000.00	579,695.20	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.5%-25/11/25	550,000.00	516,791.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.85%- 26/04/22	750,000.00	721,395.00	

		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%- 26/06/24	650,000.00	596,440.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.8%-27/07/26	720,000.00	703,123.20	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-2.5%-27/10/25	650,000.00	556,042.50	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.15%- 28/01/26	550,000.00	500,929.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-8.75%- 28/10/30	350,000.00	383,276.25	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.0%-29/02/12	660,000.00	618,730.20	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.85%- 29/07/25	670,000.00	620,681.30	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.15%- 30/10/24	690,000.00	601,990.50	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.65%- 31/09/24	720,000.00	600,321.60	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-6.7%-32/02/25	800,000.00	809,900.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-8.25%- 32/09/29	530,000.00	594,257.20	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%- 34/10/11	740,000.00	641,694.70	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.25%- 36/04/28	520,000.00	418,467.40	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-7.9%-38/02/24	450,000.00	503,509.50	
		ルーマニアレイ小計	13,290,000.00	12,584,102.65 (397,666,452)	
マレーシ アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.478%-24/06/14	900,000.00	904,234.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	1,050,000.00	1,061,928.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	900,000.00	910,291.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	2,520,000.00	2,556,376.20	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	830,000.00	842,545.45	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	1,370,000.00	1,389,104.65	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,840,000.00	1,866,744.40	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.504%-29/04/30	1,350,000.00	1,406,855.25	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,340,000.00	1,352,307.90	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	1,660,000.00	1,532,080.40	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.582%-32/07/15	1,800,000.00	1,768,401.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,020,000.00	1,011,075.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	850,000.00	873,243.25	

		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,965,000.00	2,123,899.72	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	700,000.00	772,597.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	2,730,000.00	2,623,584.60	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.696%-42/10/15	420,000.00	455,256.90	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	1,130,000.00	1,255,723.80	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	1,470,000.00	1,436,925.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.655%- 24/10/15	340,000.00	341,494.30	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.128%- 25/08/15	700,000.00	710,724.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.726%- 26/03/31	850,000.00	855,367.75	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.258%- 27/07/26	430,000.00	441,481.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.422%- 27/09/30	570,000.00	567,403.65	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.369%- 28/10/31	730,000.00	755,389.40	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.13%- 29/07/09	570,000.00	581,018.10	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.465%- 30/10/15	950,000.00	930,206.75	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.447%- 36/07/15	480,000.00	453,362.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	530,000.00	535,212.55	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	1,000,000.00	1,000,110.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,550,000.00	1,558,029.00	
		マレーシアリングット小計	34,545,000.00	34,872,973.42 (1,066,520,146)	
タイバー ツ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND-0.75%- 24/06/17	10,900,000.00	10,779,827.50	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-0.75%- 24/09/17	13,100,000.00	12,885,684.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.45%- 24/12/17	13,200,000.00	13,066,878.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-0.95%- 25/06/17	11,000,000.00	10,759,760.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.85%- 25/12/12	10,170,000.00	10,558,646.55	

		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.35%- 26/06/17	11,500,000.00	11,544,907.50	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.125%- 26/12/17	13,800,000.00	13,736,382.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.0%- 27/06/17	14,600,000.00	13,891,608.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.65%- 28/06/17	14,700,000.00	14,901,316.50	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.875%- 28/12/17	9,700,000.00	9,948,271.50	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.875%- 29/06/22	12,180,000.00	13,837,819.80	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.6%- 29/12/17	11,700,000.00	11,143,665.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.65%- 31/06/20	10,500,000.00	11,382,262.50	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.0%- 31/12/17	16,000,000.00	15,432,320.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.775%- 32/06/25	12,500,000.00	13,750,312.50	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.35%- 33/06/17	9,200,000.00	9,819,942.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.6%- 35/06/17	5,500,000.00	4,908,970.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.585%- 35/12/17	11,200,000.00	9,889,264.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.4%- 36/06/17	9,950,000.00	10,598,939.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.39%- 37/06/17	6,100,000.00	6,479,115.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.3%- 38/06/17	12,100,000.00	12,712,139.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.0%- 42/06/17	7,700,000.00	6,622,924.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.45%- 43/06/17	5,200,000.00	5,499,962.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.875%- 46/06/17	9,500,000.00	9,003,720.00	
		タイパーツ小計	262,000,000.00	263,154,636.35 (1,060,513,184)	
インドネ シアルビ	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-24/03/15	4,400,000,000.00	4,470,400,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.125%-24/05/15	3,600,000,000.00	3,663,000,000.00	

ア		INDONESIA GOVERNMENT-6.5%-25/06/15	3,900,000,000.00	3,937,050,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-25/09/15	1,060,000,000.00	1,166,000,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.5%-26/04/15	4,500,000,000.00	4,448,250,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-26/09/15	4,990,000,000.00	5,341,795,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.125%-27/04/15	3,200,000,000.00	3,131,200,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-27/05/15	3,900,000,000.00	4,036,500,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.125%-28/05/15	4,300,000,000.00	4,317,200,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.375%-28/08/15	3,200,000,000.00	3,270,400,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.0%-29/03/15	2,850,000,000.00	3,241,875,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-29/05/15	3,300,000,000.00	3,634,950,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.5%-30/08/15	810,000,000.00	1,004,400,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-30/09/15	4,800,000,000.00	5,004,000,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.5%-31/02/15	5,600,000,000.00	5,675,600,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.75%-31/05/15	3,000,000,000.00	3,450,000,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.5%-31/07/15	1,120,000,000.00	1,341,200,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.375%-32/04/15	4,900,000,000.00	4,936,750,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-32/06/15	1,400,000,000.00	1,582,000,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-32/08/15	2,100,000,000.00	2,268,000,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-33/02/15	2,600,000,000.00	2,748,200,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.625%-33/05/15	4,330,000,000.00	4,427,425,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-34/03/15	6,300,000,000.00	7,270,200,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-35/06/15	3,150,000,000.00	3,433,500,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-36/05/15	2,860,000,000.00	3,303,300,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.25%-36/06/15	2,800,000,000.00	2,790,200,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-38/05/15	3,100,000,000.00	3,389,850,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-39/04/15	1,950,000,000.00	2,291,250,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-40/04/15	4,500,000,000.00	4,878,000,000.00		
	INDONESIA GOVERNMENT-7.125%-42/06/15	4,800,000,000.00	5,064,000,000.00		
	PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.875%-31/11/15	1,090,000,000.00	1,261,986,740.00		
インドネシアルピア小計			104,410,000,000.00	110,778,481,740.00	(1,030,239,880)
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-24/04/11	1,300,000.00	1,313,262.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.94%-24/10/17	2,400,000.00	2,429,697.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.26%-25/02/24	1,000,000.00	1,002,671.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.99%-25/04/09	2,300,000.00	2,294,743.35	

		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	4,000,000.00	4,077,932.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.22%-25/12/06	2,000,000.00	2,050,571.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-26/06/06	2,100,000.00	2,164,145.55	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-26/12/05	2,300,000.00	2,365,632.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	3,000,000.00	3,054,346.35	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.28%-27/12/03	3,000,000.00	3,119,280.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	1,000,000.00	1,027,585.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-28/11/22	2,200,000.00	2,292,115.10	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-29/05/23	3,100,000.00	3,239,048.33	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.13%-29/11/21	2,100,000.00	2,172,895.20	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-30/03/25	2,000,000.00	2,023,342.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	3,000,000.00	3,011,857.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	3,000,000.00	3,146,449.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	2,000,000.00	2,055,015.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	3,000,000.00	3,014,250.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-32/08/15	4,000,000.00	3,998,914.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-33/02/25	1,000,000.00	1,020,897.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	3,000,000.00	3,418,993.50	
中国元小計			52,800,000.00	54,293,644.88	(1,050,706,903)
エジプト bond	国債証券	EGYPT GOVERNMENT BOND-14.531%- 24/09/14	3,100,000.00	2,824,011.34	
		EGYPT GOVERNMENT BOND-14.369%- 25/10/20	7,400,000.00	6,374,527.24	
		EGYPT GOVERNMENT BOND-14.483%- 26/04/06	2,500,000.00	2,107,093.37	
		EGYPT GOVERNMENT BOND-14.563%- 26/07/06	2,000,000.00	1,669,971.60	
		EGYPT GOVERNMENT BOND-14.4%-29/09/10	4,400,000.00	3,251,237.88	
エジプトbond小計			19,400,000.00	16,226,841.43	(72,852,027)
南アフリ カランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%- 26/12/21	19,300,000.00	20,050,162.05	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%- 30/01/31	18,630,000.00	16,528,733.47	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%- 31/02/28	9,540,000.00	7,671,728.37	

	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%- 32/03/31	15,150,000.00	12,790,199.64	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%- 35/02/28	14,600,000.00	11,976,740.62	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%- 36/03/31	5,690,000.00	3,635,113.96	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%- 37/01/31	13,410,000.00	10,244,899.38	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%- 40/01/31	10,470,000.00	8,021,572.70	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%- 41/02/28	5,090,000.00	3,004,094.58	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 44/01/31	11,730,000.00	8,559,027.92	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%- 48/02/28	18,950,000.00	13,694,713.99	
南アフリカランド小計		142,560,000.00	116,176,986.68 (895,724,567)	
	合計		10,545,916,162 (10,545,916,162)	

(注1)当銘柄()の償還日につきましては、決算日時点で知りうる情報に基づいて記載しており、前回掲載時と異なる場合があります。

(注2)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3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	10.0%
ブラジルリアル	国債証券 10銘柄	100.0%	10.0%
チリペソ	国債証券 9銘柄	100.0%	2.3%
コロンビアペソ	国債証券 13銘柄	100.0%	4.6%
ペルーヌエボソル	国債証券 9銘柄	100.0%	2.5%
ウルグアイペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.2%
セルビアディナール	国債証券 3銘柄	100.0%	0.3%
トルコリラ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.8%

チェココルナ	国債証券	20銘柄	100.0%	5.5%
ハンガリーフォリント	国債証券	18銘柄	100.0%	3.1%
ポーランドズロチ	国債証券	15銘柄	100.0%	7.7%
ロシアルーブル	国債証券	22銘柄		
ルーマニアレイ	国債証券	21銘柄	100.0%	3.8%
マレーシアリングット	国債証券	31銘柄	100.0%	9.9%
タイバーツ	国債証券	24銘柄	100.0%	10.1%
インドネシアルピア	国債証券	31銘柄	100.0%	9.8%
中国元	国債証券	22銘柄	100.0%	10.0%
エジプトポンド	国債証券	5銘柄	100.0%	0.7%
南アフリカランド	国債証券	11銘柄	100.0%	8.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	18,150,505	20,648,830
親投資信託受益証券	3,405,566,070	4,090,097,384
派生商品評価勘定	-	74,206,228
未収入金	-	2,870,124
流動資産合計	3,423,716,575	4,187,822,566
資産合計	3,423,716,575	4,187,822,566
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	52,292,208	152,955
未払解約金	769,999	2,899,999
未払委託者報酬	33,270	30,098
未払委託者報酬	110,914	100,337
未払利息	8	29

その他未払費用	22,429	17,316
流動負債合計	53,228,828	3,200,734
負債合計	53,228,828	3,200,734
純資産の部		
元本等		
元本	2,829,323,570	3,259,442,768
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	541,164,177	925,179,064
（分配準備積立金）	446,582,905	393,614,715
元本等合計	3,370,487,747	4,184,621,832
純資産合計	3,370,487,747	4,184,621,832
負債純資産合計	3,423,716,575	4,187,822,566

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

		2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
1.	期首	2021年 7月20日	2022年 7月20日
	期首元本額	2,350,360,311円	2,829,323,570円
	期首からの追加設定元本額	936,853,244円	873,850,962円
	期首からの一部解約元本額	457,889,985円	443,731,764円
2.	受益権の総数	2,829,323,570口	3,259,442,768口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19日	自 2022年 7月20日 至 2023年 7月18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 7月19日現在	2023年 7月18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 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

合計	13,591,009
----	------------

(2023年 7月18日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	41,367,253
合計	41,367,253

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2022年 7月19日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	売建	3,416,686,650	-	3,468,978,858	52,292,208	
	米ドル	3,416,686,650	-	3,468,978,858	52,292,208	
合計		3,416,686,650	-	3,468,978,858	52,292,208	

(2023年 7月18日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超		時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	売建	4,168,550,905	-	4,094,497,632	74,053,273	
	米ドル	4,168,550,905	-	4,094,497,632	74,053,273	
合計		4,168,550,905	-	4,094,497,632	74,053,273	

(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 7月19日現在		2023年 7月18日現在	
1口当たり純資産額	1.1913円	1口当たり純資産額	1.2838円
(1万口当たり純資産額)	(11,913円)	(1万口当たり純資産額)	(12,838円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位 : 円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	ゴールド・マザーファンド	2,391,170,643	4,090,097,384	
	合計	2,391,170,643	4,090,097,384	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

「FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）」は、「ゴールド・マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

ゴールド・マザーファンド

貸借対照表

	（単位：円）	
	2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
資産の部		
流動資産		
預金	72,263,654	324,254,162
コール・ローン	57,198,209	54,023,809
投資信託受益証券	157,876,937,197	185,618,713,530
派生商品評価勘定	231,990	320,922
流動資産合計	158,006,631,050	185,997,312,423
資産合計	158,006,631,050	185,997,312,423
負債の部		
流動負債		
未払金	8,423,828,263	5,524,556,128
未払解約金	6,874,000	2,870,124
未払利息	26	77
流動負債合計	8,430,702,289	5,527,426,329
負債合計	8,430,702,289	5,527,426,329
純資産の部		
元本等		
元本	100,331,684,717	105,506,147,668
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	49,244,244,044	74,963,738,426
元本等合計	149,575,928,761	180,469,886,094
純資産合計	149,575,928,761	180,469,886,094
負債純資産合計	158,006,631,050	185,997,312,423

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められ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られ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 7月19日現在	2023年 7月18日現在
1.	期首	2021年 7月20日	2022年 7月20日
	期首元本額	118,451,694,130円	100,331,684,717円
	期首からの追加設定元本額	19,150,081,540円	41,085,425,024円
	期首からの一部解約元本額	37,270,090,953円	35,910,962,073円
	元本の内訳		
	ファイン・ブレンド(毎月分配型)	5,089,606,024円	5,396,421,513円
	ファイン・ブレンド(資産成長型)	2,968,074,339円	3,235,796,070円
	スマート・ファイブ(毎月決算型)	36,352,749,914円	33,126,246,256円
	スマート・ファイブ(1年決算型)	6,254,836,456円	5,992,416,922円
	ゴールド・ファンド(適格機関投資家向け)	5,091,607,989円	5,039,329,933円
	ゴールド・ファンド(為替ヘッジあり)	5,970,680,050円	6,288,833,371円
	ゴールド・ファンド(為替ヘッジなし)	6,861,086,778円	9,490,396,329円
	ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり(SMA専用)	29,413,617,201円	34,505,131,445円
	FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	2,284,388,295円	2,391,170,643円
ファイン・ブレンド(適格機関投資家向け)	45,037,671円	40,405,186円	
計	100,331,684,717円	105,506,147,668円	
2.	受益権の総数	100,331,684,717口	105,506,147,668口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19日	自 2022年 7月20日 至 2023年 7月18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 7月19日現在	2023年 7月18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 7月19日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	24,270,743,084
合計	24,270,743,084

（2023年 7月18日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	12,234,320,731
合計	12,234,320,731

(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 7月19日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	8,667,453,630	-	8,667,685,620	231,990
	米ドル	8,667,453,630	-	8,667,685,620	231,990
	合計	8,667,453,630	-	8,667,685,620	231,990

（2023年 7月18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	為替予約取引				

の取引	買建	5,501,260,772	-	5,501,581,694	320,922
	米ドル	5,501,260,772	-	5,501,581,694	320,922
合計		5,501,260,772	-	5,501,581,694	320,922

(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 7月19日現在		2023年 7月18日現在	
1口当たり純資産額	1.4908円	1口当たり純資産額	1.7105円
(1万口当たり純資産額)	(14,908円)	(1万口当たり純資産額)	(17,105円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

米ドル	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST MICRO-ETF	4,750,000	92,767,500.00	
		iシェアーズ ゴールド・トラスト	14,925,000	552,822,000.00	
		SPDR GOLD MINISHARES TRUST-ETF	15,400,000	597,520,000.00	
		SPDR GOLD TRUST-ETF	514,600	93,430,776.00	
米ドル小計			35,589,600	1,336,540,276.00 (185,618,713,530)	
合計				185,618,713,530 (185,618,713,530)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入投資信託 受益証券時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資信託受益証券 4銘柄	100.0%	100.0%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

インデックス マザーファンド TOPIX

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	89,098,872	90,264,074
株式	43,119,927,780	50,167,968,280
派生商品評価勘定	727,250	1,018,350
未収配当金	64,595,588	68,876,494

前払金	-	435,000
流動資産合計	43,274,349,490	50,328,562,198
資産合計	43,274,349,490	50,328,562,198
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	931,100
前受金	230,000	-
未払解約金	62,774,305	50,000,000
未払利息	42	130
流動負債合計	63,004,347	50,931,230
負債合計	63,004,347	50,931,230
純資産の部		
元本等		
元本	16,971,923,640	16,235,361,025
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	26,239,421,503	34,042,269,943
元本等合計	43,211,345,143	50,277,630,968
純資産合計	43,211,345,143	50,277,630,968
負債純資産合計	43,274,349,490	50,328,562,198

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 7月19日現在	2023年 7月18日現在
1.	期首	2021年 7月20日	2022年 7月20日
	期首元本額	17,201,994,044円	16,971,923,640円
	期首からの追加設定元本額	1,853,900,967円	1,827,809,051円
	期首からの一部解約元本額	2,083,971,371円	2,564,371,666円
	元本の内訳		

インデックスファンドTSP	8,583,887,839円	8,171,889,173円
財形株投（一般財形30）	12,546,911円	10,047,695円
財形株投（一般財形50）	36,637,425円	32,000,979円
財形株投（年金・住宅財形30）	28,249,327円	25,201,919円
インデックスファンドTOPIX（日本株式）	7,776,331,356円	7,452,294,770円
TOPIXインデックスファンド（個人型年金向け）	500,971,632円	516,218,100円
時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08	20,407,318円	16,895,859円
時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11	6,620,538円	5,381,885円
時間分散型バランスファンド（安定指向）2017-02	6,271,294円	5,430,645円
計	16,971,923,640円	16,235,361,025円
2. 受益権の総数	16,971,923,640口	16,235,361,025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	468,551,000円	587,578,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19日	自 2022年 7月20日 至 2023年 7月18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 7月19日現在	2023年 7月18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 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	569,927,264
合計	569,927,264

(2023年 7月18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	6,099,570,635
合計	6,099,570,635

(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 7月19日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	94,270,000	-	95,000,000	730,000
合計		94,270,000	-	95,000,000	730,000

(2023年 7月18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	112,210,000	-	112,300,000	90,000
合計		112,210,000	-	112,300,000	90,000

(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 7月19日現在		2023年 7月18日現在	
1口当たり純資産額	2.5460円	1口当たり純資産額	3.0968円
(1万口当たり純資産額)	(25,460円)	(1万口当たり純資産額)	(30,968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	3,640.00	2,912,000	
ニッスイ	21,800	674.60	14,706,280	
マルハニチロ	3,200	2,464.00	7,884,800	
雪国まいたけ	1,900	929.00	1,765,100	
カネコ種苗	700	1,446.00	1,012,200	
サカタのタネ	2,500	3,995.00	9,987,500	
ホクト	1,900	1,841.00	3,497,900	
ホクリヨウ	300	867.00	260,100	
住石ホールディングス	2,700	353.00	953,100	
日鉄鉱業	900	4,665.00	4,198,500	
三井松島ホールディングス	1,000	2,599.00	2,599,000	
I N P E X	80,700	1,669.50	134,728,650	
石油資源開発	2,500	4,410.00	11,025,000	
K & O エナジーグループ	1,000	2,276.00	2,276,000	
ショーボンドホールディングス	3,000	5,587.00	16,761,000	
ミライト・ワン	7,200	1,785.50	12,855,600	
タマホーム	1,400	3,590.00	5,026,000	
サンヨーホームズ	300	711.00	213,300	
日本アクア	800	878.00	702,400	
ファーストコーポレーション	500	730.00	365,000	
ベステラ	400	1,073.00	429,200	
キャンディル	400	593.00	237,200	
ダイセキ環境ソリューション	400	1,370.00	548,000	
第一カッター興業	600	1,379.00	827,400	
安藤・間	12,600	1,064.00	13,406,400	
東急建設	6,300	733.00	4,617,900	
コムシスホールディングス	7,000	2,750.50	19,253,500	
ビ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	2,567.00	3,593,800	
東建コーポレーション	600	7,330.00	4,398,000	
ソネック	200	966.00	193,200	
ヤマウラ	1,200	1,148.00	1,377,600	

大成建設	14,300	5,056.00	72,300,800
大林組	54,800	1,230.50	67,431,400
清水建設	43,400	897.20	38,938,480
飛島建設	1,700	1,273.00	2,164,100
長谷工コーポレーション	15,800	1,792.00	28,313,600
松井建設	1,500	738.00	1,107,000
銭高組	200	3,055.00	611,000
鹿島建設	33,900	2,131.00	72,240,900
不動テトラ	1,100	1,843.00	2,027,300
大末建設	400	1,334.00	533,600
鉄建建設	1,100	1,976.00	2,173,600
西松建設	2,600	3,519.00	9,149,400
三井住友建設	12,700	365.00	4,635,500
大豊建設	600	3,885.00	2,331,000
ナカノフドー建設	1,000	384.00	384,000
奥村組	2,500	4,035.00	10,087,500
東鉄工業	2,100	2,633.00	5,529,300
イチケン	300	1,934.00	580,200
富士ピー・エス	600	446.00	267,600
浅沼組	1,200	3,330.00	3,996,000
戸田建設	18,800	752.00	14,137,600
熊谷組	2,600	3,110.00	8,086,000
北野建設	200	3,015.00	603,000
植木組	400	1,378.00	551,200
矢作建設工業	2,100	1,249.00	2,622,900
ピーエス三菱	1,900	756.00	1,436,400
日本ハウスホールディングス	3,100	371.00	1,150,100
新日本建設	2,200	1,223.00	2,690,600
東亜道路工業	600	4,595.00	2,757,000
日本道路	300	8,870.00	2,661,000
東亜建設工業	1,300	3,110.00	4,043,000
日本国土開発	4,400	584.00	2,569,600
若築建設	700	3,020.00	2,114,000
東洋建設	5,000	1,031.00	5,155,000
五洋建設	21,700	740.00	16,058,000
世紀東急工業	2,000	1,398.00	2,796,000

福田組	600	4,750.00	2,850,000
住友林業	11,800	3,409.00	40,226,200
日本基礎技術	700	507.00	354,900
巴コーポレーション	1,300	494.00	642,200
大和ハウス工業	42,300	3,669.00	155,198,700
ライト工業	2,800	2,007.00	5,619,600
積水ハウス	46,300	2,887.50	133,691,250
日特建設	1,500	1,059.00	1,588,500
北陸電気工事	1,100	940.00	1,034,000
ユアテック	3,400	852.00	2,896,800
日本リーテック	1,400	1,425.00	1,995,000
四電工	700	2,221.00	1,554,700
中電工	2,400	2,304.00	5,529,600
関電工	8,400	1,189.00	9,987,600
きんでん	10,700	1,950.50	20,870,350
東京エネシス	1,500	953.00	1,429,500
トーエネック	500	3,600.00	1,800,000
住友電設	1,500	3,120.00	4,680,000
日本電設工業	2,500	2,050.00	5,125,000
エクシオグループ	7,000	2,829.00	19,803,000
新日本空調	900	2,291.00	2,061,900
九電工	3,700	4,032.00	14,918,400
三機工業	3,400	1,518.00	5,161,200
日揮ホールディングス	15,100	1,868.50	28,214,350
中外炉工業	500	2,012.00	1,006,000
ヤマト	1,000	867.00	867,000
太平電業	1,000	4,270.00	4,270,000
高砂熱学工業	3,700	2,504.00	9,264,800
三晃金属工業	200	4,340.00	868,000
朝日工業社	700	2,424.00	1,696,800
明星工業	2,700	952.00	2,570,400
大気社	1,800	4,075.00	7,335,000
ダイダン	1,000	2,866.00	2,866,000
日比谷総合設備	1,300	2,166.00	2,815,800
フィル・カンパニー	300	776.00	232,800
テスホールディングス	3,400	607.00	2,063,800

インフロニア・ホールディングス	16,000	1,343.50	21,496,000	
東洋エンジニアリング	2,000	603.00	1,206,000	
レイズネクスト	2,200	1,403.00	3,086,600	
ニッポン	4,100	1,824.00	7,478,400	
日清製粉グループ本社	14,200	1,679.00	23,841,800	
日東富士製粉	300	4,730.00	1,419,000	
昭和産業	1,300	2,665.00	3,464,500	
鳥越製粉	1,000	618.00	618,000	
中部飼料	2,100	1,069.00	2,244,900	
フィード・ワン	2,200	736.00	1,619,200	
東洋精糖	200	1,725.00	345,000	
日本甜菜製糖	900	1,893.00	1,703,700	
D M三井製糖ホールディングス	1,500	2,690.00	4,035,000	
塩水港精糖	1,400	210.00	294,000	
ウェルネオシュガー	800	2,023.00	1,618,400	
森永製菓	2,800	4,529.00	12,681,200	
中村屋	400	3,065.00	1,226,000	
江崎グリコ	4,400	3,725.00	16,390,000	
名糖産業	600	1,632.00	979,200	
井村屋グループ	800	2,236.00	1,788,800	
不二家	1,100	2,424.00	2,666,400	
山崎製パン	10,300	2,040.50	21,017,150	
第一屋製パン	200	389.00	77,800	
モロゾフ	500	3,745.00	1,872,500	
亀田製菓	1,000	4,260.00	4,260,000	
寿スピリッツ	1,600	11,240.00	17,984,000	
カルビー	7,000	2,739.50	19,176,500	
森永乳業	2,800	4,680.00	13,104,000	
六甲バター	1,100	1,308.00	1,438,800	
ヤクルト本社	11,000	8,818.00	96,998,000	
明治ホールディングス	18,900	3,320.00	62,748,000	
雪印メグミルク	3,700	1,922.00	7,111,400	
プリマハム	2,100	2,181.00	4,580,100	
日本ハム	6,000	3,945.00	23,670,000	
林兼産業	400	491.00	196,400	
丸大食品	1,500	1,483.00	2,224,500	

S Foods	1,700	3,205.00	5,448,500	
柿安本店	600	2,329.00	1,397,400	
伊藤ハム米久ホールディングス	11,700	717.00	8,388,900	
サッポロホールディングス	5,100	3,586.00	18,288,600	
アサヒグループホールディングス	35,500	5,447.00	193,368,500	
キリンホールディングス	69,300	2,073.00	143,658,900	
宝ホールディングス	10,400	1,175.50	12,225,200	
オエノンホールディングス	4,700	345.00	1,621,500	
養命酒製造	500	1,850.00	925,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	12,000	1,552.00	18,624,000	
サントリー食品インターナショナル	10,800	5,015.00	54,162,000	
ダイドーグループホールディングス	900	4,930.00	4,437,000	
伊藤園	5,200	3,991.00	20,753,200	
キーコーヒー	1,700	2,066.00	3,512,200	
ユニカフェ	400	911.00	364,400	
ジャパンフーズ	200	1,071.00	214,200	
日清オイリオグループ	2,200	3,665.00	8,063,000	
不二製油グループ本社	3,600	1,969.00	7,088,400	
かどや製油	200	3,425.00	685,000	
J - オイルミルズ	1,600	1,661.00	2,657,600	
キッコーマン	10,200	7,940.00	80,988,000	
味の素	37,100	5,554.00	206,053,400	
ブルドックソース	800	1,920.00	1,536,000	
キュービー	8,300	2,445.50	20,297,650	
ハウス食品グループ本社	4,700	3,293.00	15,477,100	
カゴメ	7,200	3,161.00	22,759,200	
焼津水産化学工業	500	815.00	407,500	
アリアケジャパン	1,300	5,190.00	6,747,000	
ピエトロ	200	1,810.00	362,000	
エバラ食品工業	400	2,863.00	1,145,200	
やまみ	100	1,340.00	134,000	
ニチレイ	7,000	3,173.00	22,211,000	
東洋水産	7,800	6,062.00	47,283,600	
イトアンドホールディングス	700	2,138.00	1,496,600	
大冷	200	1,956.00	391,200	

ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,000	1,000.00	1,000,000
日清食品ホールディングス	5,400	11,820.00	63,828,000
永谷園ホールディングス	800	2,144.00	1,715,200
一正蒲鉾	500	727.00	363,500
フジッコ	1,600	1,877.00	3,003,200
ロック・フィールド	1,700	1,469.00	2,497,300
日本たばこ産業	101,000	3,059.00	308,959,000
ケンコーマヨネーズ	1,100	1,304.00	1,434,400
わらべや日洋ホールディングス	1,100	2,656.00	2,921,600
なとり	1,000	1,958.00	1,958,000
イフジ産業	200	1,122.00	224,400
ファーマフーズ	2,200	1,815.00	3,993,000
ユーグレナ	9,900	892.00	8,830,800
紀文食品	1,300	1,029.00	1,337,700
ピクルスホールディングス	900	1,229.00	1,106,100
ミヨシ油脂	400	1,028.00	411,200
理研ビタミン	1,300	2,020.00	2,626,000
片倉工業	1,400	1,652.00	2,312,800
ゲンゼ	1,100	4,320.00	4,752,000
東洋紡	6,700	1,033.00	6,921,100
ユニチカ	4,800	222.00	1,065,600
富士紡ホールディングス	600	3,190.00	1,914,000
倉敷紡績	1,200	2,282.00	2,738,400
シキボウ	700	1,011.00	707,700
日本毛織	4,100	1,136.00	4,657,600
ダイトウボウ	2,900	94.00	272,600
トーア紡コーポレーション	500	442.00	221,000
ダイドーリミテッド	2,000	274.00	548,000
帝国繊維	1,800	1,687.00	3,036,600
帝人	15,000	1,466.00	21,990,000
東レ	104,600	776.50	81,221,900
住江織物	300	2,392.00	717,600
日本フェルト	700	415.00	290,500
日東製網	100	1,410.00	141,000
アツギ	700	426.00	298,200
ダイニック	300	746.00	223,800

セーレン	3,000	2,406.00	7,218,000
ソトー	400	767.00	306,800
東海染工	200	1,077.00	215,400
小松マテーレ	2,300	710.00	1,633,000
ワコールホールディングス	2,800	2,964.50	8,300,600
ホギメディカル	2,100	3,105.00	6,520,500
クラウディアホールディングス	400	816.00	326,400
T S Iホールディングス	5,300	753.00	3,990,900
マツオカコーポレーション	300	1,290.00	387,000
ワールド	2,100	1,746.00	3,666,600
三陽商会	500	2,047.00	1,023,500
ナイガイ	400	277.00	110,800
オンワードホールディングス	10,200	541.00	5,518,200
ルックホールディングス	400	2,607.00	1,042,800
ゴールドウイン	2,800	11,945.00	33,446,000
デサント	2,700	3,895.00	10,516,500
キング	500	616.00	308,000
ヤマトインターナショナル	1,000	297.00	297,000
特種東海製紙	700	3,220.00	2,254,000
王子ホールディングス	65,000	524.70	34,105,500
日本製紙	8,200	1,178.00	9,659,600
三菱製紙	1,500	553.00	829,500
北越コーポレーション	9,900	798.00	7,900,200
中越パルプ工業	500	1,296.00	648,000
巴川製紙所	400	691.00	276,400
大王製紙	6,900	1,114.00	7,686,600
阿波製紙	300	534.00	160,200
レンゴー	14,300	854.10	12,213,630
トモク	900	2,068.00	1,861,200
ザ・バック	1,200	3,225.00	3,870,000
北の達人コーポレーション	6,800	254.00	1,727,200
クラレ	24,800	1,360.00	33,728,000
旭化成	97,400	951.60	92,685,840
共和レザー	700	583.00	408,100
レゾナック・ホールディングス	15,100	2,265.50	34,209,050
住友化学	115,900	426.90	49,477,710

住友精化	700	4,490.00	3,143,000	
日産化学	7,400	6,125.00	45,325,000	
ラサ工業	600	2,072.00	1,243,200	
クレハ	1,300	8,230.00	10,699,000	
多木化学	600	4,065.00	2,439,000	
テイカ	1,100	1,370.00	1,507,000	
石原産業	2,800	1,267.00	3,547,600	
片倉コープアグリ	300	1,234.00	370,200	
日本曹達	1,700	4,985.00	8,474,500	
東ソー	20,800	1,769.00	36,795,200	
トクヤマ	5,100	2,301.00	11,735,100	
セントラル硝子	2,500	2,955.00	7,387,500	
東亜合成	7,800	1,280.00	9,984,000	
大阪ソーダ	900	5,340.00	4,806,000	
関東電化工業	3,100	946.00	2,932,600	
デンカ	5,700	2,671.00	15,224,700	
信越化学工業	129,800	4,683.00	607,853,400	
日本カーバイド工業	500	1,403.00	701,500	
堺化学工業	1,200	1,932.00	2,318,400	
第一稀元素化学工業	1,400	961.00	1,345,400	
エア・ウォーター	14,700	1,902.00	27,959,400	
日本酸素ホールディングス	15,100	3,040.00	45,904,000	
日本化学工業	500	1,866.00	933,000	
東邦アセチレン	300	1,410.00	423,000	
日本パーカライズニング	7,700	1,077.00	8,292,900	
高圧ガス工業	2,300	743.00	1,708,900	
四国化成ホールディングス	1,900	1,449.00	2,753,100	
戸田工業	400	2,186.00	874,400	
ステラ ケミファ	900	3,125.00	2,812,500	
保土谷化学工業	500	3,355.00	1,677,500	
日本触媒	2,400	5,305.00	12,732,000	
大日精化工業	1,100	2,071.00	2,278,100	
カネカ	3,600	3,981.00	14,331,600	
三菱瓦斯化学	11,600	2,120.50	24,597,800	
三井化学	12,900	4,006.00	51,677,400	
J S R	14,600	4,080.00	59,568,000	

東京応化工業	2,700	8,733.00	23,579,100
大阪有機化学工業	1,200	2,736.00	3,283,200
三菱ケミカルグループ	105,400	823.10	86,754,740
K Hネオケム	2,600	2,245.00	5,837,000
ダイセル	21,800	1,267.50	27,631,500
住友ベークライト	2,300	5,751.00	13,227,300
積水化学工業	31,700	2,019.00	64,002,300
日本ゼオン	9,400	1,343.00	12,624,200
アイカ工業	3,900	3,119.00	12,164,100
U B E	8,100	2,450.00	19,845,000
積水樹脂	2,200	2,232.00	4,910,400
タキロンシーアイ	3,400	573.00	1,948,200
旭有機材	1,000	4,395.00	4,395,000
ニチバン	1,000	1,950.00	1,950,000
リケンテクノス	3,400	655.00	2,227,000
大倉工業	700	2,181.00	1,526,700
積水化成品工業	2,300	440.00	1,012,000
群栄化学工業	300	2,859.00	857,700
タイガースポリマー	600	664.00	398,400
ミライアル	400	1,571.00	628,400
ダイキアクシス	500	704.00	352,000
ダイキョーニシカワ	3,500	752.00	2,632,000
竹本容器	500	817.00	408,500
森六ホールディングス	800	2,062.00	1,649,600
恵和	1,000	1,107.00	1,107,000
日本化薬	11,900	1,212.00	14,422,800
カーリットホールディングス	1,500	787.00	1,180,500
日本精化	900	2,881.00	2,592,900
扶桑化学工業	1,500	4,535.00	6,802,500
トリケミカル研究所	2,100	2,765.00	5,806,500
A D E K A	5,400	2,696.50	14,561,100
日油	4,800	5,995.00	28,776,000
新日本理化	1,700	238.00	404,600
ハリマ化成グループ	900	868.00	781,200
花王	38,000	5,190.00	197,220,000
第一工業製薬	600	1,753.00	1,051,800

石原ケミカル	700	1,615.00	1,130,500
日華化学	500	834.00	417,000
ニイタカ	200	1,954.00	390,800
三洋化成工業	1,000	4,230.00	4,230,000
有機合成薬品工業	1,000	296.00	296,000
大日本塗料	1,900	913.00	1,734,700
日本ペイントホールディングス	69,100	1,158.00	80,017,800
関西ペイント	14,300	2,102.50	30,065,750
神東塗料	1,000	123.00	123,000
中国塗料	2,600	1,174.00	3,052,400
日本特殊塗料	800	1,055.00	844,000
藤倉化成	2,100	434.00	911,400
太陽ホールディングス	2,400	2,580.00	6,192,000
D I C	6,100	2,578.50	15,728,850
サカタインクス	3,500	1,186.00	4,151,000
東洋インキＳＣホールディングス	3,100	2,089.00	6,475,900
T & K T O K A	1,400	1,161.00	1,625,400
富士フイルムホールディングス	30,000	8,219.00	246,570,000
資生堂	32,600	6,242.00	203,489,200
ライオン	18,800	1,335.50	25,107,400
高砂香料工業	1,100	2,755.00	3,030,500
マンダム	3,400	1,370.00	4,658,000
ミルボン	2,300	4,894.00	11,256,200
ファンケル	6,800	2,550.50	17,343,400
コーセー	3,200	13,600.00	43,520,000
コタ	1,400	1,609.00	2,252,600
シーボン	100	1,551.00	155,100
ポーラ・オルビスホールディングス	8,000	2,060.00	16,480,000
ノエビアホールディングス	1,400	5,450.00	7,630,000
アジュバンホールディングス	300	938.00	281,400
新日本製薬	900	1,393.00	1,253,700
アクシージア	800	1,275.00	1,020,000
エステー	1,200	1,501.00	1,801,200
アグロ カネショウ	600	1,616.00	969,600
コニシ	2,600	2,165.00	5,629,000
長谷川香料	3,000	3,450.00	10,350,000

星光PMC	700	573.00	401,100
小林製薬	4,500	7,635.00	34,357,500
荒川化学工業	1,300	995.00	1,293,500
メック	1,300	3,630.00	4,719,000
日本高純度化学	400	2,548.00	1,019,200
タカラバイオ	4,200	1,730.00	7,266,000
JCU	1,700	3,390.00	5,763,000
新田ゼラチン	900	732.00	658,800
OATアグリオ	500	1,877.00	938,500
デクセリアルズ	4,300	3,290.00	14,147,000
アース製薬	1,400	4,985.00	6,979,000
北興化学工業	1,600	860.00	1,376,000
大成ラミック	500	2,949.00	1,474,500
クミアイ化学工業	6,200	1,075.00	6,665,000
日本農薬	2,900	710.00	2,059,000
アキレス	1,000	1,443.00	1,443,000
有沢製作所	2,600	1,087.00	2,826,200
日東電工	11,300	10,035.00	113,395,500
レック	2,200	837.00	1,841,400
三光合成	2,000	652.00	1,304,000
きもと	1,800	192.00	345,600
藤森工業	1,200	3,495.00	4,194,000
前澤化成工業	1,000	1,534.00	1,534,000
未来工業	600	2,713.00	1,627,800
ウェーブロックホールディングス	400	603.00	241,200
JSP	1,100	1,827.00	2,009,700
エフピコ	3,000	2,831.00	8,493,000
天馬	1,300	2,573.00	3,344,900
信越ポリマー	2,900	1,452.00	4,210,800
東リ	2,800	341.00	954,800
ニフコ	5,600	3,970.00	22,232,000
バルカー	1,300	3,790.00	4,927,000
ユニ・チャーム	32,600	5,300.00	172,780,000
ショーエイコーポレーション	500	590.00	295,000
協和キリン	18,900	2,673.00	50,519,700
武田薬品工業	138,300	4,290.00	593,307,000

アステラス製薬	147,600	2,015.00	297,414,000
住友ファーマ	11,700	648.30	7,585,110
塩野義製薬	19,700	5,820.00	114,654,000
わかもと製薬	1,300	233.00	302,900
日本新薬	3,700	5,479.00	20,272,300
中外製薬	48,900	3,908.00	191,101,200
科研製薬	2,700	3,503.00	9,458,100
エーザイ	19,000	8,992.00	170,848,000
ロート製薬	15,200	3,046.00	46,299,200
小野薬品工業	30,200	2,520.00	76,104,000
久光製薬	3,500	4,149.00	14,521,500
持田製薬	1,800	3,200.00	5,760,000
参天製薬	28,500	1,213.00	34,570,500
扶桑薬品工業	500	2,004.00	1,002,000
日本ケミファ	100	1,833.00	183,300
ツムラ	4,900	2,630.50	12,889,450
キッセイ薬品工業	2,400	2,941.00	7,058,400
生化学工業	3,000	739.00	2,217,000
栄研化学	2,500	1,547.00	3,867,500
鳥居薬品	800	3,500.00	2,800,000
JCRファーマ	5,300	1,243.50	6,590,550
東和薬品	2,400	1,744.00	4,185,600
富士製薬工業	1,200	1,112.00	1,334,400
ゼリア新薬工業	2,200	2,327.00	5,119,400
そーせいグループ	5,400	1,430.00	7,722,000
第一三共	136,200	3,903.00	531,588,600
杏林製薬	3,400	1,733.00	5,892,200
大幸薬品	3,100	339.00	1,050,900
ダイト	1,100	2,309.00	2,539,900
大塚ホールディングス	35,800	5,188.00	185,730,400
大正製薬ホールディングス	3,500	5,320.00	18,620,000
ペプチドリーム	7,600	1,853.00	14,082,800
あすか製薬ホールディングス	1,600	1,445.00	2,312,000
サワイグループホールディングス	3,600	3,521.00	12,675,600
日本コークス工業	14,100	110.00	1,551,000
ニチレキ	1,900	1,982.00	3,765,800

ユシロ化学工業	800	1,078.00	862,400
ビーピー・カストロール	500	864.00	432,000
富士石油	3,200	274.00	876,800
MORESCO	400	1,159.00	463,600
出光興産	17,300	2,903.00	50,221,900
Eneosホールディングス	265,400	487.90	129,488,660
コスモエネルギーホールディングス	6,200	3,987.00	24,719,400
横浜ゴム	8,900	3,039.00	27,047,100
TOYO TIRE	9,000	1,854.50	16,690,500
ブリヂストン	49,900	5,750.00	286,925,000
住友ゴム工業	15,300	1,404.00	21,481,200
藤倉コンポジット	900	949.00	854,100
オカモト	800	3,850.00	3,080,000
フコク	800	1,527.00	1,221,600
ニッタ	1,600	3,135.00	5,016,000
住友理工	3,000	798.00	2,394,000
三ツ星ベルト	2,300	4,360.00	10,028,000
バンドー化学	2,500	1,422.00	3,555,000
日東紡績	1,800	2,376.00	4,276,800
AGC	15,900	4,959.00	78,848,100
日本板硝子	8,100	620.00	5,022,000
石塚硝子	200	1,585.00	317,000
日本山村硝子	500	1,058.00	529,000
日本電気硝子	6,400	2,511.50	16,073,600
オハラ	800	1,396.00	1,116,800
住友大阪セメント	2,200	3,701.00	8,142,200
太平洋セメント	9,900	2,687.00	26,601,300
日本ヒューム	1,500	746.00	1,119,000
日本コンクリート工業	3,000	327.00	981,000
三谷セキサン	700	4,565.00	3,195,500
アジアパイルホールディングス	2,600	603.00	1,567,800
東海カーボン	13,100	1,212.00	15,877,200
日本カーボン	900	4,215.00	3,793,500
東洋炭素	1,000	5,380.00	5,380,000
ノリタケカンパニーリミテド	800	5,290.00	4,232,000
TOTO	10,300	4,245.00	43,723,500

日本碍子	18,100	1,666.00	30,154,600
日本特殊陶業	11,900	2,908.50	34,611,150
ダントーホールディングス	900	754.00	678,600
MARUWA	600	22,160.00	13,296,000
品川リフラクトリーズ	400	5,700.00	2,280,000
黒崎播磨	300	8,980.00	2,694,000
ヨータイ	900	1,455.00	1,309,500
東京窯業	1,200	345.00	414,000
ニッカトー	600	645.00	387,000
フジインコーポレーテッド	3,600	3,465.00	12,474,000
クニミネ工業	400	1,006.00	402,400
エーアンドエーマテリアル	200	1,089.00	217,800
ニチアス	3,900	2,858.00	11,146,200
ニチハ	2,000	3,125.00	6,250,000
日本製鉄	72,100	2,991.00	215,651,100
神戸製鋼所	32,400	1,346.50	43,626,600
合同製鐵	900	3,645.00	3,280,500
JFEホールディングス	43,000	2,022.50	86,967,500
東京製鐵	4,600	1,337.00	6,150,200
共英製鋼	1,900	1,974.00	3,750,600
大和工業	2,700	6,198.00	16,734,600
東京鐵鋼	800	3,175.00	2,540,000
大阪製鐵	800	1,438.00	1,150,400
淀川製鋼所	1,900	3,260.00	6,194,000
中部鋼板	1,400	1,925.00	2,695,000
丸一鋼管	4,900	3,237.00	15,861,300
モリ工業	300	3,410.00	1,023,000
大同特殊鋼	2,000	5,960.00	11,920,000
日本高周波鋼業	600	347.00	208,200
日本冶金工業	1,200	4,105.00	4,926,000
山陽特殊製鋼	1,600	2,676.00	4,281,600
愛知製鋼	1,000	3,215.00	3,215,000
日本金属	400	924.00	369,600
大平洋金属	1,200	1,538.00	1,845,600
新日本電工	9,900	279.00	2,762,100
栗本鐵工所	800	2,370.00	1,896,000

虹技	200	1,205.00	241,000
日本鑄鉄管	200	1,120.00	224,000
三菱製鋼	1,000	1,497.00	1,497,000
日亜鋼業	1,900	310.00	589,000
日本精線	200	4,865.00	973,000
エンビプロ・ホールディングス	900	534.00	480,600
シンニッタン	1,400	250.00	350,000
新家工業	300	2,377.00	713,100
大紀アルミニウム工業所	2,300	1,479.00	3,401,700
日本軽金属ホールディングス	4,500	1,437.00	6,466,500
三井金属鉱業	4,700	3,222.00	15,143,400
東邦亜鉛	1,000	1,699.00	1,699,000
三菱マテリアル	10,800	2,461.00	26,578,800
住友金属鉱山	18,700	4,743.00	88,694,100
D O W Aホールディングス	3,600	4,403.00	15,850,800
古河機械金属	2,400	1,528.00	3,667,200
エス・サイエンス	9,600	24.00	230,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,400	2,905.00	6,972,000
東邦チタニウム	2,900	1,656.00	4,802,400
U A C J	2,300	2,678.00	6,159,400
C Kサンエツ	400	4,150.00	1,660,000
古河電気工業	5,300	2,573.00	13,636,900
住友電気工業	55,500	1,700.00	94,350,000
フジクラ	17,300	1,173.50	20,301,550
S W C C	1,800	1,896.00	3,412,800
タツタ電線	3,400	710.00	2,414,000
カナレ電気	200	1,428.00	285,600
平河ヒューテック	900	1,608.00	1,447,200
リョービ	1,700	2,349.00	3,993,300
アーレスティ	1,500	639.00	958,500
A R Eホールディングス	6,600	1,938.00	12,790,800
稲葉製作所	800	1,576.00	1,260,800
宮地エンジニアリンググループ	500	4,085.00	2,042,500
トーカロ	4,300	1,420.00	6,106,000
アルファC o	500	1,219.00	609,500
S U M C O	30,600	2,104.50	64,397,700

川田テクノロジーズ	400	5,770.00	2,308,000
RS Technologies	1,100	3,040.00	3,344,000
ジェイテックコーポレーション	200	2,255.00	451,000
信和	700	768.00	537,600
東洋製罐グループホールディングス	9,600	2,112.00	20,275,200
ホッカンホールディングス	900	1,360.00	1,224,000
コロナ	900	908.00	817,200
横河ブリッジホールディングス	2,000	2,529.00	5,058,000
駒井ハルテック	200	1,888.00	377,600
高田機工	100	2,702.00	270,200
三和ホールディングス	14,800	1,879.50	27,816,600
文化シャッター	4,600	1,063.00	4,889,800
三協立山	1,900	894.00	1,698,600
アルインコ	1,300	1,006.00	1,307,800
東洋シャッター	300	608.00	182,400
LIXIL	23,400	1,832.50	42,880,500
日本フィルコン	800	459.00	367,200
ノーリツ	2,400	1,696.00	4,070,400
長府製作所	1,600	2,509.00	4,014,400
リンナイ	8,800	3,114.00	27,403,200
ダイニチ工業	600	729.00	437,400
日東精工	2,300	602.00	1,384,600
三洋工業	200	1,964.00	392,800
岡部	2,600	745.00	1,937,000
ジーテクト	1,800	1,757.00	3,162,600
東プレ	2,800	1,566.00	4,384,800
高周波熱錬	2,500	976.00	2,440,000
東京製綱	1,000	1,179.00	1,179,000
サンコール	1,200	520.00	624,000
モリテック スチール	1,200	316.00	379,200
パイオラックス	2,200	2,161.00	4,754,200
エイチワン	1,700	805.00	1,368,500
日本発條	14,200	1,035.50	14,704,100
中央発條	1,200	685.00	822,000
アドバネクス	200	970.00	194,000
立川ブラインド工業	700	1,227.00	858,900

三益半導体工業	1,200	3,025.00	3,630,000
日本ドライケミカル	300	1,708.00	512,400
日本製鋼所	4,300	2,953.50	12,700,050
三浦工業	6,600	3,589.00	23,687,400
タクマ	4,800	1,481.00	7,108,800
ツガミ	3,500	1,274.00	4,459,000
オークマ	1,600	7,399.00	11,838,400
芝浦機械	1,600	4,525.00	7,240,000
アマダ	25,100	1,390.00	34,889,000
アイダエンジニアリング	3,200	961.00	3,075,200
TAKISAWA	400	2,387.00	954,800
FUJII	6,800	2,615.00	17,782,000
牧野フライス製作所	1,700	5,660.00	9,622,000
オーエスジー	7,500	1,876.00	14,070,000
ダイジェット工業	100	891.00	89,100
旭ダイヤモンド工業	4,400	880.00	3,872,000
DMG森精機	9,600	2,459.00	23,606,400
ソディック	4,300	705.00	3,031,500
ディスコ	7,600	23,690.00	180,044,000
日東工器	800	1,903.00	1,522,400
日進工具	1,300	1,166.00	1,515,800
パンチ工業	1,300	474.00	616,200
富士ダイス	600	658.00	394,800
豊和工業	700	793.00	555,100
東洋機械金属	800	687.00	549,600
島精機製作所	2,500	1,888.00	4,720,000
オプトラン	2,300	2,311.00	5,315,300
NCホールディングス	200	2,186.00	437,200
イワキポンプ	1,100	1,397.00	1,536,700
フリーー	1,600	1,360.00	2,176,000
ヤマシンフィルタ	3,800	306.00	1,162,800
日阪製作所	1,500	927.00	1,390,500
やまびこ	2,600	1,514.00	3,936,400
野村マイクロ・サイエンス	500	6,330.00	3,165,000
平田機工	800	8,340.00	6,672,000
PEGASUS	1,700	566.00	962,200

マルマエ	700	1,741.00	1,218,700
タツモ	900	2,333.00	2,099,700
ナブテスコ	9,900	3,065.00	30,343,500
三井海洋開発	2,000	1,460.00	2,920,000
レオン自動機	1,700	1,366.00	2,322,200
S M C	5,100	76,200.00	388,620,000
ホソカワミクロン	1,000	3,450.00	3,450,000
ユニオンツール	700	3,290.00	2,303,000
瑞光	1,100	1,228.00	1,350,800
オイレス工業	2,200	1,910.00	4,202,000
日精エー・エス・ビー機械	600	4,120.00	2,472,000
サトーホールディングス	2,300	1,899.00	4,367,700
技研製作所	1,500	1,962.00	2,943,000
日本エアータック	800	1,229.00	983,200
カワタ	400	1,166.00	466,400
日精樹脂工業	1,100	979.00	1,076,900
オカダアイヨン	400	2,159.00	863,600
ワイエイシイホールディングス	500	2,815.00	1,407,500
小松製作所	73,700	3,775.00	278,217,500
住友重機械工業	9,300	3,333.00	30,996,900
日立建機	6,200	3,964.00	24,576,800
日工	2,300	658.00	1,513,400
巴工業	700	2,847.00	1,992,900
井関農機	1,500	1,227.00	1,840,500
T O W A	1,600	2,484.00	3,974,400
丸山製作所	200	1,923.00	384,600
北川鉄工所	600	1,163.00	697,800
ローツェ	800	10,660.00	8,528,000
タカキタ	400	478.00	191,200
クボタ	83,200	2,043.50	170,019,200
荏原実業	800	2,959.00	2,367,200
三菱化工機	500	2,673.00	1,336,500
月島ホールディングス	2,100	1,288.00	2,704,800
帝国電機製作所	1,100	2,621.00	2,883,100
新東工業	3,200	1,028.00	3,289,600
澁谷工業	1,500	2,585.00	3,877,500

アイチ コーポレーション	2,200	863.00	1,898,600	
小森コーポレーション	3,700	1,026.00	3,796,200	
鶴見製作所	1,200	2,665.00	3,198,000	
日本ギア工業	600	356.00	213,600	
酒井重工業	200	4,980.00	996,000	
荏原製作所	6,400	6,924.00	44,313,600	
石井鐵工所	200	2,612.00	522,400	
西島製作所	1,400	1,877.00	2,627,800	
北越工業	1,600	1,477.00	2,363,200	
ダイキン工業	18,800	28,550.00	536,740,000	
オルガノ	2,200	4,200.00	9,240,000	
トーヨーカネツ	600	3,510.00	2,106,000	
栗田工業	8,800	5,550.00	48,840,000	
椿本チエイン	2,200	3,680.00	8,096,000	
大同工業	500	725.00	362,500	
木村化工機	1,200	709.00	850,800	
アネスト岩田	2,700	1,173.00	3,167,100	
ダイフク	24,400	2,992.50	73,017,000	
サムコ	400	5,490.00	2,196,000	
加藤製作所	600	1,194.00	716,400	
油研工業	200	2,024.00	404,800	
タダノ	8,300	1,122.00	9,312,600	
フジテック	5,500	3,590.00	19,745,000	
C K D	4,300	2,271.00	9,765,300	
平和	5,300	2,415.00	12,799,500	
理想科学工業	1,300	2,328.00	3,026,400	
S A N K Y O	3,100	5,637.00	17,474,700	
日本金銭機械	1,800	1,153.00	2,075,400	
マースグループホールディングス	900	2,870.00	2,583,000	
フクシマガリレイ	1,100	4,975.00	5,472,500	
オーイズミ	600	505.00	303,000	
ダイコク電機	900	3,995.00	3,595,500	
竹内製作所	2,900	4,385.00	12,716,500	
アマノ	4,500	2,943.50	13,245,750	
J U K I	2,500	572.00	1,430,000	
サンデン	2,300	190.00	437,000	

ジャノメ	1,600	643.00	1,028,800
マックス	1,900	2,631.00	4,998,900
グローリー	3,800	2,752.00	10,457,600
新晃工業	1,600	1,912.00	3,059,200
大和冷機工業	2,400	1,412.00	3,388,800
セガサミーホールディングス	12,700	3,036.00	38,557,200
日本ピストンリング	400	1,626.00	650,400
リケン	600	3,200.00	1,920,000
T P R	1,800	1,734.00	3,121,200
ツバキ・ナカシマ	4,000	812.00	3,248,000
ホシザキ	10,100	5,174.00	52,257,400
大豊工業	1,400	885.00	1,239,000
日本精工	28,900	876.10	25,319,290
N T N	31,200	297.40	9,278,880
ジェイテクト	14,000	1,276.00	17,864,000
不二越	1,200	3,775.00	4,530,000
日本トムソン	3,800	573.00	2,177,400
T H K	9,100	2,843.50	25,875,850
ユーシン精機	1,300	704.00	915,200
前澤給装工業	1,100	1,129.00	1,241,900
イーグル工業	1,700	1,737.00	2,952,900
前澤工業	700	890.00	623,000
日本ピラー工業	1,500	4,465.00	6,697,500
キッツ	5,800	1,046.00	6,066,800
マキタ	19,600	3,999.00	78,380,400
三井E & S	7,500	494.00	3,705,000
日立造船	12,900	902.00	11,635,800
三菱重工業	27,500	6,345.00	174,487,500
I H I	9,900	3,641.00	36,045,900
スター精密	2,900	1,758.00	5,098,200
日清紡ホールディングス	12,800	1,188.00	15,206,400
イビデン	9,000	8,580.00	77,220,000
コニカミノルタ	35,300	498.50	17,597,050
ブラザー工業	21,000	2,148.50	45,118,500
ミネベアミツミ	27,400	2,601.00	71,267,400
日立製作所	76,500	8,755.00	669,757,500

東芝	30,300	4,525.00	137,107,500
三菱電機	162,700	2,052.50	333,941,750
富士電機	9,600	6,023.00	57,820,800
東洋電機製造	400	923.00	369,200
安川電機	18,700	6,233.00	116,557,100
シンフォニアテクノロジー	1,700	1,713.00	2,912,100
明電舎	2,400	1,995.00	4,788,000
オリジン	300	1,284.00	385,200
山洋電気	700	7,570.00	5,299,000
デンヨー	1,200	2,056.00	2,467,200
P H C ホールディングス	2,200	1,484.00	3,264,800
ソシオネクスト	2,200	15,090.00	33,198,000
東芝テック	2,300	3,905.00	8,981,500
芝浦メカトロニクス	300	22,920.00	6,876,000
マブチモーター	3,900	3,909.00	15,245,100
ニデック	38,300	7,779.00	297,935,700
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,200	521.00	625,200
トレックス・セミコンダクター	700	2,375.00	1,662,500
東光高岳	1,000	2,097.00	2,097,000
ダブル・スコープ	5,100	1,330.00	6,783,000
ダイヘン	1,400	5,540.00	7,756,000
ヤーマン	2,700	1,000.00	2,700,000
J V C ケンウッド	14,400	482.00	6,940,800
ミマキエンジニアリング	1,500	934.00	1,401,000
I - P E X	900	1,320.00	1,188,000
大崎電気工業	3,700	543.00	2,009,100
オムロン	14,400	8,506.00	122,486,400
日東工業	2,100	3,665.00	7,696,500
I D E C	2,300	3,085.00	7,095,500
正興電機製作所	500	1,025.00	512,500
不二電機工業	300	1,180.00	354,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,200	2,831.50	14,723,800
サクサホールディングス	300	2,020.00	606,000
メルコホールディングス	400	3,180.00	1,272,000
テクノメディカ	400	2,087.00	834,800

ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	600	806.00	483,600	
日本電気	22,300	6,894.00	153,736,200	
富士通	15,700	18,435.00	289,429,500	
沖電気工業	7,100	868.00	6,162,800	
岩崎通信機	600	789.00	473,400	
電気興業	600	2,317.00	1,390,200	
サンケン電気	1,500	13,460.00	20,190,000	
ナカヨ	200	1,134.00	226,800	
アイホン	1,000	2,488.00	2,488,000	
ルネサスエレクトロニクス	102,700	2,760.50	283,503,350	
セイコーエプソン	20,200	2,228.00	45,005,600	
ワコム	11,900	607.00	7,223,300	
アルバック	3,700	6,114.00	22,621,800	
アクセル	400	1,583.00	633,200	
E I Z O	1,200	4,760.00	5,712,000	
ジャパンディスプレイ	61,300	39.00	2,390,700	
日本信号	3,700	1,033.00	3,822,100	
京三製作所	3,300	502.00	1,656,600	
能美防災	2,100	1,698.00	3,565,800	
ホーチキ	1,200	1,745.00	2,094,000	
星和電機	500	522.00	261,000	
エレコム	3,800	1,495.00	5,681,000	
パナソニック ホールディングス	185,900	1,681.50	312,590,850	
シャープ	19,100	805.50	15,385,050	
アンリツ	11,100	1,234.50	13,702,950	
富士通ゼネラル	4,500	3,226.00	14,517,000	
ソニーグループ	110,300	13,200.00	1,455,960,000	代用有価証券 30,000株
T D K	24,900	5,463.00	136,028,700	
帝国通信工業	700	1,665.00	1,165,500	
タムラ製作所	6,800	633.00	4,304,400	
アルプスアルパイン	14,000	1,247.50	17,465,000	
池上通信機	400	681.00	272,400	
日本電波工業	1,900	1,202.00	2,283,800	
鈴木	900	928.00	835,200	
メイコー	1,700	2,683.00	4,561,100	

日本トリム	400	3,285.00	1,314,000
ローランド ディー.ジー.	900	3,530.00	3,177,000
フォスター電機	1,500	927.00	1,390,500
S M K	400	2,495.00	998,000
ヨコオ	1,300	1,872.00	2,433,600
ホシデン	3,700	1,729.00	6,397,300
ヒロセ電機	2,500	18,455.00	46,137,500
日本航空電子工業	3,200	3,030.00	9,696,000
T O A	1,800	947.00	1,704,600
マクセル	3,300	1,569.00	5,177,700
古野電気	2,000	1,210.00	2,420,000
スミダコーポレーション	1,700	1,491.00	2,534,700
アイコム	600	2,841.00	1,704,600
リオン	600	1,970.00	1,182,000
横河電機	17,200	2,656.50	45,691,800
新電元工業	600	3,235.00	1,941,000
アズビル	10,900	4,520.00	49,268,000
東亜ディーケーケー	600	853.00	511,800
日本光電工業	7,200	3,764.00	27,100,800
チノー	700	2,260.00	1,582,000
共和電業	1,100	353.00	388,300
日本電子材料	1,000	1,810.00	1,810,000
堀場製作所	3,500	8,173.00	28,605,500
アドバンテスト	12,300	21,850.00	268,755,000
小野測器	500	477.00	238,500
エスベック	1,300	2,314.00	3,008,200
キーエンス	15,600	67,520.00	1,053,312,000
日置電機	800	9,030.00	7,224,000
シスメックス	13,400	9,327.00	124,981,800
日本マイクロニクス	2,600	2,175.00	5,655,000
メガチップス	1,300	4,155.00	5,401,500
O B A R A G R O U P	900	4,115.00	3,703,500
澤藤電機	200	1,181.00	236,200
原田工業	600	810.00	486,000
コーセル	1,900	1,240.00	2,356,000
イリソ電子工業	1,400	4,015.00	5,621,000

オブテックスグループ	2,800	1,892.00	5,297,600	
千代田インテグレ	500	2,476.00	1,238,000	
レーザーテック	7,100	21,040.00	149,384,000	
スタンレー電気	11,100	2,696.00	29,925,600	
ウシオ電機	7,900	1,944.50	15,361,550	
岡谷電機産業	1,000	276.00	276,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,200	524.00	628,800	
エノモト	300	1,760.00	528,000	
日本セラミック	1,600	2,579.00	4,126,400	
遠藤照明	600	1,280.00	768,000	
古河電池	1,200	1,008.00	1,209,600	
双信電機	500	354.00	177,000	
山一電機	1,300	2,304.00	2,995,200	
図研	1,400	3,985.00	5,579,000	
日本電子	3,900	4,896.00	19,094,400	
カシオ計算機	11,600	1,189.50	13,798,200	
ファナック	76,100	4,728.00	359,800,800	
日本シイエムケイ	3,300	519.00	1,712,700	
エンプラス	500	5,360.00	2,680,000	
大真空	1,900	642.00	1,219,800	
ローム	7,200	13,795.00	99,324,000	
浜松ホトニクス	12,500	6,949.00	86,862,500	
三井ハイテック	1,600	9,420.00	15,072,000	
新光電気工業	5,500	5,828.00	32,054,000	
京セラ	24,200	7,643.00	184,960,600	
太陽誘電	7,600	4,339.00	32,976,400	
村田製作所	47,200	8,348.00	394,025,600	
双葉電子工業	3,000	485.00	1,455,000	
北陸電気工業	500	1,219.00	609,500	
ニチコン	3,200	1,409.00	4,508,800	
日本ケミコン	1,600	1,390.00	2,224,000	
K O A	2,400	1,833.00	4,399,200	
市光工業	2,400	507.00	1,216,800	
小糸製作所	18,800	2,542.00	47,789,600	
ミツバ	3,000	783.00	2,349,000	
S C R E E Nホールディングス	2,700	15,705.00	42,403,500	

キヤノン電子	1,700	1,863.00	3,167,100
キヤノン	85,500	3,727.00	318,658,500
リコー	39,100	1,218.00	47,623,800
象印マホービン	4,600	2,011.00	9,250,600
MUTOHホールディングス	200	1,761.00	352,200
東京エレクトロン	33,000	20,390.00	672,870,000
イノテック	1,000	1,607.00	1,607,000
トヨタ紡織	6,500	2,540.50	16,513,250
芦森工業	200	1,819.00	363,800
ユニプレス	2,800	1,095.00	3,066,000
豊田自動織機	11,400	10,095.00	115,083,000
モリタホールディングス	2,700	1,553.00	4,193,100
三櫻工業	2,400	829.00	1,989,600
デンソー	32,100	9,431.00	302,735,100
東海理化電機製作所	4,400	2,079.00	9,147,600
川崎重工業	11,800	3,434.00	40,521,200
名村造船所	3,100	573.00	1,776,300
日本車輛製造	600	1,988.00	1,192,800
三菱ロジスネクスト	2,500	1,278.00	3,195,000
近畿車輛	200	1,589.00	317,800
日産自動車	221,400	558.60	123,674,040
いすゞ自動車	45,300	1,742.50	78,935,250
トヨタ自動車	855,700	2,240.00	1,916,768,000
日野自動車	20,100	579.50	11,647,950
三菱自動車工業	61,000	495.40	30,219,400
エフテック	900	924.00	831,600
レシップホールディングス	600	529.00	317,400
GMB	300	1,492.00	447,600
ファルテック	300	614.00	184,200
武蔵精密工業	3,800	1,708.00	6,490,400
日産車体	2,900	916.00	2,656,400
新明和工業	5,000	1,338.00	6,690,000
極東開発工業	2,600	1,749.00	4,547,400
トビー工業	1,300	2,252.00	2,927,600
ティラド	400	1,823.00	729,200
タチエス	2,500	1,514.00	3,785,000

N O K	6,100	2,072.00	12,639,200
フタバ産業	4,200	559.00	2,347,800
K Y B	1,500	4,950.00	7,425,000
大同メタル工業	3,000	522.00	1,566,000
プレス工業	7,000	619.00	4,333,000
ミクニ	1,400	484.00	677,600
太平洋工業	3,600	1,284.00	4,622,400
アイシン	12,000	4,477.00	53,724,000
マツダ	51,600	1,277.50	65,919,000
今仙電機製作所	900	596.00	536,400
本田技研工業	126,700	4,220.00	534,674,000
スズキ	28,600	5,304.00	151,694,400
S U B A R U	49,300	2,490.50	122,781,650
安永	600	893.00	535,800
ヤマハ発動機	24,500	3,973.00	97,338,500
T B K	1,200	382.00	458,400
エクセディ	2,500	2,390.00	5,975,000
豊田合成	4,600	2,694.00	12,392,400
愛三工業	2,600	1,097.00	2,852,200
盟和産業	200	994.00	198,800
日本プラスト	1,000	437.00	437,000
ヨロズ	1,500	903.00	1,354,500
エフ・シー・シー	2,800	1,817.00	5,087,600
シマノ	6,300	24,620.00	155,106,000
テイ・エス テック	7,100	1,801.00	12,787,100
ジャムコ	700	1,449.00	1,014,300
テルモ	47,900	4,399.00	210,712,100
クリエートメディック	400	880.00	352,000
日機装	3,700	883.00	3,267,100
日本エム・ディ・エム	900	968.00	871,200
島津製作所	19,000	4,365.00	82,935,000
J M S	1,500	561.00	841,500
長野計器	1,100	2,104.00	2,314,400
バイ・テクノロジー	800	2,418.00	1,934,400
東京計器	1,200	1,308.00	1,569,600
愛知時計電機	600	1,537.00	922,200

インターアクション	800	1,148.00	918,400
オーバル	1,100	383.00	421,300
東京精密	3,400	7,690.00	26,146,000
マニー	6,200	1,766.00	10,949,200
ニコン	22,500	1,840.00	41,400,000
トプコン	8,200	1,968.00	16,137,600
オリンパス	95,900	2,230.00	213,857,000
理研計器	1,000	5,480.00	5,480,000
タムロン	1,200	4,260.00	5,112,000
H O Y A	33,100	16,305.00	539,695,500
シード	800	581.00	464,800
ノーリツ銅機	1,500	2,362.00	3,543,000
A & D ホロンホールディングス	2,300	1,842.00	4,236,600
朝日インテック	17,400	2,752.50	47,893,500
シチズン時計	17,100	871.00	14,894,100
リズム	400	1,534.00	613,600
大研医器	900	511.00	459,900
メニコン	5,400	2,465.50	13,313,700
シンシア	100	579.00	57,900
松風	700	2,265.00	1,585,500
セイコーグループ	2,400	2,588.00	6,211,200
ニプロ	13,000	1,015.00	13,195,000
K Y O R I T S U	2,100	184.00	386,400
中本パックス	400	1,607.00	642,800
スノーピーク	2,700	1,766.00	4,768,200
パラマウントベッドホールディングス	3,600	2,290.00	8,244,000
トランザクション	1,000	1,915.00	1,915,000
粧美堂	300	414.00	124,200
ニホンフラッシュ	1,500	959.00	1,438,500
前田工織	1,300	3,065.00	3,984,500
永大産業	1,300	215.00	279,500
アートネイチャー	1,600	780.00	1,248,000
バンダイナムコホールディングス	42,700	3,213.00	137,195,100
アイフィスジャパン	400	618.00	247,200
S H O E I	3,500	2,551.00	8,928,500
フランスベッドホールディングス	1,800	1,138.00	2,048,400

パイロットコーポレーション	2,400	4,386.00	10,526,400	
萩原工業	1,100	1,496.00	1,645,600	
フジシールインターナショナル	3,200	1,504.00	4,812,800	
タカラトミー	7,200	1,894.00	13,636,800	
広済堂ホールディングス	800	2,262.00	1,809,600	
エステールホールディングス	300	613.00	183,900	
タカノ	500	806.00	403,000	
プロネクサス	1,300	1,031.00	1,340,300	
ホクシン	1,000	139.00	139,000	
ウッドワン	400	1,186.00	474,400	
大建工業	1,000	2,291.00	2,291,000	
凸版印刷	19,200	3,080.00	59,136,000	
大日本印刷	17,000	3,966.00	67,422,000	
共同印刷	500	3,110.00	1,555,000	
N I S S H A	3,000	1,686.00	5,058,000	
光村印刷	100	1,212.00	121,200	
T A K A R A & C O M P A N Y	1,000	2,327.00	2,327,000	
アシックス	14,400	4,103.00	59,083,200	
ツツミ	300	2,267.00	680,100	
ローランド	1,200	4,110.00	4,932,000	
小松ウオール工業	600	2,697.00	1,618,200	
ヤマハ	9,800	5,288.00	51,822,400	
河合楽器製作所	400	3,540.00	1,416,000	
クリナップ	1,800	708.00	1,274,400	
ピジョン	9,900	1,923.50	19,042,650	
キングジム	1,400	878.00	1,229,200	
リンテック	3,100	2,284.00	7,080,400	
イトーキ	3,300	1,016.00	3,352,800	
任天堂	98,400	6,360.00	625,824,000	
三菱鉛筆	2,200	1,624.00	3,572,800	
タカラスタンダード	2,900	1,848.00	5,359,200	
コクヨ	7,500	2,012.50	15,093,750	
ナカバヤシ	1,700	502.00	853,400	
グロープライド	1,300	2,192.00	2,849,600	
オカムラ	4,700	1,947.00	9,150,900	
美津濃	1,500	3,710.00	5,565,000	

東京電力ホールディングス	140,500	501.90	70,516,950	
中部電力	57,400	1,645.50	94,451,700	
関西電力	60,200	1,693.00	101,918,600	
中国電力	24,900	908.90	22,631,610	
北陸電力	14,800	721.50	10,678,200	
東北電力	38,200	844.50	32,259,900	
四国電力	13,300	952.30	12,665,590	
九州電力	36,100	873.50	31,533,350	
北海道電力	15,100	549.40	8,295,940	
沖縄電力	3,700	1,112.00	4,114,400	
電源開発	11,700	2,126.00	24,874,200	
エフオン	1,100	543.00	597,300	
イーレックス	2,800	1,136.00	3,180,800	
レノバ	4,200	1,472.00	6,182,400	
東京瓦斯	33,000	3,109.00	102,597,000	
大阪瓦斯	31,500	2,132.50	67,173,750	
東邦瓦斯	6,100	2,416.50	14,740,650	
北海道瓦斯	900	2,280.00	2,052,000	
広島ガス	3,300	371.00	1,224,300	
西部ガスホールディングス	1,500	1,968.00	2,952,000	
静岡ガス	3,500	1,060.00	3,710,000	
メタウォーター	1,900	1,771.00	3,364,900	
SBSホールディングス	1,400	3,360.00	4,704,000	
東武鉄道	17,100	3,561.00	60,893,100	
相鉄ホールディングス	5,200	2,446.50	12,721,800	
東急	43,800	1,683.00	73,715,400	
京浜急行電鉄	17,700	1,290.50	22,841,850	
小田急電鉄	23,600	1,852.00	43,707,200	
京王電鉄	8,300	4,279.00	35,515,700	
京成電鉄	10,000	5,683.00	56,830,000	
富士急行	1,900	5,250.00	9,975,000	
東日本旅客鉄道	26,400	7,646.00	201,854,400	
西日本旅客鉄道	19,900	5,657.00	112,574,300	
東海旅客鉄道	12,000	17,075.00	204,900,000	
西武ホールディングス	18,900	1,453.00	27,461,700	
鴻池運輸	2,700	1,747.00	4,716,900	

西日本鉄道	4,200	2,406.00	10,105,200	
ハマキョウレックス	1,200	3,750.00	4,500,000	
サカイ引越センター	700	5,100.00	3,570,000	
近鉄グループホールディングス	15,600	4,510.00	70,356,000	
阪急阪神ホールディングス	20,700	4,488.00	92,901,600	
南海電気鉄道	7,400	2,939.50	21,752,300	
京阪ホールディングス	8,600	3,628.00	31,200,800	
神戸電鉄	400	2,980.00	1,192,000	
名古屋鉄道	17,200	2,201.00	37,857,200	
山陽電気鉄道	1,200	2,164.00	2,596,800	
アルプス物流	1,200	1,538.00	1,845,600	
ヤマトホールディングス	19,900	2,623.50	52,207,650	
山九	4,000	4,726.00	18,904,000	
丸運	600	237.00	142,200	
丸全昭和運輸	1,000	4,030.00	4,030,000	
センコーグループホールディングス	8,200	1,006.00	8,249,200	
トナミホールディングス	400	4,955.00	1,982,000	
ニッコンホールディングス	5,000	2,842.50	14,212,500	
日本石油輸送	100	2,842.00	284,200	
福山通運	1,200	3,850.00	4,620,000	
セイノーホールディングス	9,700	2,107.00	20,437,900	
エスライングループ本社	400	867.00	346,800	
神奈川中央交通	400	3,140.00	1,256,000	
A Z - C O M丸和ホールディングス	3,800	1,998.00	7,592,400	
C & F ロジホールディングス	1,500	1,255.00	1,882,500	
九州旅客鉄道	11,000	3,010.00	33,110,000	
S Gホールディングス	29,900	2,148.50	64,240,150	
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	5,800	8,085.00	46,893,000	
日本郵船	41,600	3,367.00	140,067,200	
商船三井	27,400	3,622.00	99,242,800	
川崎汽船	11,700	3,969.00	46,437,300	
N S ユナイテッド海運	800	3,525.00	2,820,000	
飯野海運	5,700	875.00	4,987,500	
乾汽船	2,000	1,247.00	2,494,000	
日本航空	38,200	3,005.00	114,791,000	

A N Aホールディングス	42,400	3,283.00	139,199,200	
パスコ	300	1,802.00	540,600	
トランコム	500	7,000.00	3,500,000	
日新	1,200	2,473.00	2,967,600	
三菱倉庫	3,300	3,440.00	11,352,000	
三井倉庫ホールディングス	1,500	3,485.00	5,227,500	
住友倉庫	4,200	2,346.00	9,853,200	
澁澤倉庫	600	2,810.00	1,686,000	
東陽倉庫	1,700	268.00	455,600	
日本トランスシティ	3,200	630.00	2,016,000	
ケイヒン	200	1,757.00	351,400	
中央倉庫	800	1,076.00	860,800	
川西倉庫	200	1,026.00	205,200	
安田倉庫	1,100	987.00	1,085,700	
ファイズホールディングス	200	1,162.00	232,400	
東洋埠頭	400	1,360.00	544,000	
上組	7,500	3,152.00	23,640,000	
サンリツ	300	734.00	220,200	
キムラユニティー	600	1,276.00	765,600	
キューソー流通システム	700	894.00	625,800	
東海運	1,000	286.00	286,000	
エーアイテイー	1,000	1,807.00	1,807,000	
内外トランスライン	600	2,609.00	1,565,400	
日本コンセプト	500	1,884.00	942,000	
N E C ネットエスアイ	5,200	1,961.00	10,197,200	
クロスキャット	900	1,136.00	1,022,400	
システナ	26,200	296.00	7,755,200	
デジタルアーツ	1,000	5,560.00	5,560,000	
日鉄ソリューションズ	2,700	4,010.00	10,827,000	
キューブシステム	900	1,201.00	1,080,900	
コア	700	1,760.00	1,232,000	
手間いらず	300	3,815.00	1,144,500	
ラクーンホールディングス	1,300	681.00	885,300	
ソリトンシステムズ	800	1,252.00	1,001,600	
ソフトクリエイイトホールディングス	1,300	1,721.00	2,237,300	
T I S	17,100	3,553.00	60,756,300	

JNSホールディングス	700	484.00	338,800	
グリー	4,200	638.00	2,679,600	
GMOペパボ	200	1,725.00	345,000	
コーエーテクモホールディングス	9,800	2,381.50	23,338,700	
三菱総合研究所	800	5,370.00	4,296,000	
ボルテージ	400	306.00	122,400	
電算	200	1,584.00	316,800	
AGS	500	727.00	363,500	
ファインデックス	1,300	598.00	777,400	
ブレインパッド	1,200	966.00	1,159,200	
KLab	3,300	321.00	1,059,300	
ポルトゥウィンホールディングス	2,700	717.00	1,935,900	
ネクソン	39,900	2,774.00	110,682,600	
アイスタイル	4,600	517.00	2,378,200	
エムアップホールディングス	1,900	1,190.00	2,261,000	
エイチーム	900	711.00	639,900	
エニグモ	2,100	386.00	810,600	
テクノスジャパン	1,000	658.00	658,000	
コロプラ	6,200	639.00	3,961,800	
ブロードリーフ	9,200	440.00	4,048,000	
クロス・マーケティンググループ	700	789.00	552,300	
デジタルハーツホールディングス	1,000	1,365.00	1,365,000	
システム情報	1,300	749.00	973,700	
メディアドゥ	600	1,389.00	833,400	
じげん	4,600	803.00	3,693,800	
ブイキューブ	1,900	443.00	841,700	
エンカレッジ・テクノロジー	400	518.00	207,200	
サイバーリンクス	400	679.00	271,600	
フィックスターズ	1,800	1,427.00	2,568,600	
CARTA HOLDINGS	700	1,206.00	844,200	
オブティム	1,300	974.00	1,266,200	
セレス	600	1,028.00	616,800	
SHIFT	1,000	32,030.00	32,030,000	
ティーガイア	1,600	1,740.00	2,784,000	
セック	200	3,110.00	622,000	
テクマトリックス	2,900	1,839.00	5,333,100	

プロシップ	700	1,376.00	963,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,600	2,737.00	12,590,200
GMOペイメントゲートウェイ	3,100	11,235.00	34,828,500
ザッパラス	400	374.00	149,600
システムリサーチ	500	2,561.00	1,280,500
インターネットイニシアティブ	8,500	2,617.00	22,244,500
さくらインターネット	1,800	1,133.00	2,039,400
ヴィンクス	400	1,314.00	525,600
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	3,030.00	1,515,000
SRAホールディングス	800	3,140.00	2,512,000
システムインテグレータ	400	431.00	172,400
朝日ネット	1,700	672.00	1,142,400
eBASE	2,200	718.00	1,579,600
アバントグループ	2,000	1,488.00	2,976,000
アドソル日進	700	1,643.00	1,150,100
ODKソリューションズ	300	567.00	170,100
フリービット	800	1,299.00	1,039,200
コムチュア	2,100	2,014.00	4,229,400
サイバーコム	200	1,379.00	275,800
アステリア	1,200	846.00	1,015,200
アイル	700	2,635.00	1,844,500
マークラインズ	900	2,587.00	2,328,300
メディカル・データ・ビジョン	2,300	673.00	1,547,900
gumi	2,400	706.00	1,694,400
ショーケース	300	362.00	108,600
モバイルファクトリー	300	835.00	250,500
テラスカイ	700	2,063.00	1,444,100
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	900	1,637.00	1,473,300
PCIホールディングス	500	1,112.00	556,000
アイビーシー	200	589.00	117,800
ネオジャパン	500	1,054.00	527,000
PR TIMES	400	1,664.00	665,600
ラクス	7,400	2,390.50	17,689,700
ランドコンピュータ	300	1,214.00	364,200
ダブルスタンダード	600	2,456.00	1,473,600

オーブンドア	1,100	1,238.00	1,361,800	
マイネット	400	326.00	130,400	
アカツキ	800	2,071.00	1,656,800	
ベネフィットジャパン	100	1,182.00	118,200	
U b i c o mホールディングス	500	1,378.00	689,000	
カナミックネットワーク	1,800	448.00	806,400	
ノムラシステムコーポレーション	1,300	119.00	154,700	
チェンジホールディングス	3,800	1,930.00	7,334,000	
シンクロ・フード	800	700.00	560,000	
オークネット	800	1,734.00	1,387,200	
キャピタル・アセット・プランニング	300	785.00	235,500	
セグエグループ	400	1,070.00	428,000	
エイトレッド	200	1,519.00	303,800	
マクロミル	3,100	782.00	2,424,200	
ビーグリー	200	1,097.00	219,400	
オロ	500	1,988.00	994,000	
ユーザーローカル	600	2,400.00	1,440,000	
テモナ	300	283.00	84,900	
ニーズウェル	700	794.00	555,800	
マネーフォワード	3,800	5,747.00	21,838,600	
サインポスト	500	478.00	239,000	
Sun Asterisk	1,100	1,139.00	1,252,900	
電算システムホールディングス	800	3,240.00	2,592,000	
Appier Group	5,900	1,695.00	10,000,500	
ソルクシーズ	1,000	425.00	425,000	
フェイス	400	509.00	203,600	
プロトコーポレーション	2,000	1,205.00	2,410,000	
ハイマックス	500	1,410.00	705,000	
野村総合研究所	31,100	3,937.00	122,440,700	
サイバネットシステム	1,300	829.00	1,077,700	
C Eホールディングス	600	641.00	384,600	
日本システム技術	500	2,393.00	1,196,500	
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	1,175.00	470,000	
ソースネクスト	8,200	189.00	1,549,800	
インフォコム	2,000	2,309.00	4,618,000	

シンプレクス・ホールディングス	2,700	2,629.00	7,098,300
HEROZ	500	2,024.00	1,012,000
ラクスル	3,800	1,461.00	5,551,800
メルカリ	9,400	3,497.00	32,871,800
I P S	500	2,356.00	1,178,000
F I G	1,500	277.00	415,500
システムサポート	600	2,018.00	1,210,800
イーソル	1,000	861.00	861,000
アルテリア・ネットワークス	1,500	1,978.00	2,967,000
東海ソフト	200	1,071.00	214,200
ウイングアーク1st	1,600	2,890.00	4,624,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,554.00	621,600
サーバーワークス	300	3,660.00	1,098,000
東名	100	2,838.00	283,800
ヴィッツ	100	1,192.00	119,200
トピラシステムズ	300	927.00	278,100
S a n s a n	5,100	1,624.50	8,284,950
L i n k - U	300	944.00	283,200
ギフトィ	1,700	1,733.00	2,946,100
メドレー	2,100	5,090.00	10,689,000
ベース	500	5,430.00	2,715,000
J M D C	2,600	5,501.00	14,302,600
フォーカスシステムズ	1,200	1,016.00	1,219,200
クレスコ	1,200	2,025.00	2,430,000
フジ・メディア・ホールディングス	15,000	1,537.50	23,062,500
オービック	5,200	23,175.00	120,510,000
ジャストシステム	2,200	4,277.00	9,409,400
T D C ソフト	1,300	1,814.00	2,358,200
Zホールディングス	222,400	383.80	85,357,120
トレンドマイクロ	9,000	6,544.00	58,896,000
I Dホールディングス	1,100	1,248.00	1,372,800
日本オラクル	3,000	10,305.00	30,915,000
アルファシステムズ	500	3,365.00	1,682,500
フューチャー	3,900	1,839.00	7,172,100
C A C H o l d i n g s	1,000	1,663.00	1,663,000

S Bテクノロジー	700	2,660.00	1,862,000	
トーセ	400	740.00	296,000	
オービックビジネスコンサルタント	3,100	5,370.00	16,647,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	8,400	3,555.00	29,862,000	
アイティフォー	2,100	1,087.00	2,282,700	
東計電算	200	6,130.00	1,226,000	
エクスネット	200	1,014.00	202,800	
大塚商会	8,800	5,753.00	50,626,400	
サイボウズ	2,200	2,211.00	4,864,200	
電通国際情報サービス	1,900	5,380.00	10,222,000	
A C C E S S	1,900	924.00	1,755,600	
デジタルガレージ	2,800	4,170.00	11,676,000	
E Mシステムズ	2,600	848.00	2,204,800	
ウェザーニューズ	500	6,500.00	3,250,000	
C I J	2,600	558.00	1,450,800	
ビジネスエンジニアリング	200	3,025.00	605,000	
日本エンタープライズ	1,300	137.00	178,100	
WOWOW	1,200	1,138.00	1,365,600	
スカラ	1,500	751.00	1,126,500	
インテリジェント ウェイブ	700	789.00	552,300	
I M A G I C A G R O U P	1,300	668.00	868,400	
ネットワンシステムズ	5,800	3,071.00	17,811,800	
システムソフト	5,400	82.00	442,800	
アルゴグラフィックス	1,400	3,645.00	5,103,000	
マーベラス	2,600	677.00	1,760,200	
エイベックス	2,700	1,528.00	4,125,600	
B I P R O G Y	5,800	3,433.00	19,911,400	
都築電気	800	1,896.00	1,516,800	
T B Sホールディングス	8,000	2,576.00	20,608,000	
日本テレビホールディングス	13,800	1,336.50	18,443,700	
朝日放送グループホールディングス	1,500	666.00	999,000	
テレビ朝日ホールディングス	3,800	1,711.00	6,501,800	
スカパーJ S A Tホールディングス	14,000	570.00	7,980,000	
テレビ東京ホールディングス	1,100	3,460.00	3,806,000	
日本BS放送	500	930.00	465,000	
ビジョン	2,100	1,729.00	3,630,900	

スマートバリュー	400	385.00	154,000
USEN-NEXT HOLDINGS	1,800	3,495.00	6,291,000
日本通信	14,500	239.00	3,465,500
クロップス	200	983.00	196,600
日本電信電話	5,007,500	161.50	808,711,250
KDDI	120,800	4,244.00	512,675,200
ソフトバンク	251,100	1,533.00	384,936,300
光通信	1,800	21,065.00	37,917,000
エムティーアイ	1,100	576.00	633,600
GMOインターネットグループ	5,800	2,767.00	16,048,600
ファイバーゲート	900	1,441.00	1,296,900
アйдママーケティングコミュニケーション	400	275.00	110,000
KADOKAWA	8,200	3,440.00	28,208,000
学研ホールディングス	2,700	871.00	2,351,700
ゼンリン	2,700	929.00	2,508,300
昭文社ホールディングス	500	307.00	153,500
インプレスホールディングス	1,100	212.00	233,200
アイネット	1,000	1,641.00	1,641,000
松竹	900	10,840.00	9,756,000
東宝	9,800	5,597.00	54,850,600
東映	400	17,690.00	7,076,000
NTTデータグループ	49,000	1,935.50	94,839,500
ピー・シー・エー	900	1,552.00	1,396,800
ビジネスブレイン太田昭和	700	2,239.00	1,567,300
DTS	3,300	3,415.00	11,269,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,900	6,515.00	51,468,500
シーイーシー	2,200	1,775.00	3,905,000
カブコン	15,600	5,759.00	89,840,400
アイ・エス・ビー	800	1,572.00	1,257,600
ジャステック	1,000	1,352.00	1,352,000
SCSK	12,700	2,245.00	28,511,500
NSW	600	2,426.00	1,455,600
アイネス	1,100	1,476.00	1,623,600
TKC	2,500	3,780.00	9,450,000
富士ソフト	3,600	4,670.00	16,812,000
NSD	5,600	2,787.00	15,607,200

コナミグループ	6,700	7,564.00	50,678,800
福井コンピュータホールディングス	1,100	2,653.00	2,918,300
J B C Cホールディングス	1,100	2,475.00	2,722,500
ミロク情報サービス	1,400	1,622.00	2,270,800
ソフトバンクグループ	77,100	6,897.00	531,758,700
高千穂交易	500	3,020.00	1,510,000
オルバヘルスケアホールディングス	200	1,737.00	347,400
伊藤忠食品	400	5,100.00	2,040,000
エレマテック	1,500	1,801.00	2,701,500
あらた	1,300	4,830.00	6,279,000
トーメンデバイス	200	4,880.00	976,000
東京エレクトロン デバイス	600	10,220.00	6,132,000
円谷フィールズホールディングス	2,800	2,863.00	8,016,400
双日	16,400	3,189.00	52,299,600
アルフレッサ ホールディングス	16,500	2,132.50	35,186,250
横浜冷凍	4,600	1,180.00	5,428,000
神栄	200	1,059.00	211,800
ラサ商事	600	1,436.00	861,600
アルコニックス	2,200	1,391.00	3,060,200
神戸物産	12,800	3,768.00	48,230,400
ハイパー	300	450.00	135,000
あい ホールディングス	2,600	2,259.00	5,873,400
ディーブイエックス	400	852.00	340,800
ダイワボウホールディングス	6,800	2,815.50	19,145,400
マクニカホールディングス	3,900	5,880.00	22,932,000
ラクト・ジャパン	700	1,930.00	1,351,000
グリムス	700	2,779.00	1,945,300
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,400	905.00	2,172,000
八洲電機	1,400	1,334.00	1,867,600
メディアスホールディングス	1,000	784.00	784,000
レスターホールディングス	1,600	2,334.00	3,734,400
ジューテックホールディングス	300	1,165.00	349,500
大光	700	576.00	403,200
O C H Iホールディングス	300	1,303.00	390,900
T O K A Iホールディングス	8,100	889.00	7,200,900
黒谷	500	605.00	302,500

C o m i n i x	300	851.00	255,300
三洋貿易	1,900	1,325.00	2,517,500
ビューティガレージ	300	4,800.00	1,440,000
ウイン・パートナーズ	1,200	1,069.00	1,282,800
ミタチ産業	300	1,091.00	327,300
シップヘルスケアホールディングス	5,900	2,274.00	13,416,600
明治電機工業	600	1,477.00	886,200
デリカフーズホールディングス	700	592.00	414,400
スターティアホールディングス	300	1,266.00	379,800
コメダホールディングス	4,100	2,680.00	10,988,000
ピーバンドットコム	300	462.00	138,600
アセンテック	600	704.00	422,400
富士興産	300	1,582.00	474,600
協栄産業	100	1,983.00	198,300
フルサト・マルカホールディングス	1,600	2,542.00	4,067,200
ヤマエグループホールディングス	1,000	3,025.00	3,025,000
小野建	1,800	1,656.00	2,980,800
南陽	300	2,141.00	642,300
佐島電機	800	1,485.00	1,188,000
エコートレーディング	300	1,198.00	359,400
伯東	1,000	5,650.00	5,650,000
コンドーテック	1,300	1,186.00	1,541,800
中山福	700	343.00	240,100
ナガイレーベン	2,100	2,225.00	4,672,500
三菱食品	1,500	3,655.00	5,482,500
松田産業	1,300	2,253.00	2,928,900
第一興商	6,400	2,702.00	17,292,800
メディバルホールディングス	15,700	2,345.00	36,816,500
S P K	700	1,759.00	1,231,300
萩原電気ホールディングス	700	3,270.00	2,289,000
アズワン	2,300	5,486.00	12,617,800
スズデン	600	2,184.00	1,310,400
シモジマ	1,100	1,054.00	1,159,400
ドウシシャ	1,700	2,239.00	3,806,300
小津産業	300	1,553.00	465,900
高速	900	2,018.00	1,816,200

たけびし	600	1,708.00	1,024,800	
リックス	300	3,110.00	933,000	
丸文	1,500	1,217.00	1,825,500	
ハピネット	1,400	2,095.00	2,933,000	
橋本総業ホールディングス	700	1,194.00	835,800	
日本ライフライン	4,800	979.00	4,699,200	
タカショー	1,400	675.00	945,000	
I D O M	5,000	820.00	4,100,000	
進和	1,000	2,140.00	2,140,000	
エスケイジャパン	400	665.00	266,000	
ダイトロン	700	3,055.00	2,138,500	
シークス	2,400	1,549.00	3,717,600	
田中商事	400	642.00	256,800	
オーハシテクニカ	800	1,584.00	1,267,200	
白銅	600	2,278.00	1,366,800	
ダイコー通産	100	1,102.00	110,200	
伊藤忠商事	101,600	5,480.00	556,768,000	
丸紅	128,700	2,386.00	307,078,200	
高島	200	3,470.00	694,000	
長瀬産業	7,500	2,353.00	17,647,500	
蝶理	900	2,929.00	2,636,100	
豊田通商	14,400	7,272.00	104,716,800	
三共生興	2,400	615.00	1,476,000	
兼松	6,400	1,995.00	12,768,000	
ツカモトコーポレーション	200	1,241.00	248,200	
三井物産	117,000	5,178.00	605,826,000	
日本紙パルプ商事	900	4,545.00	4,090,500	
カメイ	1,800	1,465.00	2,637,000	
O U Gホールディングス	200	2,424.00	484,800	
スターゼン	1,300	2,282.00	2,966,600	
山善	4,400	1,107.00	4,870,800	
橋本興業	300	4,255.00	1,276,500	
住友商事	102,100	2,938.50	300,020,850	
内田洋行	700	5,730.00	4,011,000	
三菱商事	100,600	6,914.00	695,548,400	
第一実業	600	5,220.00	3,132,000	

キヤノンマーケティングジャパン	3,800	3,635.00	13,813,000	
西華産業	700	1,973.00	1,381,100	
佐藤商事	1,200	1,439.00	1,726,800	
菱洋エレクトロ	1,400	3,615.00	5,061,000	
東京産業	1,600	865.00	1,384,000	
ユアサ商事	1,400	4,510.00	6,314,000	
神鋼商事	400	5,620.00	2,248,000	
トルク	800	250.00	200,000	
阪和興業	3,000	4,480.00	13,440,000	
正栄食品工業	1,100	4,265.00	4,691,500	
カナデン	1,100	1,299.00	1,428,900	
RYODEN	1,300	2,174.00	2,826,200	
岩谷産業	3,800	7,400.00	28,120,000	
ナイス	400	1,443.00	577,200	
ニチモウ	100	3,885.00	388,500	
極東貿易	1,000	1,731.00	1,731,000	
アステナホールディングス	2,900	435.00	1,261,500	
三愛オブリ	4,400	1,501.00	6,604,400	
稲畑産業	3,300	3,175.00	10,477,500	
G S Iクレオス	1,000	1,954.00	1,954,000	
明和産業	2,200	676.00	1,487,200	
クワザワホールディングス	600	527.00	316,200	
ワキタ	3,100	1,235.00	3,828,500	
東邦ホールディングス	4,100	2,696.50	11,055,650	
サンゲツ	4,100	2,504.00	10,266,400	
ミツウロコグループホールディングス	2,100	1,307.00	2,744,700	
シナネンホールディングス	500	3,820.00	1,910,000	
伊藤忠エネクス	4,100	1,290.00	5,289,000	
サンリオ	4,700	6,000.00	28,200,000	
サンワテクノス	800	2,270.00	1,816,000	
リョーサン	1,700	4,380.00	7,446,000	
新光商事	2,200	1,131.00	2,488,200	
トーヨー	700	2,663.00	1,864,100	
三信電気	700	2,119.00	1,483,300	
東陽テクニカ	1,700	1,387.00	2,357,900	
モスフードサービス	2,400	3,230.00	7,752,000	

加賀電子	1,300	6,290.00	8,177,000	
ソーダニッカ	1,000	819.00	819,000	
立花エレテック	1,200	2,735.00	3,282,000	
フォーバル	700	1,151.00	805,700	
PALTAC	2,600	4,745.00	12,337,000	
三谷産業	2,900	316.00	916,400	
太平洋興発	500	762.00	381,000	
西本Wismettacホールディングス	400	4,465.00	1,786,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	2,000.00	200,000	
コア商事ホールディングス	900	672.00	604,800	
KPPグループホールディングス	3,900	627.00	2,445,300	
ヤマタネ	700	1,739.00	1,217,300	
丸紅建材リース	100	2,364.00	236,400	
泉州電業	800	3,600.00	2,880,000	
トラスコ中山	3,500	2,134.00	7,469,000	
オートバックスセブン	5,700	1,534.00	8,743,800	
モリト	1,200	1,140.00	1,368,000	
加藤産業	2,000	3,730.00	7,460,000	
北恵	300	770.00	231,000	
イエローハット	2,900	1,822.00	5,283,800	
JKホールディングス	1,300	980.00	1,274,000	
日伝	1,000	2,435.00	2,435,000	
北沢産業	800	320.00	256,000	
杉本商事	700	2,108.00	1,475,600	
因幡電機産業	4,200	3,105.00	13,041,000	
東テク	600	5,100.00	3,060,000	
ミスミグループ本社	24,900	2,759.00	68,699,100	
アルテック	700	248.00	173,600	
タキヒヨー	300	1,175.00	352,500	
蔵王産業	200	2,398.00	479,600	
スズケン	4,800	3,952.00	18,969,600	
ジェコス	1,100	870.00	957,000	
グローセル	1,600	418.00	668,800	
ローソン	4,100	6,778.00	27,789,800	
サンエー	1,300	4,720.00	6,136,000	
カワチ薬品	1,300	2,171.00	2,822,300	

エービーシー・マート	2,400	7,896.00	18,950,400
ハードオフコーポレーション	500	1,466.00	733,000
アスクル	3,400	2,059.00	7,000,600
ゲオホールディングス	1,600	1,756.00	2,809,600
アダストリア	2,000	2,750.00	5,500,000
ジーフット	900	280.00	252,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	300	911.00	273,300
くら寿司	1,900	3,115.00	5,918,500
キャンドウ	600	2,615.00	1,569,000
I Kホールディングス	400	371.00	148,400
パルグループホールディングス	1,600	3,980.00	6,368,000
エディオン	6,500	1,450.00	9,425,000
サーラコーポレーション	3,500	724.00	2,534,000
ワッツ	600	632.00	379,200
ハローズ	700	3,655.00	2,558,500
フジオフードグループ本社	2,000	1,439.00	2,878,000
あみやき亭	400	3,325.00	1,330,000
大黒天物産	500	6,060.00	3,030,000
ハニーズホールディングス	1,300	1,607.00	2,089,100
ファーマライズホールディングス	300	613.00	183,900
アルペン	1,400	1,950.00	2,730,000
ハブ	400	864.00	345,600
クオールホールディングス	2,300	1,686.00	3,877,800
ジinzホールディングス	1,000	3,655.00	3,655,000
ビックカメラ	8,800	1,073.00	9,442,400
D C Mホールディングス	9,600	1,196.00	11,481,600
MonotaRO	23,400	1,756.00	41,090,400
東京一番フーズ	400	503.00	201,200
アーランドサービスホールディングス	1,400	2,941.00	4,117,400
J . フロント リテイリング	20,600	1,341.00	27,624,600
ドトール・日レスホールディングス	3,000	2,108.00	6,324,000
マツキヨココカラ&カンパニー	10,000	7,948.00	79,480,000
ブロンコビリー	900	2,845.00	2,560,500
Z O Z O	10,900	2,805.00	30,574,500
トレジャー・ファクトリー	800	1,464.00	1,171,200
物語コーポレーション	2,800	3,360.00	9,408,000

三越伊勢丹ホールディングス	27,800	1,422.00	39,531,600	
H a m e e	600	1,015.00	609,000	
マーケットエンタープライズ	200	1,536.00	307,200	
ウエルシアホールディングス	8,500	2,708.00	23,018,000	
クリエイトSDホールディングス	2,700	3,495.00	9,436,500	
丸善C H Iホールディングス	1,500	350.00	525,000	
ミサワ	300	611.00	183,300	
ティーライフ	200	1,533.00	306,600	
シュッピン	1,200	1,033.00	1,239,600	
オイシックス・ラ・大地	2,200	2,291.00	5,040,200	
ネクステージ	3,800	3,565.00	13,547,000	
ジョイフル本田	4,800	1,636.00	7,852,800	
鳥貴族ホールディングス	600	2,550.00	1,530,000	
ホットランド	1,300	1,690.00	2,197,000	
すかいらーくホールディングス	22,600	1,799.50	40,668,700	
S F Pホールディングス	1,000	2,163.00	2,163,000	
綿半ホールディングス	1,300	1,344.00	1,747,200	
ヨシックスホールディングス	300	2,573.00	771,900	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,400	1,102.00	5,950,800	
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	777.00	621,600	
B E E N O S	700	2,032.00	1,422,400	
あさひ	1,400	1,261.00	1,765,400	
日本調剤	1,100	1,181.00	1,299,100	
コスモス薬品	1,600	15,715.00	25,144,000	
トーエル	600	733.00	439,800	
セブン&アイ・ホールディングス	56,800	5,905.00	335,404,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	12,500	991.00	12,387,500	
ツルハホールディングス	3,500	10,840.00	37,940,000	
サンマルクホールディングス	1,400	1,883.00	2,636,200	
フェリシモ	300	1,008.00	302,400	
トリドールホールディングス	4,100	3,195.00	13,099,500	
T O K Y O B A S E	1,700	336.00	571,200	
ウイルプラスホールディングス	200	1,159.00	231,800	
J Mホールディングス	1,200	1,955.00	2,346,000	
サツドラホールディングス	700	739.00	517,300	

アレンザホールディングス	1,200	994.00	1,192,800	
串カツ田中ホールディングス	500	1,560.00	780,000	
バロックジャパンリミテッド	1,100	931.00	1,024,100	
クスリのアオキホールディングス	1,500	7,943.00	11,914,500	
FOOD & LIFE COMPANIE	8,800	2,617.50	23,034,000	
メディカルシステムネットワーク	1,500	362.00	543,000	
一家ホールディングス	500	672.00	336,000	
ジャパンクラフトホールディングス	1,000	248.00	248,000	
はるやまホールディングス	600	500.00	300,000	
ノジマ	5,400	1,382.00	7,462,800	
カップ・クリエイト	2,700	1,501.00	4,052,700	
ライトオン	1,100	591.00	650,100	
良品計画	18,000	1,680.50	30,249,000	
パリミキホールディングス	1,600	325.00	520,000	
アドヴァングループ	1,600	973.00	1,556,800	
アルピス	600	2,414.00	1,448,400	
コナカ	1,400	399.00	558,600	
ハウス オブ ローゼ	200	1,603.00	320,600	
G - 7ホールディングス	2,100	1,226.00	2,574,600	
イオン北海道	2,400	854.00	2,049,600	
コジマ	2,700	614.00	1,657,800	
ヒマラヤ	400	937.00	374,800	
コーナン商事	2,200	3,445.00	7,579,000	
エコス	600	2,006.00	1,203,600	
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	33,300	2,681.50	89,293,950	
西松屋チェーン	3,700	1,699.00	6,286,300	
ゼンショーホールディングス	9,000	6,754.00	60,786,000	
ハークスレイ	600	643.00	385,800	
サイゼリヤ	2,400	4,200.00	10,080,000	
V Tホールディングス	6,300	524.00	3,301,200	
魚力	500	2,160.00	1,080,000	
フジ・コーポレーション	900	1,778.00	1,600,200	
ユナイテッドアローズ	1,800	2,390.00	4,302,000	
ハイデイ日高	2,500	2,474.00	6,185,000	
YU - WA Creation Holdi ngs	900	187.00	168,300	

コロワイド	7,700	2,029.00	15,623,300
ピーシーデポコーポレーション	1,900	479.00	910,100
壱番屋	1,300	5,450.00	7,085,000
P L A N T	300	737.00	221,100
スギホールディングス	3,300	6,332.00	20,895,600
薬王堂ホールディングス	900	2,508.00	2,257,200
スクロール	2,400	932.00	2,236,800
ヨンドシーホールディングス	1,400	1,872.00	2,620,800
木曽路	2,500	2,414.00	6,035,000
S R S ホールディングス	2,900	972.00	2,818,800
千趣会	3,400	390.00	1,326,000
リテールパートナーズ	2,400	1,551.00	3,722,400
ケーヨー	2,700	840.00	2,268,000
上新電機	1,500	1,990.00	2,985,000
日本瓦斯	8,700	1,913.00	16,643,100
ロイヤルホールディングス	3,300	2,575.00	8,497,500
東天紅	100	804.00	80,400
いなげや	1,700	1,468.00	2,495,600
チヨダ	1,600	971.00	1,553,600
ライフコーポレーション	1,400	3,380.00	4,732,000
リンガーハット	2,200	2,496.00	5,491,200
MrMaxHD	2,300	599.00	1,377,700
AOKIホールディングス	3,100	898.00	2,783,800
オークワ	2,600	836.00	2,173,600
コメリ	2,500	2,903.00	7,257,500
青山商事	3,600	1,250.00	4,500,000
しまむら	1,900	13,595.00	25,830,500
はせがわ	800	363.00	290,400
高島屋	12,500	1,937.00	24,212,500
松屋	2,900	1,074.00	3,114,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,100	1,493.00	12,093,300
近鉄百貨店	700	2,380.00	1,666,000
丸井グループ	12,200	2,430.50	29,652,100
アクシアル リテイリング	1,100	3,605.00	3,965,500
イオン	55,900	2,870.00	160,433,000
イズミ	2,500	3,459.00	8,647,500

平和堂	2,800	2,359.00	6,605,200
フジ	2,500	1,776.00	4,440,000
ヤオコー	1,900	7,441.00	14,137,900
ゼビオホールディングス	2,200	1,090.00	2,398,000
ケースホールディングス	11,600	1,257.00	14,581,200
Olympicグループ	500	523.00	261,500
日産東京販売ホールディングス	1,800	372.00	669,600
シルバーライフ	400	1,361.00	544,400
Genky DrugStores	700	4,250.00	2,975,000
ナルミヤ・インターナショナル	200	1,028.00	205,600
ブックオフグループホールディングス	900	1,155.00	1,039,500
ギフトホールディングス	400	4,640.00	1,856,000
アインホールディングス	2,300	5,125.00	11,787,500
元気寿司	500	3,655.00	1,827,500
ヤマダホールディングス	67,800	425.20	28,828,560
アークランズ	2,400	1,584.00	3,801,600
ニトリホールディングス	6,700	17,165.00	115,005,500
愛眼	1,000	184.00	184,000
ケーユーホールディングス	1,000	1,181.00	1,181,000
吉野家ホールディングス	6,500	2,680.50	17,423,250
松屋フーズホールディングス	800	4,115.00	3,292,000
サガミホールディングス	2,700	1,279.00	3,453,300
関西フードマーケット	1,500	1,422.00	2,133,000
王将フードサービス	1,100	6,590.00	7,249,000
ミニストップ	1,200	1,450.00	1,740,000
アークス	3,000	2,439.00	7,317,000
パローホールディングス	3,100	2,017.00	6,252,700
ベルク	800	6,610.00	5,288,000
大庄	800	1,126.00	900,800
ファーストリテイリング	7,400	34,260.00	253,524,000
サンドラッグ	6,300	4,144.00	26,107,200
サックスパーホールディングス	1,700	911.00	1,548,700
ヤマザワ	300	1,248.00	374,400
やまや	300	2,660.00	798,000
ベルーナ	4,000	692.00	2,768,000
いよぎんホールディングス	18,300	842.50	15,417,750

しずおかフィナンシャルグループ	34,100	1,079.50	36,810,950	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	12,900	882.10	11,379,090	
楽天銀行	5,400	2,004.00	10,821,600	
島根銀行	400	500.00	200,000	
じもとホールディングス	1,100	396.00	435,600	
めぶきフィナンシャルグループ	76,300	342.80	26,155,640	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	3,360.00	6,720,000	
九州フィナンシャルグループ	27,100	653.50	17,709,850	
ゆうちょ銀行	42,200	1,131.50	47,749,300	
富山第一銀行	4,900	770.00	3,773,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	82,400	590.80	48,681,920	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,500	1,440.00	13,680,000	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,631.00	2,283,400	
第四北越フィナンシャルグループ	2,400	3,205.00	7,692,000	
ひろぎんホールディングス	19,900	856.20	17,038,380	
おきなわフィナンシャルグループ	1,400	2,150.00	3,010,000	
十六フィナンシャルグループ	2,000	3,165.00	6,330,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,600	4,425.00	7,080,000	
プロクレアホールディングス	1,900	2,104.00	3,997,600	
あいちフィナンシャルグループ	2,200	2,292.00	5,042,400	
SBI新生銀行	3,600	2,819.00	10,148,400	
あおぞら銀行	9,600	2,765.00	26,544,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	961,200	1,083.00	1,040,979,600	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	194,100	718.70	139,499,670	
三井住友トラスト・ホールディングス	27,800	5,249.00	145,922,200	
三井住友フィナンシャルグループ	112,200	6,406.00	718,753,200	代用有価証券 13,000株
千葉銀行	42,800	921.70	39,448,760	
群馬銀行	29,800	541.00	16,121,800	
武蔵野銀行	2,000	2,365.00	4,730,000	
千葉興業銀行	2,900	642.00	1,861,800	
筑波銀行	7,100	206.00	1,462,600	
七十七銀行	4,900	2,685.00	13,156,500	
秋田銀行	1,000	1,714.00	1,714,000	
山形銀行	1,700	1,075.00	1,827,500	
岩手銀行	1,100	2,113.00	2,324,300	

東邦銀行	12,300	231.00	2,841,300
東北銀行	600	1,028.00	616,800
ふくおかフィナンシャルグループ	12,200	3,095.00	37,759,000
スルガ銀行	13,500	575.00	7,762,500
八十二銀行	32,500	669.80	21,768,500
山梨中央銀行	1,600	1,294.00	2,070,400
大垣共立銀行	2,900	1,862.00	5,399,800
福井銀行	1,400	1,476.00	2,066,400
清水銀行	600	1,471.00	882,600
富山銀行	200	1,686.00	337,200
滋賀銀行	2,600	2,835.00	7,371,000
南都銀行	2,300	2,451.00	5,637,300
百五銀行	14,400	443.00	6,379,200
京都銀行	4,900	7,627.00	37,372,300
紀陽銀行	5,500	1,466.00	8,063,000
ほくほくフィナンシャルグループ	9,800	1,186.50	11,627,700
山陰合同銀行	9,600	857.00	8,227,200
鳥取銀行	400	1,168.00	467,200
百十四銀行	1,400	1,973.00	2,762,200
四国銀行	2,400	886.00	2,126,400
阿波銀行	2,200	2,042.00	4,492,400
大分銀行	900	2,246.00	2,021,400
宮崎銀行	1,000	2,435.00	2,435,000
佐賀銀行	900	1,704.00	1,533,600
琉球銀行	3,500	953.00	3,335,500
セブン銀行	55,100	286.70	15,797,170
みずほフィナンシャルグループ	222,000	2,274.50	504,939,000
高知銀行	400	755.00	302,000
山口フィナンシャルグループ	16,900	1,025.50	17,330,950
名古屋銀行	1,000	3,575.00	3,575,000
北洋銀行	23,400	290.00	6,786,000
大光銀行	400	1,074.00	429,600
愛媛銀行	2,100	840.00	1,764,000
トマト銀行	400	1,053.00	421,200
京葉銀行	7,100	564.00	4,004,400
栃木銀行	7,100	263.00	1,867,300

北日本銀行	600	2,046.00	1,227,600
東和銀行	2,800	556.00	1,556,800
福島銀行	1,300	214.00	278,200
大東銀行	500	642.00	321,000
トモニホールディングス	12,500	381.00	4,762,500
フィデアホールディングス	1,600	1,430.00	2,288,000
池田泉州ホールディングス	19,600	244.00	4,782,400
F P G	5,200	1,292.00	6,718,400
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,300	1,170.00	1,521,000
マーキュリアホールディングス	700	748.00	523,600
S B Iホールディングス	22,200	2,852.50	63,325,500
ジャフコ グループ	5,100	1,766.50	9,009,150
大和証券グループ本社	109,700	729.20	79,993,240
野村ホールディングス	282,800	547.10	154,719,880
岡三証券グループ	13,700	493.00	6,754,100
丸三証券	5,100	445.00	2,269,500
東洋証券	5,200	322.00	1,674,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	16,600	391.00	6,490,600
光世証券	300	565.00	169,500
水戸証券	4,200	352.00	1,478,400
いちよし証券	2,800	614.00	1,719,200
松井証券	9,000	795.00	7,155,000
マネックスグループ	16,500	536.00	8,844,000
極東証券	1,900	669.00	1,271,100
岩井コスモホールディングス	1,800	1,547.00	2,784,600
アイザワ証券グループ	2,200	802.00	1,764,400
マネーパートナーズグループ	1,300	258.00	335,400
スパークス・グループ	1,700	1,510.00	2,567,000
かんぽ生命保険	17,900	2,203.00	39,433,700
S O M P Oホールディングス	26,300	6,359.00	167,241,700
アニコム ホールディングス	5,200	624.00	3,244,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	31,200	5,070.00	158,184,000
第一生命ホールディングス	75,000	2,745.00	205,875,000
東京海上ホールディングス	151,700	3,139.00	476,186,300
T & Dホールディングス	41,200	2,122.00	87,426,400

アドバンスクリエイト	900	1,196.00	1,076,400	
全国保証	4,000	4,876.00	19,504,000	
あんしん保証	700	311.00	217,700	
ジェイリース	400	2,268.00	907,200	
イントラスト	500	918.00	459,000	
日本モーゲージサービス	700	556.00	389,200	
C a s a	500	935.00	467,500	
アルヒ	1,900	981.00	1,863,900	
プレミアグループ	2,600	1,738.00	4,518,800	
ネットプロテクションズホールディングス	5,100	326.00	1,662,600	
クレディセゾン	9,700	2,234.00	21,669,800	
芙蓉総合リース	1,400	10,980.00	15,372,000	
みずほリース	2,300	4,585.00	10,545,500	
東京センチュリー	2,900	5,112.00	14,824,800	
日本証券金融	5,600	1,088.00	6,092,800	
アイフル	25,500	331.00	8,440,500	
リコーリース	1,400	4,175.00	5,845,000	
イオンフィナンシャルサービス	8,800	1,228.00	10,806,400	
アコム	27,600	360.50	9,949,800	
ジャックス	1,600	5,050.00	8,080,000	
オリエントコーポレーション	4,100	1,139.00	4,669,900	
オリックス	100,700	2,564.00	258,194,800	
三菱HCキャピタル	59,700	871.90	52,052,430	
九州リースサービス	700	859.00	601,300	
日本取引所グループ	43,100	2,352.00	101,371,200	
イー・ギャランティ	2,500	1,994.00	4,985,000	
アサックス	600	644.00	386,400	
NECキャピタルソリューション	800	3,095.00	2,476,000	
大東建託	5,600	13,980.00	78,288,000	
いちご	17,900	265.00	4,743,500	
日本駐車場開発	16,600	211.00	3,502,600	
スター・マイカ・ホールディングス	1,400	619.00	866,600	
SREホールディングス	800	3,640.00	2,912,000	
ADワークスグループ	3,000	191.00	573,000	
ヒューリック	35,900	1,193.50	42,846,650	
三栄建築設計	800	1,437.00	1,149,600	

野村不動産ホールディングス	9,600	3,353.00	32,188,800
三重交通グループホールディングス	3,500	541.00	1,893,500
サムティ	2,500	2,225.00	5,562,500
ディア・ライフ	2,700	820.00	2,214,000
コーセーアールイー	500	789.00	394,500
地主	1,300	1,849.00	2,403,700
プレサンスコーポレーション	2,500	1,977.00	4,942,500
THEグローバル社	700	271.00	189,700
ハウスコム	300	923.00	276,900
JPMC	900	1,084.00	975,600
サンセイランディック	500	957.00	478,500
エストラスト	200	639.00	127,800
フージャースホールディングス	2,400	994.00	2,385,600
オープンハウスグループ	5,600	5,086.00	28,481,600
東急不動産ホールディングス	46,200	782.30	36,142,260
飯田グループホールディングス	13,500	2,461.50	33,230,250
イーランド	200	1,508.00	301,600
ムゲンエステート	800	705.00	564,000
ビーロッド	1,000	695.00	695,000
ファーストブラザーズ	300	1,030.00	309,000
And Doホールディングス	900	1,074.00	966,600
シーアールイー	900	1,377.00	1,239,300
プロパティエージェント	200	1,160.00	232,000
ケイアイスター不動産	700	4,860.00	3,402,000
アグレ都市デザイン	200	1,585.00	317,000
グッドコムアセット	1,400	807.00	1,129,800
ジェイ・エス・ビー	400	4,850.00	1,940,000
ロードスターキャピタル	900	1,652.00	1,486,800
テンポイノベーション	400	1,145.00	458,000
グローバル・リンク・マネジメント	300	1,430.00	429,000
フェイスネットワーク	400	1,419.00	567,600
パーク24	12,000	1,739.00	20,868,000
パラカ	600	1,897.00	1,138,200
三井不動産	65,600	2,756.50	180,826,400
三菱地所	92,700	1,679.00	155,643,300
平和不動産	2,500	3,805.00	9,512,500

東京建物	14,600	1,812.50	26,462,500
京阪神ビルディング	2,600	1,177.00	3,060,200
住友不動産	27,800	3,528.00	98,078,400
テ-オーシー	2,900	615.00	1,783,500
東京楽天地	300	4,145.00	1,243,500
スターツコーポレーション	2,200	2,799.00	6,157,800
フジ住宅	2,400	676.00	1,622,400
空港施設	2,000	557.00	1,114,000
明和地所	600	1,067.00	640,200
ゴールドクレスト	1,500	1,844.00	2,766,000
エスリード	800	2,761.00	2,208,800
日神グループホールディングス	2,500	495.00	1,237,500
日本エスコン	3,600	813.00	2,926,800
M I R A R T Hホールディングス	8,100	446.00	3,612,600
A V A N T I A	700	861.00	602,700
イオンモール	8,100	1,731.50	14,025,150
毎日コムネット	600	718.00	430,800
ファースト住建	600	1,089.00	653,400
カチタス	4,100	2,628.00	10,774,800
トーセイ	2,600	1,713.00	4,453,800
穴吹興産	300	2,131.00	639,300
サンフロンティア不動産	2,700	1,402.00	3,785,400
F Jネクストホールディングス	1,700	1,025.00	1,742,500
インテリックス	300	501.00	150,300
ランドビジネス	500	262.00	131,000
サンネクスタグループ	400	946.00	378,400
グランディハウス	1,000	582.00	582,000
日本空港ビルディング	5,500	6,467.00	35,568,500
明豊ファシリティワークス	700	750.00	525,000
L I F U L L	5,600	306.00	1,713,600
M I X I	3,600	2,705.00	9,738,000
ジェイエシーリクルートメント	1,500	2,670.00	4,005,000
日本M&Aセンターホールディングス	27,500	1,066.00	29,315,000
メンバーズ	500	1,654.00	827,000
中広	200	400.00	80,000
U Tグループ	2,400	2,829.00	6,789,600

アイティメディア	600	1,328.00	796,800
E・Jホールディングス	900	1,549.00	1,394,100
オープンアップグループ	4,800	2,033.00	9,758,400
コシダカホールディングス	4,800	1,100.00	5,280,000
アルトナー	300	1,865.00	559,500
パソナグループ	1,900	1,658.00	3,150,200
C D S	300	1,750.00	525,000
リンクアンドモチベーション	4,700	418.00	1,964,600
エス・エム・エス	6,100	2,776.00	16,933,600
サニーサイドアップグループ	400	725.00	290,000
パーソルホールディングス	17,600	2,683.00	47,220,800
リニカル	700	776.00	543,200
クックパッド	4,500	165.00	742,500
エスクリ	700	402.00	281,400
アイ・ケイ・ケイホールディングス	700	600.00	420,000
学情	700	2,014.00	1,409,800
スタジオアリス	800	2,080.00	1,664,000
シミックホールディングス	800	1,897.00	1,517,600
エプコ	300	732.00	219,600
N J S	400	2,699.00	1,079,600
総合警備保障	29,500	786.60	23,204,700
カカクコム	11,800	2,029.50	23,948,100
アイロムグループ	600	1,925.00	1,155,000
セントケア・ホールディング	1,000	763.00	763,000
サイネックス	200	633.00	126,600
ルネサンス	1,300	905.00	1,176,500
ディップ	2,800	3,450.00	9,660,000
デジタルホールディングス	1,300	1,043.00	1,355,900
新日本科学	1,700	2,059.00	3,500,300
キャリアデザインセンター	300	1,678.00	503,400
ベネフィット・ワン	7,400	1,399.50	10,356,300
エムスリー	31,700	3,177.00	100,710,900
ツカダ・グローバルホールディング	900	468.00	421,200
プラス	200	917.00	183,400
アウトソーシング	9,500	1,382.50	13,133,750
ウェルネット	1,000	580.00	580,000

ワールドホールディングス	700	2,625.00	1,837,500	
ディー・エヌ・エー	6,400	1,773.50	11,350,400	
博報堂D Yホールディングス	20,500	1,550.50	31,785,250	
ぐるなび	3,000	381.00	1,143,000	
タカミヤ	2,200	510.00	1,122,000	
ジャパンベストレスキューシステム	800	757.00	605,600	
ファンコミュニケーションズ	3,300	402.00	1,326,600	
ライク	600	1,813.00	1,087,800	
ビジネス・ブレークスルー	500	431.00	215,500	
エスプール	4,600	612.00	2,815,200	
W D Bホールディングス	800	2,050.00	1,640,000	
ティア	900	449.00	404,100	
C D G	200	1,388.00	277,600	
アドウェイズ	2,200	666.00	1,465,200	
バリューコマース	1,200	1,330.00	1,596,000	
インフォマート	16,700	344.00	5,744,800	
J Pホールディングス	4,800	323.00	1,550,400	
エコナックホールディングス	3,200	92.00	294,400	
C Lホールディングス	500	832.00	416,000	
プレステージ・インターナショナル	6,700	604.00	4,046,800	
アミューズ	900	1,779.00	1,601,100	
ドリームインキュベータ	500	2,773.00	1,386,500	
クイック	1,200	2,369.00	2,842,800	
T A C	600	201.00	120,600	
電通グループ	15,700	4,739.00	74,402,300	
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	1,146.00	573,000	
ぴあ	600	3,285.00	1,971,000	
イオンファンタジー	700	2,648.00	1,853,600	
シーティーエス	1,800	735.00	1,323,000	
ネクシィーズグループ	400	643.00	257,200	
H . U . グループホールディングス	4,700	2,746.00	12,906,200	
アルプス技研	1,400	2,822.00	3,950,800	
日本空調サービス	1,700	767.00	1,303,900	
オリエンタルランド	84,800	5,431.00	460,548,800	
ダスキン	3,600	3,195.00	11,502,000	
明光ネットワークジャパン	2,000	636.00	1,272,000	

ファルコホールディングス	700	1,835.00	1,284,500	
秀英予備校	300	410.00	123,000	
ラウンドワン	13,400	541.00	7,249,400	
リゾートトラスト	6,300	2,169.50	13,667,850	
ビー・エム・エル	2,000	2,913.00	5,826,000	
リソー教育	7,300	257.00	1,876,100	
早稲田アカデミー	900	1,350.00	1,215,000	
ユー・エス・エス	16,400	2,419.00	39,671,600	
東京個別指導学院	1,900	464.00	881,600	
サイバーエージェント	35,400	1,051.50	37,223,100	
楽天グループ	96,200	526.80	50,678,160	
クリーク・アンド・リバー社	900	2,060.00	1,854,000	
SBIグローバルアセットマネジメント	2,600	515.00	1,339,000	
テー・オー・ダブリュー	3,200	310.00	992,000	
山田コンサルティンググループ	800	1,587.00	1,269,600	
セントラルスポーツ	600	2,330.00	1,398,000	
フルキャストホールディングス	1,500	2,347.00	3,520,500	
エン・ジャパン	2,900	2,543.00	7,374,700	
リソルホールディングス	100	4,670.00	467,000	
テクノプロ・ホールディングス	9,500	3,340.00	31,730,000	
アトラグループ	400	172.00	68,800	
インターワークス	400	337.00	134,800	
アイ・アールジャパンホールディングス	800	1,620.00	1,296,000	
Keeper 技研	1,000	5,730.00	5,730,000	
ファーストロジック	200	1,030.00	206,000	
三機サービス	300	1,019.00	305,700	
Gunosy	1,300	667.00	867,100	
デザインワン・ジャパン	400	173.00	69,200	
イー・ガーディアン	600	2,104.00	1,262,400	
リブセンス	700	273.00	191,100	
ジャパンマテリアル	4,900	2,491.00	12,205,900	
ベクトル	2,500	1,305.00	3,262,500	
ウチヤマホールディングス	500	339.00	169,500	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,300	1,289.00	1,675,700	
キャリアリンク	600	2,942.00	1,765,200	
I B J	1,000	664.00	664,000	

アサンテ	800	1,730.00	1,384,000
バリューHR	1,400	1,254.00	1,755,600
M&Aキャピタルパートナーズ	1,300	3,155.00	4,101,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,040.00	624,000
E R Iホールディングス	300	1,818.00	545,400
アピスト	200	3,235.00	647,000
シグマクシス・ホールディングス	2,400	1,396.00	3,350,400
ウィルグループ	1,300	1,096.00	1,424,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,300	141.00	183,300
メドピア	1,400	992.00	1,388,800
レアジョブ	300	981.00	294,300
リクルートホールディングス	118,600	4,763.00	564,891,800
エラン	2,100	876.00	1,839,600
土木管理総合試験所	500	328.00	164,000
日本郵政	192,800	1,021.00	196,848,800
ベルシステム24ホールディングス	2,100	1,423.00	2,988,300
鎌倉新書	1,800	676.00	1,216,800
S MN	300	442.00	132,600
一蔵	200	592.00	118,400
グローバルキッズCOMPANY	200	666.00	133,200
エアトリ	1,200	2,577.00	3,092,400
アトラエ	1,000	836.00	836,000
ストライク	700	3,400.00	2,380,000
ソラスト	4,400	653.00	2,873,200
セラク	500	1,454.00	727,000
インソース	3,500	1,171.00	4,098,500
ベイカレント・コンサルティング	12,700	4,744.00	60,248,800
Orchestra Holdings	400	1,192.00	476,800
アイモバイル	700	1,292.00	904,400
キャリアインデックス	400	301.00	120,400
MS - Japan	400	1,162.00	464,800
船場	300	754.00	226,200
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,700	1,837.00	10,470,900
フルテック	200	1,103.00	220,600
グリーンズ	500	1,401.00	700,500

ツナググループ・ホールディングス	400	612.00	244,800
GameWith	500	328.00	164,000
MS&Consulting	200	599.00	119,800
ウェルビー	1,200	413.00	495,600
エル・ティー・エス	200	3,370.00	674,000
ミダックホールディングス	1,000	1,671.00	1,671,000
日総工産	1,200	907.00	1,088,400
キュービーネットホールディングス	800	1,442.00	1,153,600
RPAホールディングス	2,300	419.00	963,700
スプリックス	400	778.00	311,200
マネジメントソリューションズ	900	4,040.00	3,636,000
プロレド・パートナーズ	400	497.00	198,800
and factory	400	383.00	153,200
テノ・ホールディングス	200	652.00	130,400
フロンティア・マネジメント	600	1,392.00	835,200
ピアラ	200	473.00	94,600
コプロ・ホールディングス	200	2,072.00	414,400
ギークス	200	711.00	142,200
アンビスホールディングス	1,700	2,889.00	4,911,300
カーブスホールディングス	4,500	742.00	3,339,000
フォーラムエンジニアリング	900	1,210.00	1,089,000
Fast Fitness Japan	600	1,423.00	853,800
ダイレクトマーケティングミックス	1,900	836.00	1,588,400
ポピンス	300	1,468.00	440,400
LITALICO	1,300	2,224.00	2,891,200
アドバンテッジリスクマネジメント	600	561.00	336,600
リログループ	9,000	1,902.50	17,122,500
東祥	1,100	1,283.00	1,411,300
ID&Eホールディングス	1,000	3,310.00	3,310,000
ビーウィズ	400	2,462.00	984,800
TREホールディングス	3,400	1,224.00	4,161,600
人・夢・技術グループ	600	1,687.00	1,012,200
大栄環境	4,100	2,472.00	10,135,200
日本管財ホールディングス	1,700	2,587.00	4,397,900
エイチ・アイ・エス	4,200	1,995.00	8,379,000
ラックランド	700	3,145.00	2,201,500

共立メンテナンス	2,700	5,290.00	14,283,000	
イチネンホールディングス	1,700	1,328.00	2,257,600	
建設技術研究所	800	3,390.00	2,712,000	
スペース	1,200	1,040.00	1,248,000	
燦ホールディングス	700	2,174.00	1,521,800	
スバル興業	100	10,070.00	1,007,000	
東京テアトル	500	1,113.00	556,500	
タナベコンサルティンググループ	500	1,037.00	518,500	
ナガワ	400	6,820.00	2,728,000	
東京都競馬	1,300	3,765.00	4,894,500	
常磐興産	500	1,223.00	611,500	
カナモト	2,900	2,333.00	6,765,700	
ニシオホールディングス	1,500	3,410.00	5,115,000	
アゴーラ ホスピタリティー グループ	9,100	24.00	218,400	
トランス・コスモス	2,000	3,420.00	6,840,000	
乃村工藝社	7,000	903.00	6,321,000	
藤田観光	700	3,625.00	2,537,500	
KNT-CTホールディングス	1,000	1,426.00	1,426,000	
トーカイ	1,400	1,897.00	2,655,800	
セコム	16,300	9,299.00	151,573,700	
セントラル警備保障	900	2,979.00	2,681,100	
丹青社	3,100	789.00	2,445,900	
メイテック	6,200	2,436.50	15,106,300	
応用地質	1,500	2,410.00	3,615,000	
船井総研ホールディングス	3,300	2,534.00	8,362,200	
進学会ホールディングス	400	291.00	116,400	
オオバ	800	826.00	660,800	
いであ	300	1,691.00	507,300	
学究社	600	2,032.00	1,219,200	
ベネッセホールディングス	6,000	1,814.00	10,884,000	
イオンディライト	1,800	2,871.00	5,167,800	
ナック	700	964.00	674,800	
ダイセキ	3,300	4,200.00	13,860,000	
ステップ	600	1,777.00	1,066,200	
合 計	23,143,600		50,167,968,280	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

ソブリン（円ヘッジ）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,533,700	-
コール・ローン	1,666,890,876	2,452,212,669
国債証券	24,334,558,216	18,968,772,781
地方債証券	3,680,879,448	5,253,550,126
特殊債券	21,358,782,673	15,041,787,413
派生商品評価勘定	354,504,643	194,303,380
未収利息	183,248,516	179,003,136
前払費用	12,923,498	10,556,313
差入委託証拠金	34,381	34,538
流動資産合計	51,593,355,951	42,100,220,356
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	491,627,487	622,470,136
未払金	1,390,200	112,241,675
未払利息	786	3,533
流動負債合計	493,018,473	734,715,344
純資産の部		
元本等		
元本	43,247,405,559	37,692,894,864
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,852,931,919	3,672,610,148
元本等合計	51,100,337,478	41,365,505,012
純資産合計	51,100,337,478	41,365,505,012
負債純資産合計	51,593,355,951	42,100,220,356

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、地方債証券及び特殊債券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</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 7月19日現在	2023年 7月18日現在
1.	期首	2021年 7月20日	2022年 7月20日
	期首元本額	53,203,722,162円	43,247,405,559円
	期首からの追加設定元本額	1,984,006,182円	1,761,602,189円
	期首からの一部解約元本額	11,940,322,785円	7,316,112,884円
	元本の内訳		
	円サポート	840,477,734円	700,974,474円
	高格付債券ファンド（為替ヘッジ70）毎月分配型	1,381,781,891円	1,311,658,677円
	高格付債券ファンド（為替ヘッジ70）資産成長型	72,369,252円	72,000,235円
	スマート・ラップ・ジャパン（毎月分配型）	156,117,790円	153,982,690円
	スマート・ラップ・ジャパン（1年決算型）	168,813,385円	174,688,483円
	スマート・ラップ・グローバル・インカム（毎月分配型）	16,447,986円	- 円
	スマート・ラップ・グローバル・インカム（1年決算型）	28,394,334円	- 円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08	93,673,331円	114,953,686円

時間分散型バランスファンド(安定指向)2016-11	30,571,588円	34,897,823円
時間分散型バランスファンド(安定指向)2017-02	28,958,347円	35,768,124円
高格付先進国ソブリン債券(円ヘッジ)ファンド(適格機関投資家向け)	17,316,332,604円	13,275,720,639円
高格付先進国ソブリン債券(円ヘッジ)ファンド(年2回決算型・適格機関投資家向け)	1,141,836,244円	1,138,322,176円
高格付先進国ソブリンオープン・為替ヘッジあり(適格機関投資家向け)	7,603,672,037円	7,385,346,921円
P F 先進国ソブリンオープン・為替ヘッジ70(適格機関投資家向け)	56,924,084円	-円
高格付先進国ソブリンファンド 2013-05M(適格機関投資家向け)	2,180,586,405円	2,166,614,797円
高格付先進国ソブリンファンド・為替ヘッジあり 2013-07Q(適格機関投資家転売制限付)	74,299,083円	-円
高格付先進国ソブリンファンド・為替ヘッジあり 2016-09Q(適格機関投資家転売制限付)	698,258,030円	688,824,573円
高格付先進国ソブリンファンド・為替ヘッジあり 2016-10Q(適格機関投資家転売制限付)	350,398,940円	345,837,962円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2013-11M(適格機関投資家転売制限付)	1,978,419,823円	2,015,381,591円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2014-05M(適格機関投資家転売制限付)	1,240,817,502円	987,024,159円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2014-07(適格機関投資家転売制限付)	1,270,352,025円	1,270,352,025円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2014-09Q(適格機関投資家転売制限付)	552,558,818円	554,230,278円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2014-10(適格機関投資家転売制限付)	561,337,757円	310,698,603円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2014-11Q(適格機関投資家転売制限付)	497,241,907円	251,005,731円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2015-02Q(適格機関投資家転売制限付)	628,905,977円	582,040,849円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2015-03Q(適格機関投資家転売制限付)	631,421,883円	586,087,009円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2015-04Q(適格機関投資家転売制限付)	686,679,003円	573,368,856円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2015-09Q(適格機関投資家転売制限付)	1,007,351,736円	1,010,708,440円
P F 先進国ソブリンファンド・為替ヘッジ70 2016-04Q(適格機関投資家転売制限付)	1,952,406,063円	1,952,406,063円
計	43,247,405,559円	37,692,894,864円
2. 受益権の総数	43,247,405,559口	37,692,894,864口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19日	自 2022年 7月20日 至 2023年 7月18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 7月19日現在	2023年 7月18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 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	2,485,444,635
地方債証券	365,513,118
特殊債証券	2,376,272,177
合計	5,227,229,930

(2023年 7月18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	219,478,733
地方債証券	70,786,272
特殊債証券	282,939,433
合計	573,204,438

(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 7月19日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	49,078,660,181	-	49,215,783,025	137,122,844
	加ドル	7,307,053,940	-	7,353,313,310	46,259,370
	ユーロ	21,705,055,438	-	21,380,977,250	324,078,188
	英ポンド	2,870,742,693	-	2,930,119,827	59,377,134
	スウェーデンクローナ	4,369,227,620	-	4,410,449,364	41,221,744
	豪ドル	12,826,580,490	-	13,140,923,274	314,342,784
合計		49,078,660,181	-	49,215,783,025	137,122,844

（2023年 7月18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	113,215,529	-	113,247,599	32,070
	豪ドル	113,215,529	-	113,247,599	32,070
	売建	38,419,337,246	-	38,847,536,072	428,198,826
	加ドル	3,564,116,610	-	3,545,963,130	18,153,480
	ユーロ	17,830,970,628	-	17,912,136,840	81,166,212
	スウェーデンクローナ	3,396,098,908	-	3,579,810,682	183,711,774
	豪ドル	13,628,151,100	-	13,809,625,420	181,474,320
	合計	38,532,552,775	-	38,960,783,671	428,166,756

（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 7月19日現在	2023年 7月18日現在
1口当たり純資産額	1.1816円
	1口当たり純資産額
	1.0974円

(1万口当たり純資産額)	(11,816円)	(1万口当たり純資産額)	(10,974円)
--------------	-----------	--------------	-----------

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
加ドル	特殊債券	CANADA HOUSING TRUST-1.1%-31/03/15	22,400,000.00	18,304,518.40	
		CANADA HOUSING TRUST-1.6%-31/12/15	10,000,000.00	8,387,640.00	
		CANADA HOUSING TRUST-3.55%-32/09/15	8,000,000.00	7,814,272.00	
加ドル小計			40,400,000.00	34,506,430.40 (3,631,801,799)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	6,200,000.00	5,335,385.20	
		BELGIUM KINGDOM-0.35%-32/06/22	22,800,000.00	18,011,680.80	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	39,600,000.00	33,733,101.60	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-33/06/22	18,600,000.00	18,386,709.70	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	37,900,000.00	37,269,192.40	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	4,580,000.00	3,228,634.36	
ユーロ小計			129,680,000.00	115,964,704.06 (18,110,207,833)	
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.75%-33/11/11	34,000,000.00	31,796,564.38	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	12,000,000.00	13,380,000.00	
	国債証券小計		46,000,000.00	45,176,564.38 (612,594,212)	
	特殊債券	EUROPEAN INVESTMENT BANK-3.75%- 32/06/01	129,000,000.00	130,839,269.10	
		NORDIC INVESTMENT BANK-2.94%-31/10/17	92,500,000.00	88,393,413.47	
特殊債券小計		221,500,000.00	219,232,682.57 (2,972,795,175)		
スウェーデンクローナ小計			267,500,000.00	264,409,246.95 (3,585,389,387)	

豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	2,700,000.00	2,598,465.42	
	国債証券小計		2,700,000.00	2,598,465.42	(245,970,736)
	地方債証券	NEW S WALES TREASURY CRP-1.5%-32/02/20	4,740,000.00	3,699,737.36	
		NEW S WALES TREASURY CRP-2.0%-33/03/08	11,000,000.00	8,700,373.00	
		NEW S WALES TREASURY CRP-2.25%-41/05/07	6,000,000.00	3,961,501.68	
		QUEENSLAND TREASURY CORP-1.5%-32/08/20	2,500,000.00	1,935,037.05	
		QUEENSLAND TREASURY CORP-2.0%-33/08/22	7,700,000.00	6,057,379.55	
		QUEENSLAND TREASURY CORP-2.25%-41/11/20	2,000,000.00	1,317,429.46	
		TREASURY CORP VICTORIA-1.5%-30/11/20	3,000,000.00	2,446,902.54	
		TREASURY CORP VICTORIA-1.5%-31/09/10	13,300,000.00	10,531,014.34	
		TREASURY CORP VICTORIA-4.25%-32/12/20	9,000,000.00	8,691,348.33	
		WESTERN AUST TREAS CORP-1.75%-31/10/22	10,000,000.00	8,158,432.90	
	地方債証券小計		69,240,000.00	55,499,156.21	(5,253,550,126)
	特殊債券	EUROFIMA-3.35%-29/05/21	58,560,000.00	53,956,847.28	
		KOMMUNALBANKEN AS-2.4%-29/11/21	27,990,000.00	24,270,899.56	
LANDWIRTSCH. RENTENBANK-1.9%-30/01/30		10,000,000.00	8,356,126.10		
NEDER WATERSCHAPSBANK-3.3%-29/05/02		2,750,000.00	2,547,655.05		
特殊債券小計		99,300,000.00	89,131,527.99	(8,437,190,439)	
豪ドル小計		171,240,000.00	147,229,149.62	(13,936,711,301)	
合計			39,264,110,320	(39,264,110,320)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
加ドル	特殊債券 3銘柄	100.0%	9.2%
ユーロ	国債証券 6銘柄	100.0%	46.1%
スウェーデンクローナ	国債証券 2銘柄	17.1%	1.6%
	特殊債券 2銘柄	82.9%	7.6%
豪ドル	国債証券 1銘柄	1.8%	0.6%
	地方債証券 10銘柄	37.7%	13.4%
	特殊債券 4銘柄	60.5%	21.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

インデックス マザーファンド リート

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	307,258,832	450,517,729
投資証券	37,620,202,500	44,424,120,050
派生商品評価勘定	812,200	911,250
未収入金	1,063,435,200	-
未収配当金	255,996,661	351,209,261
前払金	12,781,040	-
差入委託証拠金	35,226,000	51,401,500
流動資産合計	39,295,712,433	45,278,159,790
資産合計	39,295,712,433	45,278,159,790
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,017,720	902,210
前受金	-	4,950,960
未払解約金	796,235,130	2,547,825
未払利息	144	649
流動負債合計	803,252,994	8,401,644
負債合計	803,252,994	8,401,644
純資産の部		
元本等		

元本	27,045,389,835	32,465,212,559
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	11,447,069,604	12,804,545,587
元本等合計	38,492,459,439	45,269,758,146
純資産合計	38,492,459,439	45,269,758,146
負債純資産合計	39,295,712,433	45,278,159,790

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られ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られ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 7月19日現在	2023年 7月18日現在
1. 期首	2021年 7月20日	2022年 7月20日
期首元本額	18,147,264,346円	27,045,389,835円
期首からの追加設定元本額	18,292,718,419円	14,236,362,568円
期首からの一部解約元本額	9,394,592,930円	8,816,539,844円
元本の内訳		
上場インデックスファンドJリート（東証REIT指数）隔月分配型（ミニ）	16,437,771,862円	22,536,468,111円
時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08	18,434,546円	20,627,046円
時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11	5,963,890円	6,423,002円
時間分散型バランスファンド（安定指向）2017-02	5,646,689円	6,520,653円
インデックス・Jリート・オープン（適格機関投資家向け）	4,350,508,487円	4,090,431,294円

インデックスファンドJリート 2015-03(適格機関投資家向け)	158,369,490円	153,436,958円
インデックスファンドJリート 2020-01(適格機関投資家向け)	1,392,219,186円	1,372,838,448円
インデックスファンドJリート・分配抑制コース 2020-02(適格機関投資家向け)	1,435,674,407円	1,415,218,791円
インデックスファンドJリート・分配抑制コース 2020-03(適格機関投資家向け)	164,477,034円	81,219,653円
インデックスファンドJリート 2021-05(適格機関投資家向け)	1,475,816,380円	1,423,250,083円
インデックスファンドJリート 2021-10(適格機関投資家向け)	1,408,532,812円	1,358,778,520円
Nikkoam バランス・プラス・米国株式モメンタム戦略ファンド1-B私募 2103(適格機関投資家向け)	191,975,052円	-円
計	27,045,389,835円	32,465,212,559円
2. 受益権の総数	27,045,389,835口	32,465,212,559口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19日	自 2022年 7月20日 至 2023年 7月18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 7月19日現在	2023年 7月18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 7月19日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1,829,318,045
合計	1,829,318,045

（2023年 7月18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	200,190,000
合計	200,190,000

(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 7月19日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	611,159,540	-	605,022,000	6,137,540
合計		611,159,540	-	605,022,000	6,137,540

（2023年 7月18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	849,051,540	-	849,162,000	110,460
合計		849,051,540	-	849,162,000	110,460

（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 7月19日現在		2023年 7月18日現在	
1口当たり純資産額	1.4233円	1口当たり純資産額	1.3944円
(1万口当たり純資産額)	(14,233円)	(1万口当たり純資産額)	(13,944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	858	102,445,200	
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,353	125,558,400	
	S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	2,100	273,000,000	
	東海道リート投資法人 投資証券	702	86,697,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,458	956,448,000	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,966	730,995,200	
	産業ファンド投資法人 投資証券	6,444	981,421,200	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	4,222	1,456,590,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	3,097	685,366,100	
	アクティブピア・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,216	910,776,000	
	G L P 投資法人 投資証券	14,238	1,997,591,400	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,019	708,669,000	
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	7,343	2,147,093,200	
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	739	471,482,000	
	O n e リート投資法人 投資証券	737	187,345,400	
	イオンリート投資法人 投資証券	4,848	737,865,600	
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,951	639,666,900	
	日本リート投資法人 投資証券	1,372	465,794,000	
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	12,690	1,073,574,000	
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	937	126,026,500	
	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,836	511,142,400	
	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	1,041	166,872,300	
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,098	132,089,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	13,656	2,193,153,600	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	700	71,610,000		
ラサールロジポート投資法人 投資証券	5,398	830,752,200		

スターアジア不動産投資法人 投資証券	5,272	306,830,400	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	645	82,624,500	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,668	832,332,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	681	42,766,800	
投資法人みらい 投資証券	5,131	236,282,550	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,451	587,655,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,809	327,971,700	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	685	78,501,000	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	1,991	191,733,300	
アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	1,841	245,773,500	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	4,927	2,931,565,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	4,331	2,403,705,000	
日本都市ファンド投資法人 投資証券	21,307	2,043,341,300	
オリックス不動産投資法人 投資証券	8,415	1,476,832,500	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,888	1,018,020,000	
N T T 都市開発リート投資法人 投資証券	4,060	542,010,000	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,832	537,513,600	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	3,107	358,237,100	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	9,447	1,374,538,500	
森トラストリート投資法人 投資証券	7,860	560,418,000	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	18,587	1,022,285,000	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,567	741,191,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	2,975	424,830,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,848	865,792,000	
福岡リート投資法人 投資証券	2,184	358,831,200	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	2,457	820,638,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	3,460	305,518,000	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	875	548,625,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,907	275,752,200	
スターツプロシード投資法人 投資証券	732	162,357,600	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	6,366	1,781,206,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	13,619	984,653,700	
大和証券リビング投資法人 投資証券	5,852	672,394,800	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,874	511,368,000	
合計	257,670	44,424,120,050	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

インデックス マザーファンド 海外先進国債券

貸借対照表

(単位：円)

	2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
資産の部		
流動資産		
預金	359,648	493,716
コール・ローン	159,284	128,667
国債証券	82,488,152	56,999,967
未収利息	668,128	470,519
前払費用	10,819	3,946
流動資産合計	83,686,031	58,096,815
資産合計	83,686,031	58,096,815
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	680
流動負債合計	-	680
負債合計	-	680
純資産の部		
元本等		
元本	66,466,103	46,344,583
剰余金		
剰余金又は欠損金()	17,219,928	11,751,552
元本等合計	83,686,031	58,096,135
純資産合計	83,686,031	58,096,135
負債純資産合計	83,686,031	58,096,815

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

(貸借対照表に関する注記)

		2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
1.	期首	2021年 7月20日	2022年 7月20日
	期首元本額	85,918,557円	66,466,103円
	期首からの追加設定元本額	1,419,932円	3,082,381円
	期首からの一部解約元本額	20,872,386円	23,203,901円
	元本の内訳		
	時間分散型バランスファンド(安定指向) 2016-08	37,764,326円	25,401,177円
	インデックスファンド海外先進国債券(適格機関投資家向け)	4,920,515円	4,910,715円
時間分散型バランスファンド(安定指向) 2016-11	12,213,540円	7,965,984円	
時間分散型バランスファンド(安定指向) 2017-02	11,567,722円	8,066,707円	
計	66,466,103円	46,344,583円	
2.	受益権の総数	66,466,103口	46,344,583口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19日	自 2022年 7月20日 至 2023年 7月18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 7月19日現在	2023年 7月18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 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	12,090,360
合計	12,090,360

（2023年 7月18日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	3,606,108
合計	3,606,108

(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 7月19日現在		2023年 7月18日現在	
1口当たり純資産額	1.2591円	1口当たり純資産額	1.2536円
(1万口当たり純資産額)	(12,591円)	(1万口当たり純資産額)	(12,536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-2.375%-24/08/15	36,000.00	34,910.57	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	31,000.00	28,124.62	

		US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	42,000.00	39,350.39	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	31,000.00	27,232.77	
		US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	15,000.00	12,921.67	
		US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	14,000.00	11,590.74	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	14,000.00	14,868.70	
		US TREASURY N/B-1.875%-41/02/15	4,000.00	2,892.42	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	5,000.00	4,103.51	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	9,000.00	6,858.28	
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	7,000.00	5,716.89	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	19,000.00	10,870.82	
米ドル小計			227,000.00	199,441.38	(27,698,418)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	1,000.00	959.12	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	3,000.00	2,800.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	1,000.00	866.13	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	4,000.00	4,777.15	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	1,000.00	1,023.90	
加ドル小計			10,000.00	10,427.10	(1,097,452)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	10,000.00	9,934.37	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	50,000.00	49,515.62	
メキシコペソ小計			60,000.00	59,449.99	(493,684)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	3,000.00	3,334.79	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	2,000.00	1,703.69	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	2,000.00	2,101.47	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	3,000.00	2,905.79	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	7,000.00	7,632.32	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 31/10/31	3,000.00	2,388.63	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%- 40/07/30	5,000.00	5,675.11	
		BUNDESobligation-0.0%-26/04/10	2,000.00	1,848.17	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 25/02/15	3,000.00	2,876.02	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	3,000.00	3,423.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 29/02/15	2,000.00	1,767.91	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	4,000.00	4,819.07	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 35/05/15	2,000.00	1,490.58	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	4,000.00	4,646.71	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,000.00	1,293.32	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	2,000.00	1,549.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	6,000.00	5,777.14	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 27/09/15	4,000.00	3,584.68	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	9,000.00	9,748.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 30/12/01	2,000.00	1,714.96	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	4,000.00	3,681.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	4,000.00	4,170.95	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	2,000.00	1,647.97	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	5,000.00	4,750.97	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-27/02/25	1,000.00	898.38	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	6,000.00	6,807.69	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-31/11/25	5,000.00	3,931.81	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	6,000.00	6,945.74	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	6,000.00	6,966.15	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	2,000.00	1,669.21	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	3,000.00	2,832.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	1,000.00	977.76	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	2,000.00	2,259.15	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-25/04/20	1,000.00	944.99	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-29/05/23	1,000.00	997.01
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	3,000.00	3,312.36
ユーロ小計			121,000.00	123,076.32 (19,220,828)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-0.5%-29/01/31	1,000.00	800.50
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	3,000.00	3,062.27
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,000.00	991.55
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	4,000.00	3,822.72
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	2,000.00	1,691.05
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	1,000.00	947.09
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	2,000.00	1,913.70
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	2,000.00	1,870.99
英ポンド小計			16,000.00	15,099.87 (2,743,646)
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	10,000.00	9,357.14
スウェーデンクローナ小計			10,000.00	9,357.14 (126,882)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	4,000.00	3,702.56
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	4,000.00	3,674.86
ノルウェークローネ小計			8,000.00	7,377.42 (101,808)
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	5,000.00	4,844.08
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	4,000.00	4,889.03
デンマーククローネ小計			9,000.00	9,733.11 (204,005)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	9,000.00	8,346.69
ポーランドズロチ小計			9,000.00	8,346.69 (293,524)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	4,000.00	3,822.38
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	5,000.00	5,209.61
豪ドル小計			9,000.00	9,031.99 (854,968)
シンガ	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	1,000.00	994.29

ポールドル		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	1,000.00	997.43
シンガポールドドル小計			2,000.00	1,991.72 (209,309)
マレーシアリングgit	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	9,000.00	8,969.16
マレーシアリングgit小計			9,000.00	8,969.16 (274,303)
イスラエルシェケル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	10,000.00	9,316.13
イスラエルシェケル小計			10,000.00	9,316.13 (356,572)
香港・オフショア 人民元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-2.26%-25/02/24	10,000.00	10,026.71
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-25/11/25	10,000.00	10,015.77
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	50,000.00	51,379.25
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	40,000.00	40,158.10
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.76%-32/05/15	50,000.00	50,256.67
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/05/25	10,000.00	10,030.01
香港・オフショア人民元小計			170,000.00	171,866.51 (3,324,568)
合計				56,999,967 (56,999,967)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 12銘柄	100.0%	48.6%
加ドル	国債証券 5銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 36銘柄	100.0%	33.7%
英ポンド	国債証券 8銘柄	100.0%	4.8%
スウェーデンクローナ	国債証券 1銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.2%

デンマーククローネ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券	1銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券	2銘柄	100.0%	1.5%
シンガポールドル	国債証券	2銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	1銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシケル	国債証券	1銘柄	100.0%	0.6%
香港・オフショア人民元	国債証券	6銘柄	100.0%	5.8%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

先進国資本エマージング株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
資産の部		
流動資産		
預金	20,730,471	11,518,886
コール・ローン	52,904,810	34,408,804
株式	9,848,956,333	8,982,969,609
未収入金	-	12,603,085
未収配当金	39,875,545	31,386,018
流動資産合計	9,962,467,159	9,072,886,402
資産合計	9,962,467,159	9,072,886,402
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	44,654	-
未払解約金	26,006,577	7,250,702
未払利息	24	49
流動負債合計	26,051,255	7,250,751
負債合計	26,051,255	7,250,751
純資産の部		
元本等		
元本	7,152,048,317	5,948,211,554
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2,784,367,587	3,117,424,097

元本等合計	9,936,415,904	9,065,635,651
純資産合計	9,936,415,904	9,065,635,651
負債純資産合計	9,962,467,159	9,072,886,402

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
1.	期首	2021年 7月20日	2022年 7月20日
	期首元本額	8,973,539,554円	7,152,048,317円
	期首からの追加設定元本額	272,568,995円	763,884円
	期首からの一部解約元本額	2,094,060,232円	1,204,600,647円
	元本の内訳		
	スマート・ラップ・グローバル・インカム（毎月分配型）	6,578,273円	- 円
	スマート・ラップ・グローバル・インカム（1年決算型）	11,899,798円	- 円
	先進国資本エマージング株式ファンド（1年決算型）	5,655,574,578円	4,777,214,983円
	先進国資本エマージング株式ファンド（年2回決算型）	13,220,589円	12,170,431円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08	3,020,215円	2,764,758円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11	979,968円	891,955円

時間分散型バランスファンド（安定指向）2017-02	928,275円	903,922円
グローバル・メガピース	1,459,846,621円	1,154,265,505円
計	7,152,048,317円	5,948,211,554円
2. 受益権の総数	7,152,048,317口	5,948,211,554口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19日	自 2022年 7月20日 至 2023年 7月18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 7月19日現在	2023年 7月18日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 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。	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 7月19日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	22,670,775
合計	22,670,775

（2023年 7月18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	27,467,263
合計	27,467,263

（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 7月19日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	3,873,157	-	3,917,811	44,654
	インドネシアルピア	3,873,157	-	3,917,811	44,654
	合計	3,873,157	-	3,917,811	44,654

（注）1.時価の算定方法

(1)本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2)本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

(3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認め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 7月18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 7月19日現在		2023年 7月18日現在	
1口当たり純資産額	1.3893円	1口当たり純資産額	1.5241円
(1万口当たり純資産額)	(13,893円)	(1万口当たり純資産額)	(15,241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	AMBEV SA-ADR	634,022	3.04	1,927,426.88	
	BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	76,139	19.74	1,502,983.86	

	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	200,872	1.18	238,635.93	
	TELEFONICA BRASIL-ADR	258,237	8.45	2,182,102.65	
	TIM SA-ADR	137,406	14.56	2,000,631.36	
	ENEL CHILE SA-ADR	462,047	3.52	1,626,405.44	
米ドル小計		1,768,723		9,478,186.12	(1,316,330,488)
メキシコペソ	WALMART DE MEXICO -SER V	292,600	67.89	19,864,614.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	368,000	39.66	14,594,880.00	
メキシコペソ小計		660,600		34,459,494.00	(286,158,530)
ブラジルリアル	BANCO BRADESCO S.A.	208,000	14.69	3,055,520.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	163,650	44.73	7,320,064.50	
ブラジルリアル小計		371,650		10,375,584.50	(299,511,997)
チリペソ	ENEL AMERICAS SA	10,212,363	108.82	1,111,309,341.66	
チリペソ小計		10,212,363		1,111,309,341.66	(188,614,755)
ユーロ	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	337,995	1.59	540,285.00	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	53,768	14.44	776,409.92	
ユーロ小計		391,763		1,316,694.92	(205,628,245)
トルコリラ	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	17,484	820.20	14,340,376.80	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	41,000	254.50	10,434,500.00	
トルコリラ小計		58,484		24,774,876.80	(130,511,573)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	46,942	700.00	32,859,400.00	
チェココルナ小計		46,942		32,859,400.00	(215,830,397)
ポーランドズロチ	SANTANDER BANK POLSKA SA	13,457	401.20	5,398,948.40	
ポーランドズロチ小計		13,457		5,398,948.40	(189,862,658)
香港ドル	BYD CO LTD-H	20,500	262.60	5,383,300.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	21,700	92.95	2,017,015.00	
	JD.COM INC - CL A	11,350	150.50	1,708,175.00	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	66,000	27.95	1,844,700.00	

	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	339,000	18.64	6,318,960.00	
	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	171,000	14.72	2,517,120.00	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	472,000	6.20	2,926,400.00	
香港ドル小計		1,101,550		22,715,670.00	(403,657,455)
マレーシアリングット	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	14,800	132.10	1,955,080.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	743,400	5.80	4,311,720.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	361,900	3.67	1,328,173.00	
マレーシアリングット小計		1,120,100		7,594,973.00	(232,277,059)
タイバーツ	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	135,200	222.00	30,014,400.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	184,000	77.00	14,168,000.00	
タイバーツ小計		319,200		44,182,400.00	(178,055,072)
フィリピンペソ	PLDT INC	36,050	1,305.00	47,045,250.00	
フィリピンペソ小計		36,050		47,045,250.00	(120,101,818)
インドネシアルピア	VALE INDONESIA TBK PT	2,035,800	6,400.00	13,029,120,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,739,600	6,675.00	24,961,830,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	3,111,700	2,770.00	8,619,409,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	4,358,900	4,270.00	18,612,503,000.00	
インドネシアルピア小計		13,246,000		65,222,862,000.00	(606,572,616)
韓国ウォン	POSCO HOLDINGS INC	2,086	478,000.00	997,108,000.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	21,400	34,050.00	728,670,000.00	
韓国ウォン小計		23,486		1,725,778,000.00	(189,663,002)
台湾ドル	WIN SEMICONDUCTORS CORP	108,000	173.50	18,738,000.00	
台湾ドル小計		108,000		18,738,000.00	(83,828,190)
インドルピー	JSW STEEL LTD	34,714	798.15	27,706,979.10	
	ABB INDIA LTD	39,643	4,418.95	175,180,434.85	
	SIEMENS LTD	47,290	3,702.10	175,072,309.00	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	14,757	9,689.55	142,988,689.35	
	ITC LTD	106,888	472.35	50,488,546.80	
	NESTLE INDIA LIMITED	6,889	23,070.75	158,934,396.75	

	COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	52,325	1,839.15	96,233,523.75	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	55,147	2,681.70	147,887,709.90	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	22,971	1,897.05	43,577,135.55	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	177,750	582.55	103,548,262.50	
	MPHASIS LTD	70,785	2,123.75	150,329,643.75	
	BHARTI AIRTEL LTD	146,289	878.10	128,456,370.90	
インドルピー小計		775,448		1,400,404,002.20	(2,380,686,803)
南アフリカランド	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	26,899	906.60	24,386,633.40	
	KUMBA IRON ORE LTD	62,352	449.16	28,006,024.32	
	MULTICHOICE GROUP LTD	103,773	85.41	8,863,251.93	
	VODACOM GROUP LTD	228,570	116.10	26,536,977.00	
南アフリカランド小計		421,594		87,792,886.65	(676,883,156)
香港・オフショア 人民元	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	304,500	12.19	3,711,855.00	
	GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD-A	103,700	26.92	2,791,604.00	
	ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	207,924	51.47	10,701,848.28	
	CHONGQING BREWERY CO-A	75,000	88.24	6,618,000.00	
	HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	321,731	24.37	7,840,584.47	
	SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	122,290	62.64	7,660,245.60	
	YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	250,434	40.06	10,032,386.04	
	SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	430,000	7.56	3,250,800.00	
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	309,014	4.63	1,430,734.82	
	BANK OF NANJING CO LTD -A	245,221	8.10	1,986,290.10	
	BANK OF NINGBO CO LTD -A	100,199	24.80	2,484,935.20	
香港・オフショア人民元小計		2,470,013		58,509,283.51	(1,131,797,729)
サウジアラビア リアル	SAUDI AWWAL BANK	94,651	41.85	3,961,144.35	
サウジアラビアリアル小計		94,651		3,961,144.35	(146,998,066)
合 計		33,240,074		8,982,969,609	(8,982,969,609)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 6銘柄	100.0%	14.7%
メキシコペソ	株式 2銘柄	100.0%	3.2%
ブラジルリアル	株式 2銘柄	100.0%	3.3%
チリペソ	株式 1銘柄	100.0%	2.1%
ユーロ	株式 2銘柄	100.0%	2.3%
トルコリラ	株式 2銘柄	100.0%	1.5%
チェココルナ	株式 1銘柄	100.0%	2.4%
ポーランドズロチ	株式 1銘柄	100.0%	2.1%
香港ドル	株式 7銘柄	100.0%	4.5%
マレーシアリングット	株式 3銘柄	100.0%	2.6%
タイバーツ	株式 2銘柄	100.0%	2.0%
フィリピンペソ	株式 1銘柄	100.0%	1.3%
インドネシアルピア	株式 4銘柄	100.0%	6.8%
韓国ウォン	株式 2銘柄	100.0%	2.1%
台湾ドル	株式 1銘柄	100.0%	0.9%
インドルピー	株式 12銘柄	100.0%	26.5%
南アフリカランド	株式 4銘柄	100.0%	7.5%
香港・オフショア人民元	株式 11銘柄	100.0%	12.6%
サウジアラビアリアル	株式 1銘柄	100.0%	1.6%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

インデックス マザーファンド コモディティ

貸借対照表

(単位：円)

	2022年 7月19日現在	2023年 7月18日現在
資産の部		
流動資産		
預金	243,653	35,216
コール・ローン	84,892	66,041
投資信託受益証券	8,181,917	8,005,524
流動資産合計	8,510,462	8,106,781
資産合計	8,510,462	8,106,781
負債の部		
流動負債		
未払金	204,958	-
流動負債合計	204,958	-
負債合計	204,958	-
純資産の部		
元本等		
元本	5,440,444	6,092,971
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2,865,060	2,013,810
元本等合計	8,305,504	8,106,781
純資産合計	8,305,504	8,106,781
負債純資産合計	8,510,462	8,106,781

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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 7月19日現在	2023年 7月18日現在
1.	期首	2021年 7月20日	2022年 7月20日
	期首元本額	10,798,976円	5,440,444円
	期首からの追加設定元本額	6,213,140円	1,045,623円
	期首からの一部解約元本額	11,571,672円	393,096円
	元本の内訳		
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-08	3,336,116円	3,746,471円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11	1,081,514円	1,146,271円
	時間分散型バランスファンド（安定指向）2017-02	1,022,814円	1,200,229円
	計	5,440,444円	6,092,971円
2.	受益権の総数	5,440,444口	6,092,971口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2021年 7月20日 至 2022年 7月19日	自 2022年 7月20日 至 2023年 7月18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 7月19日現在	2023年 7月18日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2022年 7月19日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	1,978,247
合計	1,978,247

(2023年 7月18日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	1,479,929
合計	1,479,929

(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 7月19日現在		2023年 7月18日現在	
1口当たり純資産額	1.5266円	1口当たり純資産額	1.3305円
(1万口当たり純資産額)	(15,266円)	(1万口当たり純資産額)	(13,305円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
ユーロ	投資信託受益証券	ISH DIV COMDTY SWAP DE-ETF	2,120	51,261.60	
ユーロ小計			2,120	51,261.60 (8,005,524)	
合計				8,005,524 (8,005,524)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入投資信託 受益証券時価比率	合計金額に 対する比率
-----	-----	--------------------	----------------

ユーロ	投資信託受益証券	1銘柄	100.0%	100.0%
-----	----------	-----	--------	--------

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2023年 7月31日現在です。

【時間分散型バランスファンド（安定指向）2016 - 11】

【純資産額計算書】

資産総額	104,091,529円
負債総額	1,237,555円
純資産総額（ - ）	102,853,974円
発行済口数	82,658,714口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2443円

（参考）

インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）

純資産額計算書

資産総額	65,332,505円
負債総額	46,904円
純資産総額（ - ）	65,285,601円
発行済口数	23,136,230口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8218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	311,903,737,180円
負債総額	131,092,072円
純資産総額（ - ）	311,772,645,108円
発行済口数	60,866,639,728口
1口当たり純資産額（ / ）	5.1222円

インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）

純資産額計算書

資産総額	21,644,175円
負債総額	13,468円
純資産総額（ - ）	21,630,707円
発行済口数	13,529,256口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5988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	57,831,999,041円
負債総額	29,023,483円
純資産総額（ - ）	57,802,975,558円
発行済口数	19,549,154,612口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9568円

インデックスファンド海外新興国債券（適格機関投資家向け）

純資産額計算書

資産総額	5,966,931円
負債総額	4,094円
純資産総額（ - ）	5,962,837円
発行済口数	4,288,364口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3905円

海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	10,980,554,454円
負債総額	22,855,534円
純資産総額（ - ）	10,957,698,920円
発行済口数	6,755,842,764口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6220円

FOFs用ゴールド・ファンド 為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）

純資産額計算書

資産総額	4,216,166,125円
負債総額	32,324,096円
純資産総額(-)	4,183,842,029円
発行済口数	3,258,654,001口
1口当たり純資産額(/)	1.2839円

ゴールド・マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	190,300,621,291円
負債総額	142,603,943円
純資産総額(-)	190,158,017,348円
発行済口数	109,297,555,091口
1口当たり純資産額(/)	1.7398円

インデックス マザーファンド TOPIX

純資産額計算書

資産総額	52,539,756,340円
負債総額	494,452,597円
純資産総額(-)	52,045,303,743円
発行済口数	16,295,583,628口
1口当たり純資産額(/)	3.1938円

ソブリン(円ヘッジ)マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	37,461,153,564円
負債総額	1,515,321,147円
純資産総額(-)	35,945,832,417円
発行済口数	32,805,426,095口
1口当たり純資産額(/)	1.0957円

インデックス マザーファンド Jリート

純資産額計算書

資産総額	46,300,947,527円
負債総額	283,658,514円
純資産総額（ - ）	46,017,289,013円
発行済口数	32,605,105,195口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4114円

インデックス マザーファンド 海外先進国債券

純資産額計算書

資産総額	58,215,581円
負債総額	438,677円
純資産総額（ - ）	57,776,904円
発行済口数	45,941,039口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2576円

先進国資本エマージング株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	9,303,398,985円
負債総額	76,722,297円
純資産総額（ - ）	9,226,676,688円
発行済口数	5,848,700,231口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5776円

インデックス マザーファンド コモディティ

純資産額計算書

資産総額	8,407,634円
負債総額	177,923円
純資産総額（ - ）	8,229,711円
発行済口数	5,940,893口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3853円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券

から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求を行なわないものとします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2023年7月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2023年7月末現在）

・株主総会

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

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7月末現在）

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

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2023年7月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	849	270,489
株式投資信託	794	231,409
単位型	314	9,741
追加型	480	221,668
公社債投資信託	55	39,079
単位型	42	1,034
追加型	13	38,045

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 1031 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 その他有価証券 投資信託	6,238	18,045	-	24,283
資産計	6,238	18,045	-	24,283
デリバティブ取引(*1) 株式関連(*2)	246	-	-	246
通貨関連(*3)	-	352	-	352
デリバティブ取引計	246	352	-	599

- (1) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、で示しております。
- (2) 株式関連のデリバティブ取引のうち 246百万円は、貸借対照表上流動資産及び流動負債のその他に含まれております。
- (3) 通貨関連のデリバティブ取引の 352百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

資産

有価証券

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

デリバティブ取引

株式関連

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

通貨関連

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位：百万円)

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

3 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	42,036			
未収委託者報酬	21,336			
未収収益	589			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	1,025	204	4,520	10
合計	64,987	204	4,520	10

(有価証券関係)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

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

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	投資信託	17,219	13,860	3,359
	小計	17,219	13,860	3,359
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	7,063	7,459	395
	小計	7,063	7,459	395
合計		24,283	21,319	2,963

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	11,194	1,349	221
合計	11,194	1,349	221

(デリバティブ取引関係)

第63期(2022年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第64期(2023年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	10,970	-	246	246
合計		10,970	-	246	246

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建 シンガポール ドル	3,275	-	24	24
合計		3,275	-	24	24

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		6,132	-	280
	豪ドル		105	-	0
	香港ドル		699	-	34
	人民元		5,822	-	1
	ユーロ		234	-	10
合計			12,994	-	328

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

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

(退職給付関係)

第63期(自 2021年 4月 1日 至 2022年 3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

退職給付引当金	1,395
貸借対照表に計上された負債の額	1,395

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.3%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、244百万円でありました。

第64期(自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,352
勤務費用	133
利息費用	4
数理計算上の差異の発生額	16
退職給付の支払額	107
退職給付債務の期末残高	1,366

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

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

退職給付引当金	1,424
貸借対照表に計上された負債の額	1,424

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.6%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、247百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	432,300	1,016,000
付与	0	0
失効	432,300	928,000
権利確定	0	0
権利未確定残	-	88,000
権利確定後(株)		
期首	-	-

権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定前(株)		
期首	1,772,000	2,607,000
付与	0	0
失効	956,000	1,071,000
権利確定	0	0
権利未確定残	816,000	1,536,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利行使価格(円)	553	694
付与日における公正な評価単価(円)(注)1	0	0

- (注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値(評価額と行使価格との差額)の見積りによっております。
 2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
 当事業年度末における本源的価値の合計額 1,222百万円
 3 株式公開価格が737円(割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。)を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

	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tock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す。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

(収益認識関係)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

- 顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。
- 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報
顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「(重要な会計方針) 4 収益の計上基準」に記載のとおりです。
- 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当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)

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

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益(百万円)	12,136	17,826
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	12,136	17,826

普通株式の期中平均株式数(千株)	194,152	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2016年度ストックオプション(1) 88,000株、2016年度ストックオプション(2) 816,000株、2017年度ストックオプション(1) 1,536,000株	2016年度ストックオプション(2) 217,000株、2017年度ストックオプション(1) 752,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第63期 (2022年3月31日)	第64期 (2023年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	91,035	101,391
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-	-
普通株式に係る期末の純資産額(百万円)	91,035	101,391
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数(千株)	194,152	194,152

(重要な後発事象)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2023年3月末現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

< 再信託受託会社の概要 >

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

資本金の額 : 51,000百万円 (2023年3月末現在)

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

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

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2023年3月末現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
日興アセットマネジメント株式会社	17,363百万円	証券投資信託の設定を行なうとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また金融商品取引法に定める投資助言業務を行なっています。

(3) 投資顧問会社

名 称	資本金の額 (2023年3月末現在)	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

(3) 投資顧問会社

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

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。

(3) 投資顧問会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2022年10月19日	有価証券報告書
2023年 4月19日	半期報告書

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10月4日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11の2022年7月20日から2023年7月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、時間分散型バランスファンド（安定指向）2016-11の2023年7月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。