

**【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】	2024年2月6日提出
【計算期間】	第21期(自 2022年11月8日至 2023年11月6日)
【ファンド名】	D C インデックスバランス(株式40)
【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

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

## 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

## 2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年1回

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

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

## ファンドの特色

# 1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

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

# 2. インデックスファンドで構成しています。

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

## <国内株式>

### 「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

## <海外株式>

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

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

## <国内債券>

### 「日本債券インデックスマザーファンド」

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

## <海外債券>

### 「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

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

## 著作権などについて

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

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

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

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

### 3. 株式に40%、債券などに60%投資します。

資産の標準実質組入比率は、株式40%、債券など60%とします。  
組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンドへの投資比率を調整することで行ないます。

各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

投資対象	基本投資比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	30%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	10%
日本債券インデックスマザーファンド	45%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	10%
短期金融資産	5%

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

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

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

※当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。

購入申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて購入の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。



#### 主な投資制限

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

#### 分配方針

- ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

#### 信託金限度額

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

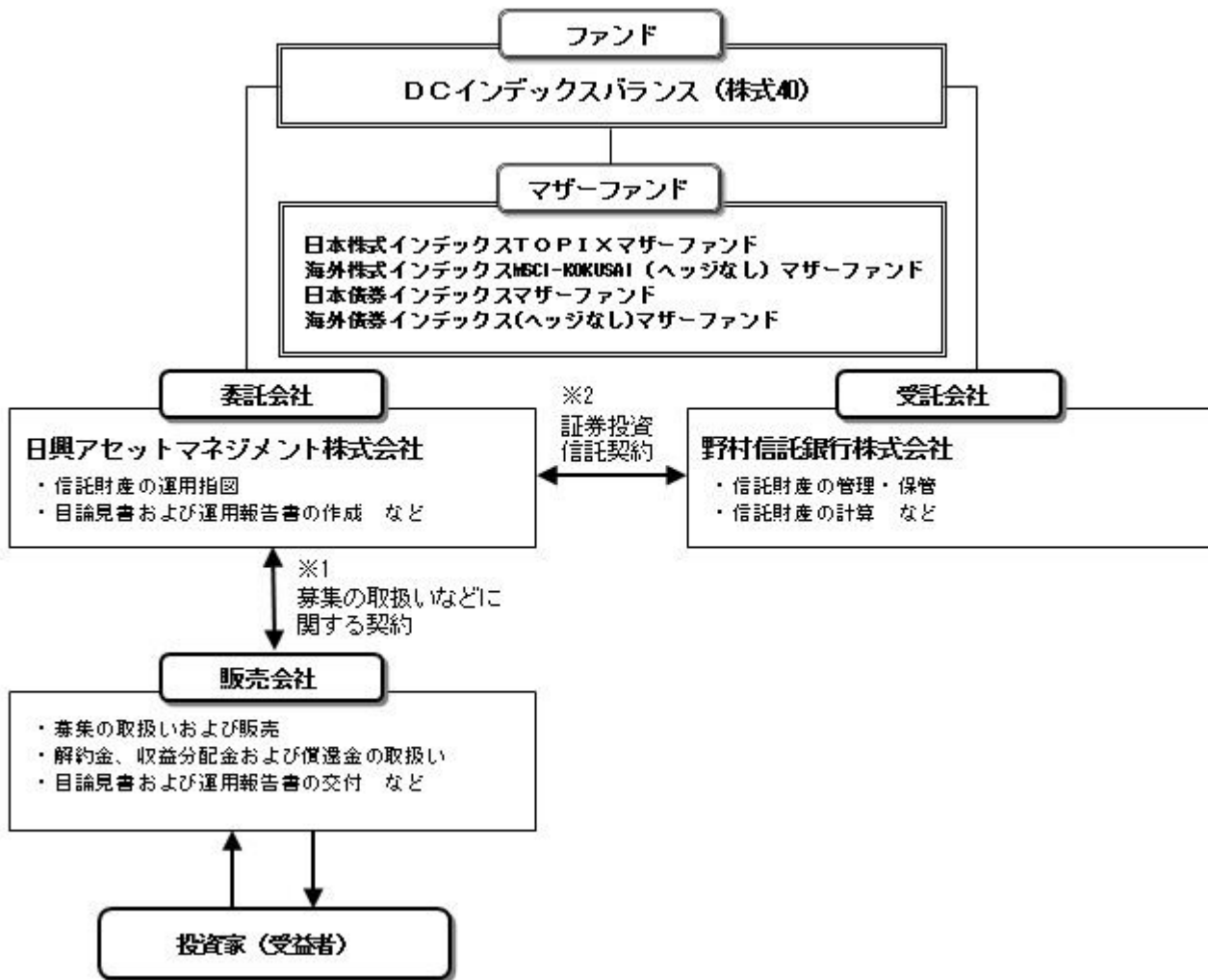
#### (2) 【ファンドの沿革】

2002年12月10日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

#### (3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものの。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の。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況（2023年11月末現在）

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

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

- ・主として、以下に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。  
証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」  
証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」  
証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」  
証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
- ・純資産総額に対する株式ならびに公社債および短期金融資産の実質組入比率については、次の標準実質組入比率を目処として投資を行ないます。  
株式の標準実質組入比率.....40%  
公社債および短期金融資産の標準実質組入比率.....60%
- ・組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないますが、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。
- ・また、資金動向などによっては組入比率を引き下げることもあります。

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

## (2)【投資対象】

### <DCインデックスバランス(株式40)>

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

- 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
- 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」
- 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
- 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 1) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券
- 2) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」受益証券
- 3) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券
- 4) 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」受益証券
- 5) 株券または新株引受権証券
- 6) 国債証券
- 7) 地方債証券
- 8) 特別の法律により法人の発行する債券
- 9) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- 10) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 11) コマーシャル・ペーパー
- 12) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
- 13) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、5)~12)の証券または証書の性質を有するもの
- 14) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。)
- 15) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))で16)に定めるもの以外のもの
- 16) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 17) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 18) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 19) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 20) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 21) 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。)
- 22) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 23) 外国の者に対する権利で22)の有価証券の性質を有するもの

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

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

次の取引ができます。

- 1) 信用取引
- 2) 先物取引等
- 3) スワップ取引
- 4) 金利先渡取引
- 5) 為替先渡取引
- 6) 有価証券の貸付
- 7) 公社債の空売
- 8) 公社債の借入
- 9) 外国為替予約取引
- 10) 資金の借入

### <日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券



- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形
- 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)～8)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 11) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 12) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 13) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 次の取引ができます。
- 1) 信用取引
- 2) 先物取引等
- 3) スワップ取引
- 4) 金利先渡取引
- 5) 有価証券の貸付
- 6) 公社債の空売
- 7) 公社債の借入
- < 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド >
- 日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
- 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形
- 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)～7)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 11) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12)に定めるもの以外のもの
- 12) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券



- 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。 )により運用することができます。
- 1) 預金
  - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
  - 3) コール・ローン
  - 4) 手形割引市場において売買される手形
  - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
  - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
- 1) 信用取引
  - 2) 先物取引等
  - 3) スワップ取引
  - 4) 金利先渡取引
  - 5) 為替先渡取引
  - 6) 有価証券の貸付
  - 7) 公社債の空売
  - 8) 公社債の借入
  - 9) 外国為替予約取引
- <日本債券インデックスマザーファンド>  
わが国の公社債を主要投資対象とします。  
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券(株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。)
  - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。)
  - 3) 金銭債権
  - 4) 約束手形
  - 5) 為替手形
- 主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。 )に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券(短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。 )を除きます。 )には投資しません。
- 1) 国債証券
  - 2) 地方債証券
  - 3) 特別の法律により法人の発行する債券
  - 4) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。 )に限ります。)
  - 5) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
  - 6) コマーシャル・ペーパー
  - 7) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)~6)の証券の性質を有するもの
  - 8) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。 )または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。 )で投資法人債券に類する証券
  - 9) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
  - 10) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの  
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。 )により運用することができます。
- 1) 預金
  - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
  - 3) コール・ローン
  - 4) 手形割引市場において売買される手形
  - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの  
次の取引ができます。
- 1) 先物取引等
  - 2) スワップ取引
  - 3) 金利先渡取引
  - 4) 有価証券の貸付
  - 5) 公社債の空売
  - 6) 公社債の借入
- <海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>  
内外の公社債を主要投資対象とします。  
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

## 投資対象とするマザーファンドの概要

&lt;日本株式インデックスTOPIXマザーファンド&gt;

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数）* 配当込みの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>・主としてわが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）配当込みの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>・投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。</li> <li>・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。</li> </ul>

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。

### ファンドに係る費用

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

### その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1999年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

#### 運用の基本方針

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

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

\* 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。

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

#### <日本債券インデックスマザーファンド>

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、NOMURA-BPI総合 <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>株式への投資は行ないません。</li> <li>外貨建資産への投資は行ないません。</li> <li>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</li> </ul>
収益分配	収益分配は行ないません。

#### ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

#### その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

\* NOMURA-BPI総合は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社（以下「NFRC」）が公表している、わが国の債券市場の動きを示す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債、MBS、ABSなど、国内で発行された円建公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存期間1年以上、残存額面10億円以上で、事業債、円建外債、MBS、ABSについては、A格相当以上の格付を取得しているものに限られます。同指数の知的財産権はNFRCに帰属します。なお、NFRCは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行なわれる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

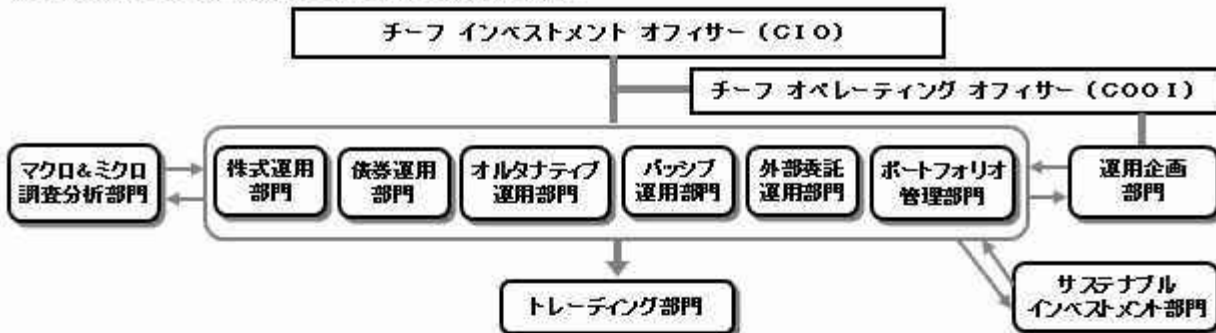
#### <海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

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

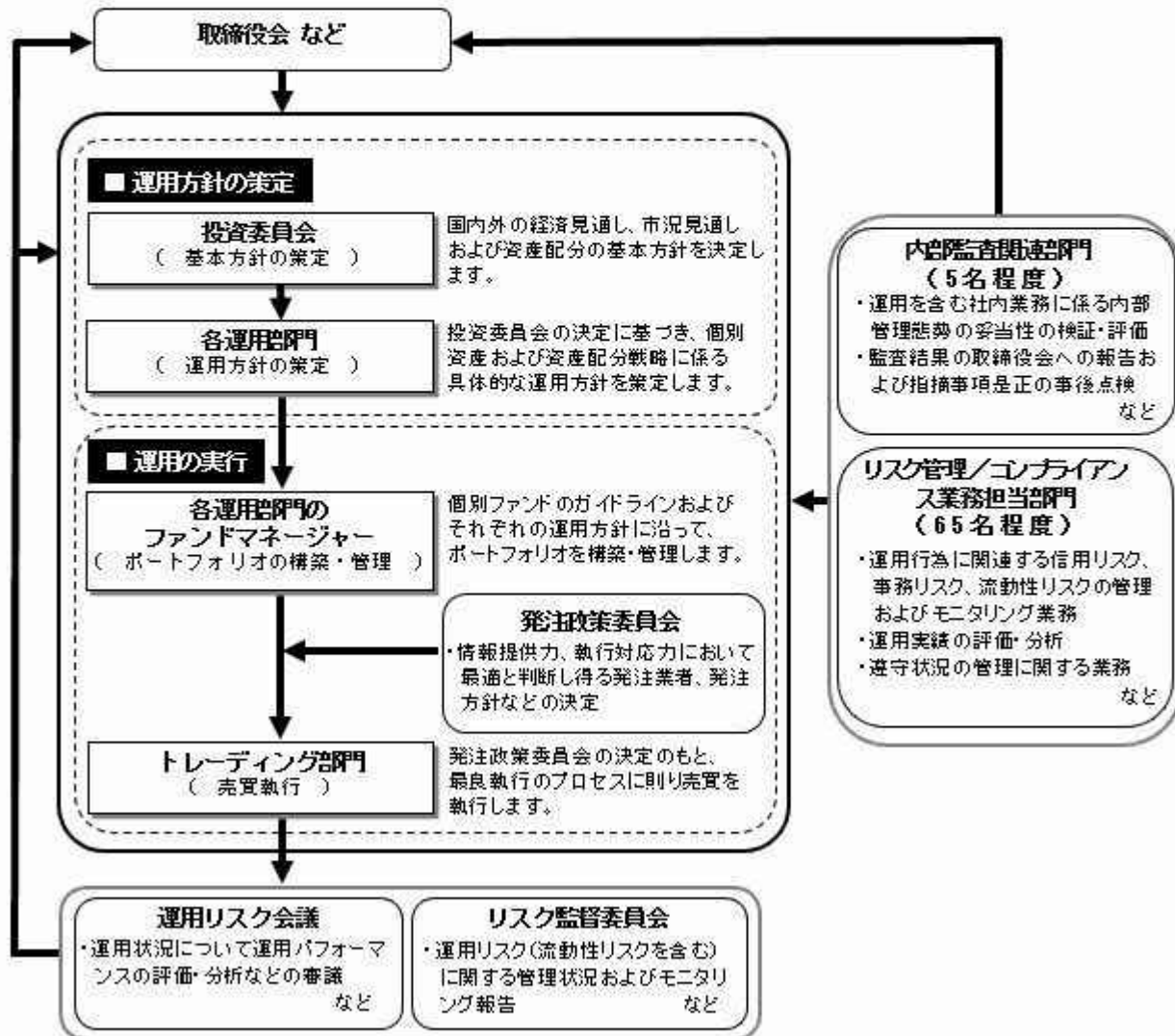
<sup>\*</sup> FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

### （3）【運用体制】

## ◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



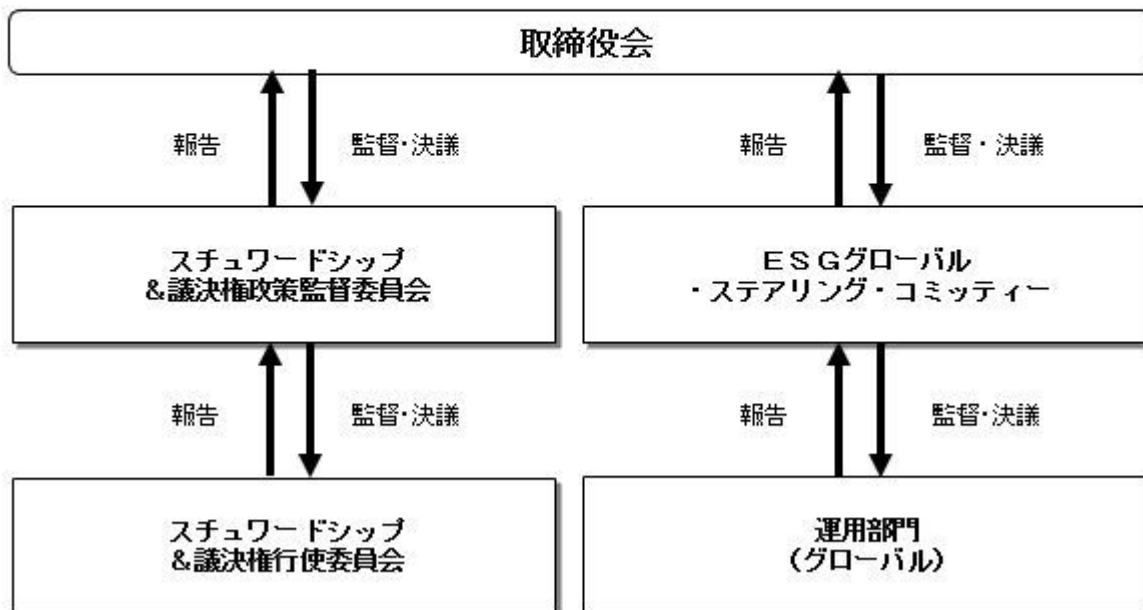
## 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

## ◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

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

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



上記体制は2023年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## (4) 【分配方針】

## 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

- 1) 分配対象額の範囲  
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
  - 2) 分配対象額についての分配方針  
分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
  - 3) 留保益の運用方針  
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行いません。
- 収益分配金の支払い  
原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

## (5) 【投資制限】

## 約款に定める投資制限

< DCインデックスバランス（株式40） >

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の70%未満とします。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。



- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入れ額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
- イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
- ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
- ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 16) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 17) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
- <日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>
- 1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 5) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)、および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 7) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

- 8) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
  - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

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

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

合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

<海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 3) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図

は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

- ・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。

- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

流動性リスク

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

信用リスク

- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト(債務不履行)や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落(価格がゼロになることもあります。)し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れが生じた場合や廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。

- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト(債務不履行)が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落(価格がゼロになることもあります。)し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。

- ・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。

- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

為替変動リスク

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

#### < その他の留意事項 >

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

- ・投資対象とする投資信託証券に関する事項

ファンドが投資対象とする投資信託証券(マザーファンドを含みます。)と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴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。

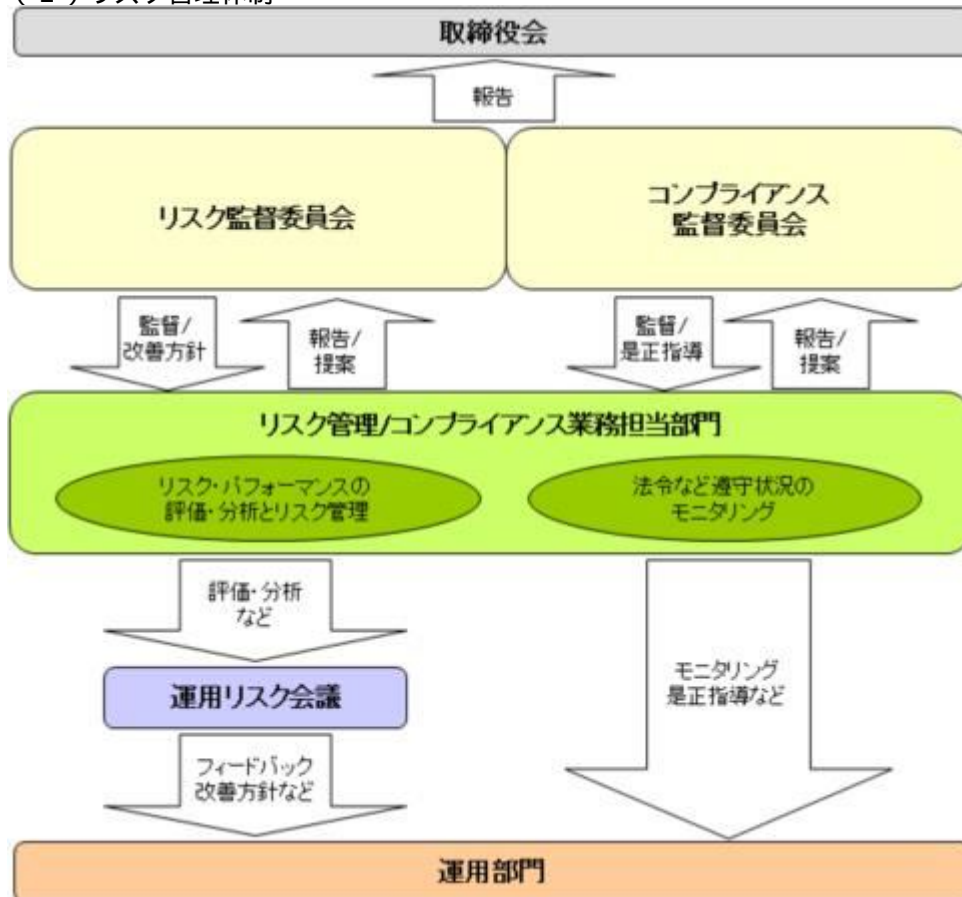
- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項



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として、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。

- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項  
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項  
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。
- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項  
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

## (2) リスク管理体制



### 全社リスク管理

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

### 運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

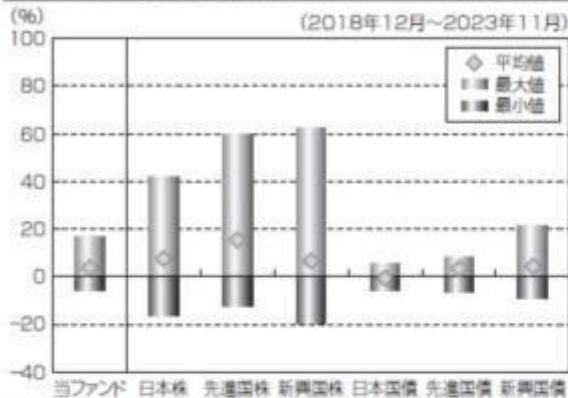
### 法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2023年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## (参考情報)

## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	3.8%	7.6%	15.4%	6.6%	-0.6%	3.3%	4.3%
最大値	18.6%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	8.0%	21.5%
最小値	-5.9%	-16.0%	-12.4%	-19.4%	-5.5%	-6.1%	-8.8%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2018年12月から2023年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

## &lt;各資産クラスの指数&gt;

日本株……TOPIX(東証株価指数)配当込み

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み,円ベース)

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

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本,円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

## 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

## TOPIX(東証株価指数)配当込み

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

## MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み,円ベース)

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

## MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み,円ベース)

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

## NOMURA-BPI国債

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

## FTSE世界国債インデックス(除く日本,円ベース)

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

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

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

ありません。

## (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

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.154%（税抜0.14%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.14%	0.04%	0.08%	0.02%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

## (4) 【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

< 投資対象とするマザーファンドに係る費用 >

- ・組入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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

## (5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

- ・公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に少額投資非課税制度（NISA）の適用対象となります。
- ・当ファンドは、NISAの対象ではありません。

確定拠出年金の場合

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

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

確定拠出年金でない場合

個人受益者の場合

## 1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%



および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

## 2) 解約金および償還金に対する課税

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

### 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

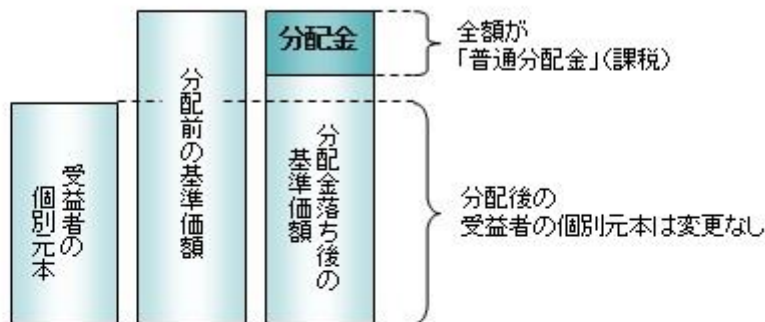
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

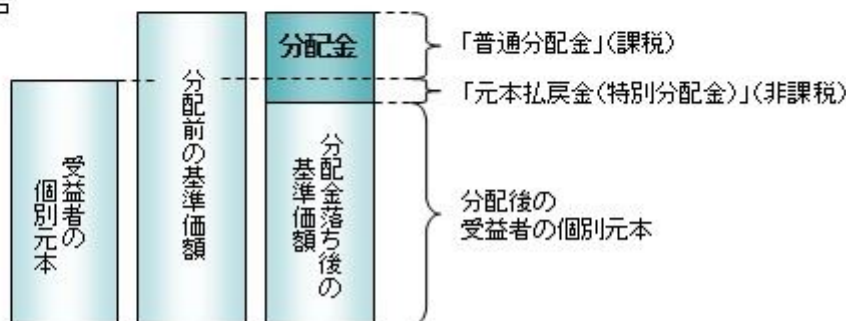
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

### <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2024年2月6日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## (参考情報)ファンドの総経費率

対象期間:2022年11月8日~2023年11月6日

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
0.16%	0.15%	0.01%

※対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。

※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

※運用管理費用の内訳等の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 5【運用状況】

## 【DCインデックスバランス(株式40)】

以下の運用状況は2023年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	15,873,941,763	95.06
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		824,156,888	4.94
合計(純資産総額)		16,698,098,651	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	5,565,154,874	1.3224	7,359,639,848	1.3423	7,470,107,387	44.74
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	2,076,499,601	2.4153	5,015,369,487	2.4306	5,047,139,930	30.23
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	318,771,445	5.1501	1,641,704,819	5.3024	1,690,253,709	10.12
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	592,744,091	2.7756	1,645,229,637	2.8114	1,666,440,737	9.98

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.06
合計	95.06

## 【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】

純資産総額(百万円)	1口当たり純資産額(円)

期別	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第12計算期間末 (2014年11月 6日)	2,656	2,657	1.6212	1.6222
第13計算期間末 (2015年11月 6日)	3,050	3,052	1.7361	1.7371
第14計算期間末 (2016年11月 7日)	3,190	3,192	1.6726	1.6736
第15計算期間末 (2017年11月 6日)	4,337	4,339	1.9017	1.9027
第16計算期間末 (2018年11月 6日)	5,809	5,812	1.8653	1.8663
第17計算期間末 (2019年11月 6日)	7,594	7,597	1.9472	1.9482
第18計算期間末 (2020年11月 6日)	9,328	9,333	1.9700	1.9710
第19計算期間末 (2021年11月 8日)	12,233	12,239	2.2083	2.2093
第20計算期間末 (2022年11月 7日)	13,698	13,705	2.1615	2.1625
第21計算期間末 (2023年11月 6日)	16,392	16,392	2.3412	2.3412
2022年11月末日	13,907		2.1777	
12月末日	13,592		2.1109	
2023年 1月末日	14,034		2.1464	
2月末日	14,199		2.1730	
3月末日	14,672		2.1997	
4月末日	14,951		2.2277	
5月末日	15,335		2.2670	
6月末日	15,991		2.3476	
7月末日	16,058		2.3400	
8月末日	16,203		2.3457	
9月末日	16,253		2.3327	
10月末日	16,020		2.2870	
11月末日	16,698		2.3713	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	0.0010
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	0.0010
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	0.0010
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	0.0010
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	0.0010
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	0.0010
第18期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	0.0010
第19期	2020年11月 7日～2021年11月 8日	0.0010
第20期	2021年11月 9日～2022年11月 7日	0.0010
第21期	2022年11月 8日～2023年11月 6日	0.0000

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	10.36
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	7.15
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	3.60

第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	13.76
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	1.86
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	4.44
第18期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	1.22
第19期	2020年11月 7日～2021年11月 8日	12.15
第20期	2021年11月 9日～2022年11月 7日	2.07
第21期	2022年11月 8日～2023年11月 6日	8.31

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

#### （４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第12期	2013年11月 7日～2014年11月 6日	402,200,788	175,054,267
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	312,108,595	193,535,396
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	311,896,821	161,785,450
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	655,234,781	281,609,222
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	1,071,592,550	237,755,651
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	1,153,119,415	367,851,990
第18期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	1,358,135,245	522,849,077
第19期	2020年11月 7日～2021年11月 8日	1,411,994,829	607,423,684
第20期	2021年11月 9日～2022年11月 7日	1,457,693,934	659,745,303
第21期	2022年11月 8日～2023年11月 6日	1,322,419,613	658,509,161

#### （参考）

#### 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2023年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	52,758,497,150	98.75
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		667,505,654	1.25
合計（純資産総額）		53,426,002,804	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	665,280,000	1.25

(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	858,700	2,594.40	2,227,811,280	2,794.50	2,399,637,150	4.49
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	110,600	12,244.88	1,354,283,728	12,820.00	1,417,892,000	2.65
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	964,600	1,226.51	1,183,091,546	1,255.00	1,210,573,000	2.27
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,600	52,391.52	817,307,712	63,350.00	988,260,000	1.85
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4,666,000	173.50	809,551,000	173.10	807,684,600	1.51
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	33,100	19,342.76	640,245,356	24,025.00	795,227,500	1.49
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	109,500	7,117.02	779,313,690	7,258.00	794,751,000	1.49
日本	株式	日立製作所	電気機器	75,900	8,708.58	660,981,222	10,285.00	780,631,500	1.46
日本	株式	三菱商事	卸売業	109,300	6,909.29	755,185,397	6,886.00	752,639,800	1.41
日本	株式	信越化学工業	化学	142,100	4,239.04	602,367,584	5,212.00	740,625,200	1.39
日本	株式	任天堂	その他製品	98,700	6,116.00	603,649,200	6,912.00	682,214,400	1.28
日本	株式	三井物産	卸売業	124,700	5,331.53	664,841,791	5,392.00	672,382,400	1.26
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	119,000	4,220.42	502,229,980	5,505.00	655,095,000	1.23
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	109,100	5,344.67	583,103,497	5,738.00	626,015,800	1.17
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	138,800	4,345.45	603,148,460	4,165.00	578,102,000	1.08
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	381,400	1,593.70	607,837,180	1,509.00	575,532,600	1.08
日本	株式	KDDI	情報・通信業	121,200	4,455.85	540,049,020	4,625.00	560,550,000	1.05
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	152,200	3,335.75	507,701,150	3,648.00	555,225,600	1.04
日本	株式	第一三共	医薬品	136,600	4,024.34	549,724,844	4,000.00	546,400,000	1.02
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	207,900	2,502.00	520,165,800	2,512.00	522,244,800	0.98
日本	株式	HOYA	精密機器	31,100	14,410.00	448,151,000	16,665.00	518,281,500	0.97
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	77,400	6,044.27	467,826,498	6,020.00	465,948,000	0.87
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	252,400	1,681.49	424,408,076	1,798.50	453,941,400	0.85
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	85,100	4,660.31	396,592,381	5,025.00	427,627,500	0.80
日本	株式	ダイキン工業	機械	18,900	21,185.60	400,407,978	22,155.00	418,729,500	0.78
日本	株式	村田製作所	電気機器	142,400	2,490.12	354,593,088	2,883.50	410,610,400	0.77
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	93,600	3,454.99	323,387,064	3,801.00	355,773,600	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	175,900	1,725.74	303,557,666	2,009.00	353,383,100	0.66
日本	株式	S M C	機械	4,700	68,400.00	321,480,000	74,450.00	349,915,000	0.65
日本	株式	丸紅	卸売業	138,000	2,183.85	301,371,300	2,307.00	318,366,000	0.60

#### 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	0.37
		建設業	2.05
		食料品	3.39
		繊維製品	0.41
		パルプ・紙	0.17
		化学	5.90
		医薬品	4.70
		石油・石炭製品	0.47

ゴム製品	0.71
ガラス・土石製品	0.67
鉄鋼	0.97
非鉄金属	0.68
金属製品	0.52
機械	5.15
電気機器	17.09
輸送用機器	8.56
精密機器	2.30
その他製品	2.27
電気・ガス業	1.36
陸運業	2.74
海運業	0.74
空運業	0.44
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	7.59
卸売業	6.94
小売業	4.22
銀行業	7.09
証券、商品先物取引業	0.78
保険業	2.41
その他金融業	1.14
不動産業	1.93
サービス業	4.75
合 計	98.75

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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12月	買建	28	日本円	637,810,450	665,280,000	1.25

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

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

以下の運用状況は2023年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	226,011,154,618	69.45
	カナダ	10,826,466,319	3.33
	ドイツ	7,987,913,769	2.45

	イタリア	1,780,719,505	0.55
	フランス	10,137,333,508	3.12
	オランダ	6,073,955,148	1.87
	スペイン	2,437,625,331	0.75
	ベルギー	695,450,833	0.21
	オーストリア	167,971,806	0.05
	ルクセンブルク	163,183,725	0.05
	フィンランド	998,168,410	0.31
	アイルランド	6,089,942,724	1.87
	ポルトガル	169,472,155	0.05
	イギリス	12,678,041,459	3.90
	スイス	10,164,291,845	3.12
	スウェーデン	2,776,310,838	0.85
	ノルウェー	621,568,498	0.19
	デンマーク	3,088,048,703	0.95
	ケイマン	403,108,241	0.12
	オーストラリア	5,987,525,941	1.84
	バミューダ	403,556,289	0.12
	ニュージーランド	242,828,106	0.07
	香港	1,605,222,437	0.49
	シンガポール	978,676,822	0.30
	イスラエル	640,801,378	0.20
	ジャージー	851,733,925	0.26
	アラブ首長国連邦	0	0.00
	マン島	37,168,029	0.01
	小計	314,018,240,362	96.49
投資証券	アメリカ	5,591,845,215	1.72
	カナダ	13,882,910	0.00
	フランス	123,158,901	0.04
	ベルギー	31,861,013	0.01
	イギリス	100,297,429	0.03
	オーストラリア	382,302,853	0.12
	香港	76,336,364	0.02
	シンガポール	128,006,520	0.04
	小計	6,447,691,205	1.98
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		4,969,687,607	1.53
合計（純資産総額）		325,435,619,174	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,190,805,609	1.29
	買建	ドイツ	799,272,612	0.25

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
-------	----	------	---------	---------



為替予約取引	買建		4,274,619,025	1.31
	売建		241,021,000	0.07

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	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	635,454	25,177.74	15,999,297,841	27,850.64	17,697,804,340	5.44
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	285,184	50,126.65	14,295,319,734	55,717.46	15,889,730,822	4.88
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	373,070	17,880.74	6,670,771,217	21,519.28	8,028,198,685	2.47
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	99,770	61,499.22	6,135,777,401	70,799.49	7,063,665,915	2.17
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	239,890	18,479.62	4,433,076,681	19,852.97	4,762,531,204	1.46
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	89,270	44,074.47	3,934,528,655	48,856.65	4,361,433,503	1.34
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	213,320	18,636.36	3,975,509,458	20,060.34	4,279,273,435	1.31
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	115,315	31,253.45	3,603,992,703	35,905.66	4,140,462,313	1.27
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	37,515	77,987.91	2,925,716,529	78,679.50	2,951,661,765	0.91
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	32,549	86,267.78	2,807,930,289	87,044.85	2,833,222,829	0.87
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	52,395	49,562.76	2,596,841,334	52,752.53	2,763,969,244	0.85
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	118,150	20,654.35	2,440,312,360	22,695.84	2,681,513,780	0.82
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	17,890	126,294.02	2,259,400,153	138,367.86	2,475,401,160	0.76
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	162,971	15,964.61	2,601,769,043	15,051.14	2,452,899,956	0.75
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	65,432	34,845.49	2,280,010,326	37,389.60	2,446,476,706	0.75
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	97,371	22,290.53	2,170,452,103	22,370.81	2,178,268,890	0.67
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	95,309	22,148.74	2,110,975,120	22,226.68	2,118,403,511	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	34,225	56,818.63	1,944,617,684	60,272.22	2,062,816,983	0.63
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	131,570	14,998.30	1,973,327,448	14,932.40	1,964,656,394	0.60

アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	40,665	41,344.46	1,681,272,673	45,741.71	1,860,086,694	0.57
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	108,130	16,613.20	1,796,385,766	16,709.35	1,806,782,318	0.56
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	18,364	76,731.35	1,409,094,600	90,799.54	1,667,442,887	0.51
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	16,317	90,613.85	1,478,546,297	101,622.09	1,658,167,675	0.51
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	73,401	22,900.63	1,680,929,779	21,164.84	1,553,520,692	0.48
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	17,934	80,934.27	1,451,475,257	86,456.57	1,550,512,130	0.48
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	102,483	15,241.56	1,562,001,646	14,873.18	1,524,249,039	0.47
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	71,326	21,356.89	1,523,302,124	20,369.19	1,452,853,203	0.45
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	166,332	8,254.96	1,373,064,507	8,563.88	1,424,448,303	0.44
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	59,932	23,942.60	1,434,928,219	22,954.68	1,375,720,217	0.42
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	55,711	23,883.21	1,330,557,616	24,584.22	1,369,611,547	0.42

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	4.86
		素材	3.94
		資本財	6.59
		商業・専門サービス	1.56
		運輸	1.75
		自動車・自動車部品	2.05
		耐久消費財・アパレル	1.54
		消費者サービス	2.05
		メディア・娯楽	5.96
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.56
		生活必需品流通・小売り	1.66
		食品・飲料・タバコ	3.58
		家庭用品・パーソナル用品	1.68
		ヘルスケア機器・サービス	4.33
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.84
		銀行	5.22
		金融サービス	6.56
		保険	3.14
		ソフトウェア・サービス	10.27
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.85
電気通信サービス	1.20		

		公益事業	2.69
		半導体・半導体製造装置	6.30
		不動産管理・開発	0.33
投資証券			1.98
合 計			98.47

## 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 EMINI2312	買建	125	米ドル	26,916,625	3,958,628,038	28,495,312.5	4,190,805,609	1.29
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2312	買建	125	ユーロ	4,858,480	784,693,104	4,948,750	799,272,612	0.25

(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	24,600,000.00	3,622,785,400	3,591,855,090	1.10
	ユーロ	買建	4,250,000.00	676,888,936	682,763,935	0.21
	米ドル	売建	1,400,000.00	205,772,000	205,764,720	0.06
	ユーロ	売建	150,000.00	24,208,500	24,214,920	0.01
	ノルウェークローネ	売建	800,000.00	11,038,400	11,041,360	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2023年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	45,502,187,890	87.19
地方債証券	日本	2,730,793,432	5.23
特殊債券	日本	2,509,985,000	4.81
社債券	日本	1,297,998,000	2.49
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		146,853,871	0.28
合計(純資産総額)		52,187,818,193	100.00

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

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

日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	700,000,000	100.47	703,297,000	100.56	703,948,000	0.300	2025/12/20	1.35
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	700,000,000	99.87	699,090,000	100.09	700,679,000	0.100	2026/9/20	1.34
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	680,000,000	99.54	676,919,600	99.91	679,394,800	0.100	2027/6/20	1.30
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	660,000,000	99.78	658,548,000	100.04	660,297,000	0.100	2026/12/20	1.27
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	660,000,000	99.67	657,881,400	99.98	659,887,800	0.100	2027/3/20	1.26
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	645,000,000	99.94	644,658,150	100.11	645,735,300	0.100	2026/6/20	1.24
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	630,000,000	100.00	630,000,000	100.13	630,863,100	0.100	2026/3/20	1.21
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	620,000,000	100.65	624,054,800	100.71	624,414,400	0.400	2025/9/20	1.20
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	590,000,000	99.24	585,521,900	99.71	588,336,200	0.100	2027/12/20	1.13
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	590,000,000	97.34	574,306,000	98.42	580,725,200	0.100	2030/3/20	1.11
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	570,000,000	100.61	573,516,900	100.63	573,619,500	0.400	2025/6/20	1.10
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	580,000,000	96.68	560,784,600	97.94	568,098,400	0.100	2030/9/20	1.09
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	560,000,000	97.61	546,638,400	98.63	552,356,000	0.100	2029/12/20	1.06
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	540,000,000	99.06	534,967,200	99.59	537,813,000	0.100	2028/3/20	1.03
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	535,000,000	98.87	529,002,650	99.45	532,105,650	0.100	2028/6/20	1.02
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	520,000,000	98.67	513,120,400	99.28	516,297,600	0.100	2028/9/20	0.99
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	500,000,000	99.40	497,005,000	99.82	499,145,000	0.100	2027/9/20	0.96
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	500,000,000	95.57	477,875,000	97.16	485,800,000	0.100	2031/6/20	0.93
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	500,000,000	95.18	475,940,000	96.85	484,250,000	0.100	2031/9/20	0.93
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	480,000,000	96.49	463,182,700	97.70	468,993,600	0.400	2033/6/20	0.90
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	460,000,000	96.30	443,016,800	97.67	449,300,400	0.100	2030/12/20	0.86
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	420,000,000	96.87	406,854,000	98.81	415,018,800	0.500	2033/3/20	0.80
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	420,000,000	97.02	407,488,200	98.21	412,482,000	0.100	2030/6/20	0.79
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	400,000,000	98.48	393,944,000	99.17	396,708,000	0.100	2028/12/20	0.76
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	390,000,000	100.55	392,172,300	100.55	392,152,800	0.400	2025/3/20	0.75
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	400,000,000	95.95	383,800,000	97.42	389,692,000	0.100	2031/3/20	0.75
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	400,000,000	95.31	381,268,000	97.18	388,732,000	0.200	2032/3/20	0.74
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	390,000,000	97.02	378,413,100	99.01	386,150,700	0.500	2032/12/20	0.74
日本	国債証券	第117回利付国債(20年)	343,000,000	109.91	377,005,020	110.88	380,342,410	2.100	2030/3/20	0.73
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	390,000,000	94.70	369,330,000	96.65	376,954,500	0.200	2032/9/20	0.72

#### □.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	87.19

地方債証券	5.23
特殊債券	4.81
社債券	2.49
合計	99.72

## 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。

## 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2023年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	75,429,981,867	47.17
	カナダ	3,132,813,401	1.96
	メキシコ	1,432,939,003	0.90
	ドイツ	10,334,215,289	6.46
	イタリア	11,983,711,885	7.49
	フランス	13,436,733,395	8.40
	オランダ	2,400,547,948	1.50
	スペイン	7,924,505,758	4.96
	ベルギー	2,805,340,374	1.75
	オーストリア	1,875,517,596	1.17
	フィンランド	829,753,939	0.52
	アイルランド	921,288,360	0.58
	イギリス	8,064,123,708	5.04
	スウェーデン	329,338,405	0.21
	ノルウェー	281,055,100	0.18
	デンマーク	507,756,850	0.32
	ポーランド	811,343,051	0.51
	オーストラリア	2,336,106,947	1.46
	ニュージーランド	377,376,430	0.24
	シンガポール	681,492,198	0.43
マレーシア	818,775,180	0.51	
中国	11,332,380,577	7.09	
イスラエル	498,373,802	0.31	
小計		158,545,471,063	99.16
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,348,888,073	0.84
合計（純資産総額）		159,894,359,136	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		129,393,516	0.08
--------	----	--	-------------	------

(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	6,750,000	14,222.12	959,993,432	14,414.86	973,003,060	3.625	2026/5/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,190,000	12,301.59	884,484,796	12,820.93	921,824,881	1.750	2029/11/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	13,816.53	844,190,305	14,526.60	887,575,501	4.125	2032/11/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,950,000	14,221.55	846,182,305	14,628.28	870,383,144	4.125	2028/7/31	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,930,000	11,673.68	808,986,111	12,258.50	849,514,404	1.625	2031/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,130,000	11,228.16	800,567,958	11,823.32	843,003,071	1.250	2031/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,830,000	11,251.42	768,472,572	11,857.22	809,848,441	1.375	2031/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,740,000	13,909.60	798,411,107	14,019.03	804,692,664	1.125	2025/2/28	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,240,000	11,651.26	727,039,110	12,278.33	766,167,801	1.875	2032/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,950,000	12,421.53	739,081,166	12,752.57	758,778,038	0.375	2027/7/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,190,000	14,245.22	739,327,417	14,320.42	743,230,136	2.250	2024/10/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,658.73	732,936,582	14,766.73	738,336,992	5.000	2025/8/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,177.31	708,865,634	14,298.24	714,912,417	3.000	2025/7/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,168.12	708,406,041	14,279.27	713,963,816	2.875	2025/6/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,876.84	693,842,434	14,184.48	709,224,485	3.250	2027/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,900,000	13,891.21	680,669,653	14,459.39	708,510,254	4.000	2030/7/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,980,000	13,458.05	670,210,997	13,953.26	694,872,659	3.250	2029/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,910,000	11,200.29	661,937,277	11,755.54	694,752,438	0.875	2030/11/15	0.43
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	2,093.85	670,032,676	2,090.46	668,947,389	3.020	2025/10/22	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	12,403.85	632,596,573	13,069.68	666,553,904	2.750	2032/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,650,000	14,229.74	661,683,056	14,303.21	665,099,698	2.250	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	13,520.08	654,372,176	13,732.66	664,660,805	1.625	2026/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,730,000	13,904.14	657,666,053	14,044.89	664,323,338	2.000	2025/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,530,000	14,091.42	638,341,499	14,187.07	642,674,640	2.000	2025/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	12,879.53	619,505,758	13,357.51	642,496,476	2.375	2029/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	12,583.67	604,016,490	13,242.32	635,631,834	2.875	2032/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,930,000	12,442.91	613,435,767	12,890.15	635,484,693	1.500	2028/11/30	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,590,000	13,124.55	602,417,130	13,579.26	623,288,366	2.625	2029/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,630,000	12,904.52	597,479,498	13,384.79	619,716,082	2.375	2029/3/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	14,127.91	593,372,299	14,270.37	599,355,901	3.000	2025/9/30	0.37

#### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.16
合計	99.16

#### 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	880,000.00	129,224,400	129,393,516	0.08

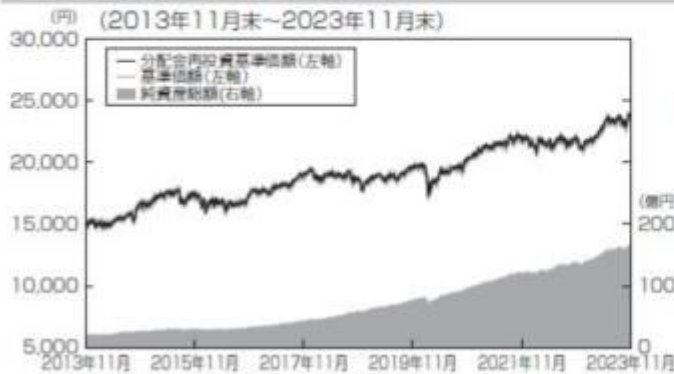
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 参考情報

# 運用実績

2023年11月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額……………23,713円

純資産総額……………166.98億円

※基準価額は、運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

(億円) ※分配金再投資基準価額は、2013年11月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

## 分配の推移(税引前、1万口当たり)

2019年11月	2020年11月	2021年11月	2022年11月	2023年11月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	0円	170円

## 主要な資産の状況

### <資産構成比率>

組入資産	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	30.23%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	10.12%
日本債券インデックスマザーファンド	44.74%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	9.98%
現金その他	4.94%

※当ファンドの対純資産総額比です。

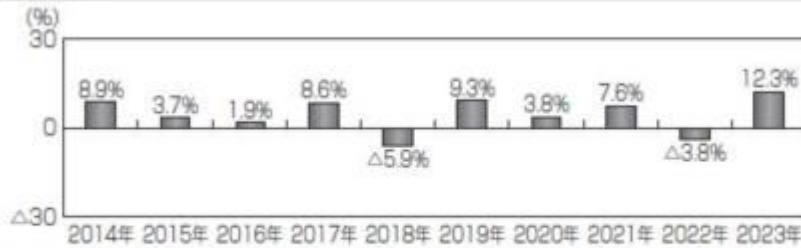
### <組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	業種	比率	
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	輸送用機器	4.49%	
	2 ソニーグループ	電気機器	2.65%	
	3 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.27%	
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.44%	
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.88%	
	3 AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	2.47%	
組入資産	銘柄	種類	償還期限	比率
日本債券インデックス マザーファンド	1 第341回利付国債(10年)	国債証券	2025/12/20	1.35%
	2 第344回利付国債(10年)	国債証券	2026/9/20	1.34%
	3 第347回利付国債(10年)	国債証券	2027/6/20	1.30%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	1 US TREASURY N/B (クーポン3.625%)	国債証券	2026/5/15	0.61%
	2 US TREASURY N/B (クーポン1.750%)	国債証券	2029/11/15	0.58%
	3 US TREASURY N/B (クーポン4.125%)	国債証券	2032/11/15	0.56%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。



## 年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2023年は、2023年11月末までの騰落率です。

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

## (1) 申込方法

- ・確定拠出年金制度の規定に従い、販売会社所定の方法でお申し込みください。
- ・当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて取得の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。

## (2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

## (3) 取扱時間

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

## (4) 申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

## (5) 申込単位

1円以上1円単位

## (6) 申込代金の支払い

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

## (7) 受付の中止および取消

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

## &lt; 解約請求による換金 &gt;

## (1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

## (2) 取扱時間

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

## (3) 解約制限

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

## (4) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

- ・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。

## &lt; 委託会社の照会先 &gt;

日興アセットマネジメント株式会社

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

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

## (5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。

上記の手取額は、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関の場合を記載しています。

税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、課税上の取扱いが変更になる場合があります。

- (6) 解約単位  
1口単位  
販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。
- (7) 解約代金の支払い  
原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。
- (8) 受付の中止および取消  
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。  
・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

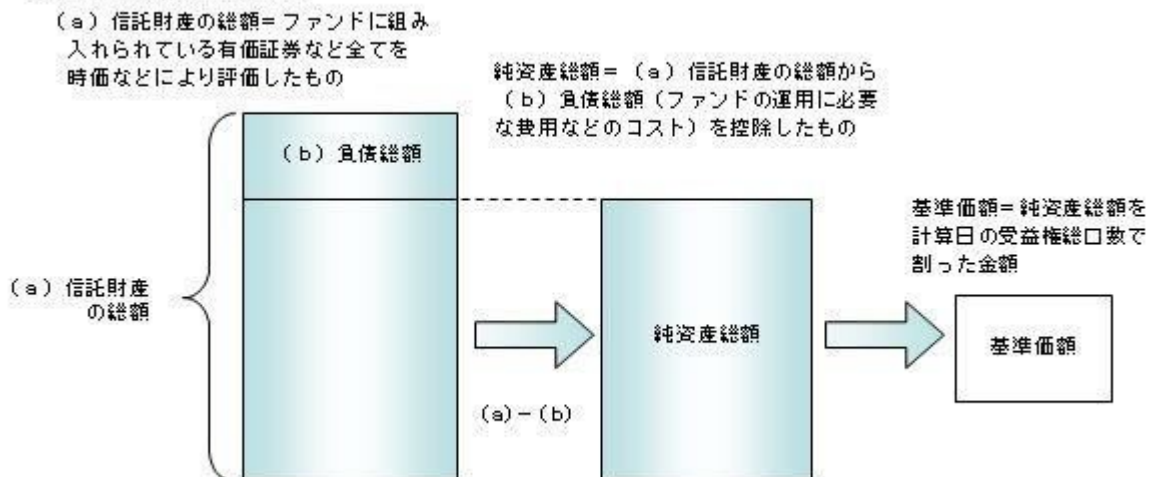
### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の算出

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

##### <基準価額算出の流れ>



##### 有価証券などの評価基準

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

##### <主な資産の評価方法>

###### マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

###### 国内上場株式

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

###### 外国株式

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

###### 公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日\*における以下のいずれかの価額で評価します。

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

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

\* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

##### 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

##### <委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

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

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

## (2) 【保管】

該当事項はありません。

## (3) 【信託期間】

無期限とします(2002年12月10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11月7日から翌年11月6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) 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
  - ロ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内(1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。)に異議を述べるすることができます。(後述の「異議の申立て」をご覧ください。)
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
  - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
  - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
  - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき(監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。)
  - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

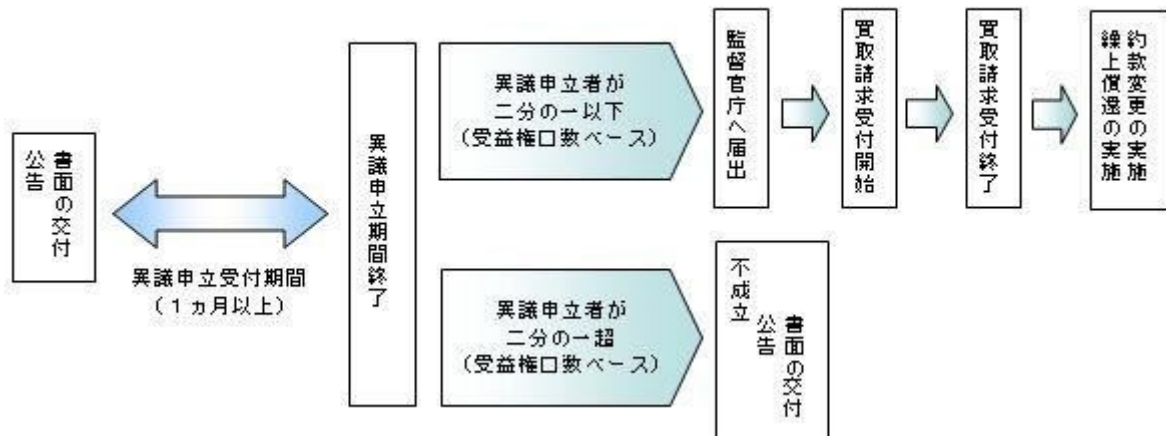
信託約款の変更

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

異議の申立て

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

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

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

関係法人との契約について

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

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

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

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

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

### 第3【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第21期計算期間（2022年11月8日から2023年11月6日まで）の財務諸表について、PwC Japan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】

## 【DCインデックスバランス（株式40）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第20期 2022年11月 7日現在	第21期 2023年11月 6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	700,503,651	829,768,517
親投資信託受益証券	13,025,521,913	15,586,902,425
未収入金	3,168,207	4,336,325
流動資産合計	13,729,193,771	16,421,007,267
資産合計	13,729,193,771	16,421,007,267
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	6,337,773	-
未払解約金	13,394,300	16,023,791
未払受託者報酬	1,464,076	1,742,527
未払委託者報酬	8,784,848	10,455,538
未払利息	1,047	152
その他未払費用	292,769	348,456
流動負債合計	30,274,813	28,570,464
負債合計	30,274,813	28,570,464
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,337,773,682	7,001,684,134
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,361,145,276	9,390,752,669
（分配準備積立金）	1,934,585,813	2,552,560,500
元本等合計	13,698,918,958	16,392,436,803
純資産合計	13,698,918,958	16,392,436,803
負債純資産合計	13,729,193,771	16,421,007,267



## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第20期		第21期	
	自	2021年11月 9日 至 2022年11月 7日	自	2022年11月 8日 至 2023年11月 6日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		223,653,826		1,235,276,868
<b>営業収益合計</b>		<b>223,653,826</b>		<b>1,235,276,868</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		120,701		273,370
受託者報酬		2,787,216		3,291,544
委託者報酬		16,724,032		19,750,011
その他費用		557,352		659,121
<b>営業費用合計</b>		<b>20,189,301</b>		<b>23,974,046</b>
営業利益又は営業損失（ ）		243,843,127		1,211,302,822
経常利益又は経常損失（ ）		243,843,127		1,211,302,822
当期純利益又は当期純損失（ ）		243,843,127		1,211,302,822
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（ ）		30,631,608		58,631,014
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		6,693,659,564		7,361,145,276
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,680,534,370		1,644,459,468
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		1,680,534,370		1,644,459,468
剰余金減少額又は欠損金増加額		793,499,366		767,523,883
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		793,499,366		767,523,883
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		6,337,773		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		7,361,145,276		9,390,752,669

## (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	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11月7日から翌年11月6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いたしますので、当計算期間は2022年11月 8日から2023年11月 6日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第20期 2022年11月 7日現在	第21期 2023年11月 6日現在
1. 期首元本額	5,539,825,051円	6,337,773,682円
期中追加設定元本額	1,457,693,934円	1,322,419,613円
期中一部解約元本額	659,745,303円	658,509,161円
2. 受益権の総数	6,337,773,682口	7,001,684,134口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第20期 自 2021年11月 9日 至 2022年11月 7日		第21期 自 2022年11月 8日 至 2023年11月 6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	176,778,713円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	227,856,901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	571,361,286円
C 信託約款に定める収益調整金	5,681,070,852円	C 信託約款に定める収益調整金	6,838,192,169円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	1,764,144,873円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	1,753,342,313円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	7,621,994,438円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)	9,390,752,669円
F 分配対象収益(1万口当たり)	12,026円	F 分配対象収益(1万口当たり)	13,412円
G 分配金額	6,337,773円	G 分配金額	0円
H 分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	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20期 自 2021年11月 9日 至 2022年11月 7日	第21期 自 2022年11月 8日 至 2023年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

	第20期 2022年11月 7日現在	第21期 2023年11月 6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)

第20期(2022年11月7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	198,196,910
合計	198,196,910

第21期(2023年11月6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	1,157,587,348
合計	1,157,587,348

(関連当事者との取引に関する注記)  
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第20期 2022年11月7日現在		第21期 2023年11月6日現在
1口当たり純資産額	2.1615円	1口当たり純資産額	2.3412円
(1万口当たり純資産額)	(21,615円)	(1万口当たり純資産額)	(23,412円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	322,405,329	1,660,419,684	
	日本債券インデックスマザーファンド	5,467,907,582	7,229,667,404	
	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	594,134,856	1,649,080,706	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	2,089,899,653	5,047,734,631	
合計		8,474,347,420	15,586,902,425	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

	2022年11月 7日現在	2023年11月 6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	224,873,450	228,866,758
株式	43,556,733,190	52,617,187,660
派生商品評価勘定	25,292,350	21,521,250
未収入金	-	85,200
未収配当金	456,381,289	481,193,989
流動資産合計	44,263,280,279	53,348,854,857
資産合計	44,263,280,279	53,348,854,857
<b>負債の部</b>		
流動負債		
前受金	17,060,500	9,973,500
未払解約金	26,250,912	37,082,278
未払利息	336	42
流動負債合計	43,311,748	47,055,820
負債合計	43,311,748	47,055,820
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	22,926,701,557	22,068,149,455
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	21,293,266,974	31,233,649,582
元本等合計	44,219,968,531	53,301,799,037
純資産合計	44,219,968,531	53,301,799,037
負債純資産合計	44,263,280,279	53,348,854,857

## 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11月 7日現在	2023年11月 6日現在
1. 期首	2021年11月 9日	2022年11月 8日
期首元本額	21,399,374,592円	22,926,701,557円
期首からの追加設定元本額	3,152,916,925円	1,858,025,433円
期首からの一部解約元本額	1,625,589,960円	2,716,577,535円
元本の内訳		
DCインデックスバランス（株式20）	803,583,534円	755,738,246円
DCインデックスバランス（株式40）	2,154,040,819円	2,089,899,653円
DCインデックスバランス（株式60）	4,289,020,851円	4,435,189,354円
DCインデックスバランス（株式80）	4,682,567,033円	5,263,753,438円
インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,711,023,635円	1,836,216,644円

	2022年11月 7日現在	2023年11月 6日現在
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	3,235,077,737円	2,697,793,534円
インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	600,774,622円	493,098,615円
Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	- 円	1,080,203円
Ni つみインデックスラップ世界10指数(均等型)	- 円	580,812円
Ni つみインデックスラップ世界10指数(安定成長型)	- 円	323,980円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	2,439,998,702円	1,753,076,468円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	244,734,194円	209,312,833円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	684,883,401円	606,085,095円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,049,790,558円	961,417,051円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,031,206,471円	964,583,529円
計	22,926,701,557円	22,068,149,455円
2. 受益権の総数	22,926,701,557口	22,068,149,455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	562,995,000円	736,825,000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11月 9日 至 2022年11月 7日	自 2022年11月 8日 至 2023年11月 6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11月 7日現在	2023年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2022年11月 7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	368,882,500
合計	368,882,500

(2023年11月 6日現在)

## 売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,031,989,409
合計	3,031,989,409

(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11月 7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	613,734,500	-	639,045,000	25,310,500
合計		613,734,500	-	639,045,000	25,310,500

(2023年11月 6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	615,933,900	-	637,470,000	21,536,100
合計		615,933,900	-	637,470,000	21,536,100

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。  
原則として本書における開示対象ファンドの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11月 7日現在		2023年11月 6日現在
1口当たり純資産額	1.9288円	1口当たり純資産額	2.4153円
(1万口当たり純資産額)	(19,288円)	(1万口当たり純資産額)	(24,153円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	800	3,720.00	2,976,000	
ニッスイ	21,900	681.50	14,924,850	
マルハニチロ	3,300	2,596.00	8,566,800	
雪国まいたけ	1,800	905.00	1,629,000	
カネコ種苗	700	1,412.00	988,400	
サカタのタネ	2,500	4,075.00	10,187,500	
ホクト	1,800	1,798.00	3,236,400	
ホクリヨウ	200	1,061.00	212,200	
住石ホールディングス	2,200	637.00	1,401,400	
日鉄鉱業	900	4,925.00	4,432,500	
三井松島ホールディングス	1,300	2,726.00	3,543,800	
I N P E X	81,300	2,170.00	176,421,000	
石油資源開発	2,500	5,160.00	12,900,000	
K & O エナジーグループ	1,000	2,450.00	2,450,000	
ショーボンドホールディングス	3,000	5,910.00	17,730,000	
ミライト・ワン	7,300	1,948.50	14,224,050	
サンヨーホームズ	300	719.00	215,700	
日本アクア	600	969.00	581,400	
ファーストコーポレーション	400	751.00	300,400	
ベステラ	400	995.00	398,000	
キャンディル	400	560.00	224,000	
ダイセキ環境ソリューション	300	991.00	297,300	
第一カッター興業	700	1,241.00	868,700	
安藤・間	12,800	1,149.00	14,707,200	
東急建設	7,100	767.00	5,445,700	
コムシスホールディングス	7,000	3,073.00	21,511,000	
ビーアールホールディングス	3,500	367.00	1,284,500	
高松コンストラクショングループ	1,700	2,822.00	4,797,400	
東建コーポレーション	600	8,050.00	4,830,000	
ソネック	200	949.00	189,800	
ヤマウラ	1,200	1,271.00	1,525,200	
オリエンタル白石	8,500	333.00	2,830,500	
大成建設	14,400	5,294.00	76,233,600	
大林組	55,000	1,358.50	74,717,500	
清水建設	43,700	1,090.00	47,633,000	
飛鳥建設	1,600	1,383.00	2,212,800	
長谷工コーポレーション	14,100	1,874.00	26,423,400	
松井建設	1,600	773.00	1,236,800	
銭高組	200	3,900.00	780,000	

鹿島建設	34,100	2,545.00	86,784,500
不動テトラ	1,100	2,030.00	2,233,000
大末建設	400	1,348.00	539,200
鉄建建設	1,100	2,057.00	2,262,700
西松建設	3,000	3,623.00	10,869,000
三井住友建設	11,800	404.00	4,767,200
大豊建設	500	3,815.00	1,907,500
ナカノフード建設	800	387.00	309,600
奥村組	2,500	4,510.00	11,275,000
東鉄工業	1,900	2,874.00	5,460,600
イチケン	300	2,160.00	648,000
富士ピー・エス	600	445.00	267,000
浅沼組	1,200	3,575.00	4,290,000
戸田建設	20,900	875.30	18,293,770
熊谷組	2,600	3,640.00	9,464,000
北野建設	200	3,095.00	619,000
植木組	300	1,419.00	425,700
矢作建設工業	2,200	1,326.00	2,917,200
ピーエス三菱	2,100	808.00	1,696,800
日本ハウスホールディングス	3,600	336.00	1,209,600
新日本建設	2,300	1,225.00	2,817,500
東亜道路工業	600	6,030.00	3,618,000
日本道路	1,900	1,981.00	3,763,900
東亜建設工業	1,200	3,680.00	4,416,000
日本国土開発	4,600	605.00	2,783,000
若築建設	600	2,991.00	1,794,600
東洋建設	4,000	1,223.00	4,892,000
五洋建設	21,900	873.20	19,123,080
福田組	600	5,040.00	3,024,000
住友林業	13,300	3,541.00	47,095,300
日本基礎技術	700	438.00	306,600
巴コーポレーション	1,300	574.00	746,200
大和ハウス工業	42,500	4,335.00	184,237,500
ライト工業	3,200	1,943.00	6,217,600
積水ハウス	46,700	3,004.00	140,286,800
日特建設	1,600	1,054.00	1,686,400
北陸電気工事	1,100	1,000.00	1,100,000
ユアテック	3,500	979.00	3,426,500
日本リーテック	1,300	1,292.00	1,679,600
四電工	700	2,964.00	2,074,800
中電工	2,400	2,426.00	5,822,400
関電工	9,700	1,404.00	13,618,800

きんでん	10,900	2,373.50	25,871,150
東京エネシス	1,600	983.00	1,572,800
トーエネック	500	4,250.00	2,125,000
住友電設	1,500	2,444.00	3,666,000
日本電設工業	2,900	2,041.00	5,918,900
エクシオグループ	7,700	3,109.00	23,939,300
新日本空調	1,000	2,371.00	2,371,000
九電工	3,300	4,492.00	14,823,600
三機工業	3,400	1,743.00	5,926,200
日揮ホールディングス	15,200	1,869.50	28,416,400
中外炉工業	500	2,193.00	1,096,500
ヤマト	800	934.00	747,200
太平電業	1,000	4,145.00	4,145,000
高砂熱学工業	4,100	3,090.00	12,669,000
三晃金属工業	100	4,650.00	465,000
朝日工業社	700	2,486.00	1,740,200
明星工業	3,100	1,156.00	3,583,600
大気社	1,800	4,525.00	8,145,000
ダイダン	2,100	1,483.00	3,114,300
日比谷総合設備	1,100	2,295.00	2,524,500
フィル・カンパニー	400	563.00	225,200
テスホールディングス	3,500	480.00	1,680,000
インフロニア・ホールディングス	17,800	1,550.50	27,598,900
東洋エンジニアリング	2,400	620.00	1,488,000
レイズネクスト	2,300	1,455.00	3,346,500
ニッポン	4,600	2,261.00	10,400,600
日清製粉グループ本社	14,300	2,209.00	31,588,700
日東富士製粉	300	4,765.00	1,429,500
昭和産業	1,500	3,030.00	4,545,000
鳥越製粉	800	700.00	560,000
中部飼料	2,100	1,074.00	2,255,400
フィード・ワン	2,200	768.00	1,689,600
東洋精糖	200	1,986.00	397,200
日本甜菜製糖	900	1,915.00	1,723,500
D M三井製糖ホールディングス	1,500	3,020.00	4,530,000
塩水港精糖	1,100	240.00	264,000
ウェルネオシュガー	800	2,043.00	1,634,400
森永製菓	3,300	5,315.00	17,539,500
中村屋	400	3,080.00	1,232,000
江崎グリコ	4,400	4,294.00	18,893,600
名糖産業	600	1,616.00	969,600
井村屋グループ	900	2,323.00	2,090,700

不二家	1,100	2,491.00	2,740,100
山崎製パン	10,300	3,134.00	32,280,200
第一屋製パン	100	490.00	49,000
モロゾフ	500	3,810.00	1,905,000
亀田製菓	900	3,925.00	3,532,500
寿スピリッツ	7,300	2,221.00	16,213,300
カルビー	7,100	2,684.00	19,056,400
森永乳業	2,800	5,640.00	15,792,000
六甲バター	1,100	1,425.00	1,567,500
ヤクルト本社	22,000	3,762.00	82,764,000
明治ホールディングス	18,900	3,705.00	70,024,500
雪印メグミルク	3,700	2,356.00	8,717,200
プリマハム	2,100	2,254.00	4,733,400
日本ハム	6,600	4,338.00	28,630,800
林兼産業	300	582.00	174,600
丸大食品	1,600	1,671.00	2,673,600
S Foods	1,700	3,180.00	5,406,000
柿安本店	600	2,462.00	1,477,200
伊藤ハム米久ホールディングス	2,400	4,055.00	9,732,000
サッポロホールディングス	5,100	5,480.00	27,948,000
アサヒグループホールディングス	35,700	5,662.00	202,133,400
キリンホールディングス	64,300	2,177.50	140,013,250
宝ホールディングス	10,500	1,270.50	13,340,250
オエノンホールディングス	4,500	420.00	1,890,000
養命酒製造	500	1,846.00	923,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	12,100	2,007.00	24,284,700
サントリー食品インターナショナル	10,900	4,638.00	50,554,200
ダイドーグループホールディングス	900	5,920.00	5,328,000
伊藤園	5,200	4,919.00	25,578,800
キーコーヒー	1,700	2,048.00	3,481,600
ユニカフェ	300	949.00	284,700
ジャパンフーズ	100	1,113.00	111,300
日清オイリオグループ	2,200	4,205.00	9,251,000
不二製油グループ本社	3,600	2,377.00	8,557,200
J - オイルミルズ	1,800	1,790.00	3,222,000
キッコーマン	10,200	9,823.00	100,194,600
味の素	36,700	5,982.00	219,539,400
ブルドックソース	800	2,128.00	1,702,400
キュービー	8,300	2,609.00	21,654,700
ハウス食品グループ本社	5,300	3,282.00	17,394,600
カゴメ	6,600	3,174.00	20,948,400
焼津水産化学工業	400	1,185.00	474,000



アリアケジャパン	1,500	4,905.00	7,357,500
ピエトロ	100	1,822.00	182,200
エバラ食品工業	400	2,946.00	1,178,400
やまみ	100	2,195.00	219,500
ニチレイ	7,100	3,226.00	22,904,600
東洋水産	7,800	8,074.00	62,977,200
イトアンドホールディングス	700	1,993.00	1,395,100
大冷	100	1,914.00	191,400
ヨシムラ・フード・ホールディングス	700	1,101.00	770,700
日清食品ホールディングス	5,400	13,585.00	73,359,000
永谷園ホールディングス	800	2,305.00	1,844,000
一正蒲鉾	300	722.00	216,600
フジッコ	1,600	1,962.00	3,139,200
ロック・フィールド	1,700	1,586.00	2,696,200
日本たばこ産業	93,800	3,681.00	345,277,800
ケンコーマヨネーズ	1,100	1,560.00	1,716,000
わらべや日洋ホールディングス	1,000	3,430.00	3,430,000
なとり	1,000	2,014.00	2,014,000
イフジ産業	200	1,715.00	343,000
ファーマフーズ	2,200	1,377.00	3,029,400
ユーグレナ	9,600	762.00	7,315,200
紀文食品	1,300	1,167.00	1,517,100
ピクルスホールディングス	900	1,205.00	1,084,500
ミヨシ油脂	300	1,364.00	409,200
理研ビタミン	1,300	2,278.00	2,961,400
片倉工業	1,400	1,746.00	2,444,400
ゲンゼ	1,100	4,745.00	5,219,500
東洋紡	6,800	1,035.00	7,038,000
ユニチカ	5,000	196.00	980,000
富士紡ホールディングス	700	3,600.00	2,520,000
倉敷紡績	1,200	2,344.00	2,812,800
シキボウ	700	1,072.00	750,400
日本毛織	4,100	1,386.00	5,682,600
ダイトウボウ	1,200	89.00	106,800
トーア紡コーポレーション	300	428.00	128,400
ガイドーリミテッド	1,200	341.00	409,200
帝国繊維	1,800	1,936.00	3,484,800
帝人	15,100	1,391.50	21,011,650
東レ	105,100	771.20	81,053,120
住江織物	200	2,181.00	436,200
日本フェルト	500	418.00	209,000
イチカワ	100	1,561.00	156,100

日東製網	100	1,428.00	142,800
アツギ	600	436.00	261,600
ダイニック	300	775.00	232,500
セーレン	3,000	2,300.00	6,900,000
ソトー	300	707.00	212,100
東海染工	100	956.00	95,600
小松マテーレ	2,200	784.00	1,724,800
ワコールホールディングス	3,200	3,517.00	11,254,400
ホギメディカル	2,100	3,300.00	6,930,000
クラウディアホールディングス	100	442.00	44,200
T S Iホールディングス	5,300	831.00	4,404,300
マツオカコーポレーション	300	1,644.00	493,200
ワールド	2,200	1,598.00	3,515,600
三陽商会	500	2,701.00	1,350,500
ナイガイ	200	266.00	53,200
オンワードホールディングス	9,300	481.00	4,473,300
ルックホールディングス	400	2,004.00	801,600
ゴールドウイン	2,800	10,095.00	28,266,000
デサント	2,700	4,375.00	11,812,500
キング	300	692.00	207,600
ヤマトインターナショナル	600	298.00	178,800
特種東海製紙	900	3,655.00	3,289,500
王子ホールディングス	65,400	644.80	42,169,920
日本製紙	8,800	1,277.00	11,237,600
三菱製紙	1,200	577.00	692,400
北越コーポレーション	7,700	1,195.00	9,201,500
中越パルプ工業	300	1,340.00	402,000
大王製紙	6,900	1,247.00	8,604,300
阿波製紙	200	481.00	96,200
レンゴー	14,300	929.20	13,287,560
トーモク	900	2,177.00	1,959,300
ザ・パック	1,200	3,395.00	4,074,000
北の達人コーポレーション	6,600	202.00	1,333,200
クラレ	22,900	1,711.50	39,193,350
旭化成	106,200	953.70	101,282,940
共和レザー	500	722.00	361,000
巴川製紙所	200	637.00	127,400
レゾナック・ホールディングス	15,200	2,540.00	38,608,000
住友化学	116,500	398.10	46,378,650
住友精化	700	4,985.00	3,489,500
日産化学	7,400	6,387.00	47,263,800
ラサ工業	600	2,019.00	1,211,400

クレハ	1,100	9,090.00	9,999,000
多木化学	600	3,350.00	2,010,000
テイカ	1,300	1,432.00	1,861,600
石原産業	2,600	1,430.00	3,718,000
片倉コープアグリ	200	1,140.00	228,000
日本曹達	1,800	5,470.00	9,846,000
東ソー	20,900	1,941.00	40,566,900
トクヤマ	5,100	2,314.50	11,803,950
セントラル硝子	1,700	2,886.00	4,906,200
東亜合成	7,800	1,423.00	11,099,400
大阪ソーダ	1,100	8,750.00	9,625,000
関東電化工業	3,000	815.00	2,445,000
デンカ	5,700	2,763.50	15,751,950
信越化学工業	142,300	4,838.00	688,447,400
日本カーバイド工業	600	1,736.00	1,041,600
堺化学工業	1,200	2,113.00	2,535,600
第一稀元素化学工業	1,700	991.00	1,684,700
エア・ウォーター	14,800	1,960.50	29,015,400
日本酸素ホールディングス	15,200	4,259.00	64,736,800
日本化学工業	600	1,949.00	1,169,400
東邦アセチレン	200	1,620.00	324,000
日本パーカライズニング	7,000	1,115.00	7,805,000
高压ガス工業	2,200	788.00	1,733,600
四国化成ホールディングス	2,000	1,802.00	3,604,000
戸田工業	400	1,818.00	727,200
ステラ ケミファ	900	3,320.00	2,988,000
保土谷化学工業	500	3,070.00	1,535,000
日本触媒	2,400	5,632.00	13,516,800
大日精化工業	1,100	2,248.00	2,472,800
カネカ	4,000	3,806.00	15,224,000
三菱瓦斯化学	11,700	2,083.00	24,371,100
三井化学	12,900	3,940.00	50,826,000
J S R	17,100	4,030.00	68,913,000
東京応化工業	2,500	9,071.00	22,677,500
大阪有機化学工業	1,300	2,660.00	3,458,000
三菱ケミカルグループ	114,800	968.40	111,172,320
K Hネオケム	2,400	2,296.00	5,510,400
ダイセル	20,200	1,516.50	30,633,300
住友ベークライト	2,300	6,798.00	15,635,400
積水化学工業	31,800	2,077.50	66,064,500
日本ゼオン	10,800	1,264.00	13,651,200
アイカ工業	4,000	3,506.00	14,024,000

U B E	7,500	2,376.50	17,823,750
積水樹脂	2,400	2,406.00	5,774,400
タキロンシーアイ	4,000	606.00	2,424,000
旭有機材	1,000	3,890.00	3,890,000
ニチバン	800	1,828.00	1,462,400
リケンテクノス	3,300	906.00	2,989,800
大倉工業	700	2,729.00	1,910,300
積水化成成品工業	2,200	471.00	1,036,200
群栄化学工業	400	3,245.00	1,298,000
タイガースポリマー	400	661.00	264,400
ミライアル	300	1,402.00	420,600
ダイキアクシス	300	742.00	222,600
ダイキョーニシカワ	3,500	784.00	2,744,000
竹本容器	300	777.00	233,100
森六ホールディングス	900	2,454.00	2,208,600
恵和	1,100	1,362.00	1,498,200
日本化薬	12,000	1,339.00	16,068,000
カーリットホールディングス	1,700	989.00	1,681,300
日本精化	1,100	2,834.00	3,117,400
扶桑化学工業	1,700	4,155.00	7,063,500
トリケミカル研究所	1,900	3,405.00	6,469,500
A D E K A	5,500	2,617.50	14,396,250
日油	4,900	6,907.00	33,844,300
新日本理化	1,100	209.00	229,900
ハリマ化成グループ	900	806.00	725,400
花王	35,500	5,463.00	193,936,500
第一工業製薬	600	1,806.00	1,083,600
石原ケミカル	700	1,993.00	1,395,100
日華化学	400	950.00	380,000
ニイタカ	200	2,102.00	420,400
三洋化成工業	1,000	4,085.00	4,085,000
有機合成薬品工業	700	283.00	198,100
大日本塗料	1,700	988.00	1,679,600
日本ペイントホールディングス	83,300	1,037.50	86,423,750
関西ペイント	15,400	2,303.00	35,466,200
神東塗料	600	129.00	77,400
中国塗料	3,200	1,480.00	4,736,000
日本特殊塗料	600	1,237.00	742,200
藤倉化成	2,000	444.00	888,000
太陽ホールディングス	2,700	2,950.00	7,965,000
D I C	6,100	2,402.50	14,655,250
サカタインクス	3,500	1,300.00	4,550,000

東洋インキＳＣホールディングス	3,400	2,562.00	8,710,800
T&K TOKA	1,500	1,450.00	2,175,000
富士フィルムホールディングス	29,200	8,630.00	251,996,000
資生堂	32,800	4,821.00	158,128,800
ライオン	20,600	1,451.00	29,890,600
高砂香料工業	1,200	3,340.00	4,008,000
マンダム	3,400	1,263.00	4,294,200
ミルボン	2,100	4,129.00	8,670,900
ファンケル	6,900	2,325.00	16,042,500
コーセー	3,200	10,480.00	33,536,000
コタ	1,400	1,641.00	2,297,400
ポーラ・オルビスホールディングス	8,000	1,541.00	12,328,000
ノエビアホールディングス	1,400	5,290.00	7,406,000
アジュバンホールディングス	200	921.00	184,200
新日本製薬	900	1,485.00	1,336,500
I - n e	300	2,935.00	880,500
アクシージア	800	1,020.00	816,000
エステー	1,200	1,504.00	1,804,800
アグロ カネショウ	600	1,411.00	846,600
コニシ	2,600	2,523.00	6,559,800
長谷川香料	3,000	3,375.00	10,125,000
星光PMC	100	1,068.00	106,800
小林製薬	4,600	6,291.00	28,938,600
荒川化学工業	1,300	1,028.00	1,336,400
メック	1,300	3,680.00	4,784,000
日本高純度化学	400	2,632.00	1,052,800
タカラバイオ	4,200	1,332.00	5,594,400
JCU	1,800	3,395.00	6,111,000
新田ゼラチン	600	692.00	415,200
OATアグリオ	500	1,884.00	942,000
デクセリアルズ	3,900	4,429.00	17,273,100
アース製薬	1,400	4,950.00	6,930,000
北興化学工業	1,600	957.00	1,531,200
大成ラミック	500	3,015.00	1,507,500
クミアイ化学工業	6,200	1,115.00	6,913,000
日本農薬	2,800	659.00	1,845,200
アキレス	1,000	1,599.00	1,599,000
有沢製作所	2,800	1,088.00	3,046,400
日東電工	10,100	10,220.00	103,222,000
レック	2,000	996.00	1,992,000
三光合成	2,000	546.00	1,092,000
きもと	1,300	187.00	243,100

藤森工業	1,200	3,820.00	4,584,000	
前澤化成工業	1,000	1,534.00	1,534,000	
未来工業	600	3,265.00	1,959,000	
ウェーブロックホールディングス	300	630.00	189,000	
J S P	1,100	1,776.00	1,953,600	
エフピコ	3,000	2,863.50	8,590,500	
天馬	1,100	2,637.00	2,900,700	
信越ポリマー	3,400	1,384.00	4,705,600	
東リ	2,200	347.00	763,400	
ニフコ	4,700	3,850.00	18,095,000	
バルカー	1,300	3,855.00	5,011,500	
ユニ・チャーム	32,800	5,304.00	173,971,200	
ショーエイコーポレーション	300	589.00	176,700	
協和キリン	19,000	2,451.50	46,578,500	
武田薬品工業	139,100	4,131.00	574,622,100	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	137,900	1,784.50	246,082,550	
住友ファーマ	11,700	447.00	5,229,900	
塩野義製薬	19,800	7,122.00	141,015,600	
わかもと製薬	1,000	197.00	197,000	
日本新薬	4,100	5,796.00	23,763,600	
中外製薬	49,200	4,689.00	230,698,800	
科研製薬	2,700	3,313.00	8,945,100	
エーザイ	19,100	8,172.00	156,085,200	
ロート製薬	15,200	3,604.00	54,780,800	
小野薬品工業	33,400	2,601.00	86,873,400	
久光製薬	3,500	4,727.00	16,544,500	
持田製薬	1,800	3,350.00	6,030,000	
参天製薬	28,600	1,318.00	37,694,800	
扶桑薬品工業	600	1,929.00	1,157,400	
日本ケミファ	100	1,663.00	166,300	
ツムラ	4,900	2,703.00	13,244,700	
キッセイ薬品工業	2,600	3,160.00	8,216,000	
生化学工業	2,600	790.00	2,054,000	
栄研化学	3,100	1,501.00	4,653,100	
鳥居薬品	800	3,625.00	2,900,000	
J C R ファーマ	5,300	1,199.00	6,354,700	
東和薬品	2,400	2,718.00	6,523,200	
富士製薬工業	1,200	1,153.00	1,383,600	
ゼリア新薬工業	2,200	1,947.00	4,283,400	
そーせいグループ	5,100	1,507.00	7,685,700	
第一三共	136,900	4,053.00	554,855,700	
杏林製薬	3,400	1,800.00	6,120,000	

大幸薬品	3,200	336.00	1,075,200
ダイト	1,200	1,945.00	2,334,000
大塚ホールディングス	32,700	5,344.00	174,748,800
大正製薬ホールディングス	3,500	5,943.00	20,800,500
ペプチドリーム	7,600	1,240.50	9,427,800
あすか製薬ホールディングス	1,600	1,699.00	2,718,400
サワイグループホールディングス	3,600	4,791.00	17,247,600
日本コークス工業	15,700	116.00	1,821,200
ニチレキ	2,100	2,253.00	4,731,300
ユシロ化学工業	800	1,541.00	1,232,800
ビーピー・カストロール	300	906.00	271,800
富士石油	4,500	319.00	1,435,500
MORESCO	300	1,243.00	372,900
出光興産	17,500	3,423.00	59,902,500
ENEOSホールディングス	248,900	566.30	140,952,070
コスモエネルギーホールディングス	4,700	5,502.00	25,859,400
横浜ゴム	8,000	2,899.00	23,192,000
TOYO TIRE	9,000	2,281.50	20,533,500
ブリヂストン	46,000	5,896.00	271,216,000
住友ゴム工業	15,400	1,587.00	24,439,800
藤倉コンポジット	1,100	1,194.00	1,313,400
オカモト	700	5,190.00	3,633,000
フコク	800	1,358.00	1,086,400
ニッタ	1,600	3,590.00	5,744,000
住友理工	2,400	996.00	2,390,400
三ツ星ベルト	1,900	4,500.00	8,550,000
バンドー化学	2,400	1,535.00	3,684,000
日東紡績	2,000	4,190.00	8,380,000
A G C	14,700	5,168.00	75,969,600
日本板硝子	7,500	716.00	5,370,000
石塚硝子	100	3,245.00	324,500
日本山村硝子	300	1,711.00	513,300
日本電気硝子	6,400	3,009.00	19,257,600
オハラ	700	1,322.00	925,400
住友大阪セメント	2,600	3,676.00	9,557,600
太平洋セメント	9,300	2,627.50	24,435,750
日本ヒューム	1,300	901.00	1,171,300
日本コンクリート工業	2,900	349.00	1,012,100
三谷セキサン	700	4,665.00	3,265,500
アジアパイルホールディングス	2,200	714.00	1,570,800
東海カーボン	14,500	1,195.00	17,327,500
日本カーボン	800	4,490.00	3,592,000

東洋炭素	1,100	5,320.00	5,852,000
ノリタケカンパニーリミテド	900	6,060.00	5,454,000
TOTO	10,400	3,837.00	39,904,800
日本碍子	18,300	1,918.00	35,099,400
日本特殊陶業	13,100	3,404.00	44,592,400
ダントーホールディングス	500	809.00	404,500
MARUWA	600	27,870.00	16,722,000
品川リフラクトリーズ	1,900	1,611.00	3,060,900
黒崎播磨	300	10,350.00	3,105,000
ヨータイ	900	1,491.00	1,341,900
東京窯業	800	331.00	264,800
ニッカトー	300	552.00	165,600
フジミインコーポレーテッド	4,200	3,185.00	13,377,000
クニミネ工業	200	979.00	195,800
エーアンドエーマテリアル	200	1,088.00	217,600
ニチアス	4,000	3,080.00	12,320,000
ニチハ	2,000	3,045.00	6,090,000
日本製鉄	72,400	3,250.00	235,300,000
神戸製鋼所	32,600	1,852.00	60,375,200
合同製鐵	900	4,450.00	4,005,000
JFEホールディングス	45,000	2,099.00	94,455,000
東京製鐵	4,600	1,803.00	8,293,800
共英製鋼	1,900	2,104.00	3,997,600
大和工業	3,100	7,507.00	23,271,700
東京鐵鋼	700	3,795.00	2,656,500
大阪製鐵	800	1,893.00	1,514,400
淀川製鋼所	1,900	3,675.00	6,982,500
中部鋼鈹	1,100	2,019.00	2,220,900
丸一鋼管	4,900	3,798.00	18,610,200
モリ工業	300	4,625.00	1,387,500
大同特殊鋼	2,000	6,453.00	12,906,000
日本高周波鋼業	500	520.00	260,000
日本冶金工業	1,200	4,090.00	4,908,000
山陽特殊製鋼	1,600	2,579.00	4,126,400
愛知製鋼	1,000	3,525.00	3,525,000
日本金属	400	793.00	317,200
大平洋金属	1,400	1,363.00	1,908,200
新日本電工	8,300	296.00	2,456,800
栗本鐵工所	800	3,330.00	2,664,000
虹技	200	1,154.00	230,800
日本鑄鐵管	200	1,029.00	205,800
三菱製鋼	1,300	1,439.00	1,870,700



日亜銅業	1,200	306.00	367,200
日本精線	300	4,885.00	1,465,500
エンビプロ・ホールディングス	1,100	653.00	718,300
シンニッタン	1,500	246.00	369,000
新家工業	200	3,070.00	614,000
大紀アルミニウム工業所	2,000	1,237.00	2,474,000
日本軽金属ホールディングス	4,700	1,647.00	7,740,900
三井金属鉱業	4,700	3,916.00	18,405,200
東邦亜鉛	1,000	1,627.00	1,627,000
三菱マテリアル	11,600	2,471.50	28,669,400
住友金属鉱山	18,700	4,356.00	81,457,200
D O W Aホールディングス	4,000	4,923.00	19,692,000
古河機械金属	2,100	2,024.00	4,250,400
エス・サイエンス	5,200	22.00	114,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,800	3,290.00	9,212,000
東邦チタニウム	3,400	1,998.00	6,793,200
U A C J	2,300	3,100.00	7,130,000
C Kサンエツ	400	3,655.00	1,462,000
古河電気工業	5,400	2,353.00	12,706,200
住友電気工業	60,500	1,801.50	108,990,750
フジクラ	19,100	1,163.00	22,213,300
S W C C	1,800	2,538.00	4,568,400
タツタ電線	2,900	692.00	2,006,800
カナレ電気	100	1,491.00	149,100
平河ヒューテック	1,000	1,464.00	1,464,000
リョービ	1,700	2,856.00	4,855,200
アーレスティ	1,000	756.00	756,000
A R Eホールディングス	6,100	1,907.00	11,632,700
稲葉製作所	800	1,520.00	1,216,000
宮地エンジニアリンググループ	800	3,065.00	2,452,000
トーカロ	4,700	1,464.00	6,880,800
アルファC o	300	1,524.00	457,200
S U M C O	28,700	2,060.50	59,136,350
川田テクノロジーズ	400	6,640.00	2,656,000
R S Technologies	1,100	2,539.00	2,792,900
ジェイテックコーポレーション	100	2,149.00	214,900
信和	600	741.00	444,600
東洋製罐グループホールディングス	9,600	2,480.00	23,808,000
ホッカンホールディングス	800	1,585.00	1,268,000
コロナ	900	909.00	818,100
横河ブリッジホールディングス	2,500	2,586.00	6,465,000
駒井ハルテック	200	2,146.00	429,200

高田機工	100	3,115.00	311,500
三和ホールディングス	16,200	2,203.00	35,688,600
文化シャッター	4,300	1,332.00	5,727,600
三協立山	1,800	837.00	1,506,600
アルインコ	1,200	970.00	1,164,000
東洋シャッター	200	701.00	140,200
L I X I L	25,200	1,751.00	44,125,200
日本フィルコン	600	483.00	289,800
ノーリツ	2,700	1,600.00	4,320,000
長府製作所	1,600	2,165.00	3,464,000
リンナイ	7,900	2,842.00	22,451,800
ダイニチ工業	500	706.00	353,000
日東精工	2,400	589.00	1,413,600
三洋工業	100	2,062.00	206,200
岡部	2,900	723.00	2,096,700
ジーテクト	2,100	1,755.00	3,685,500
東プレ	2,900	1,669.00	4,840,100
高周波熱錬	2,500	1,013.00	2,532,500
東京製綱	1,000	1,393.00	1,393,000
サンコール	1,300	497.00	646,100
モリテック スチール	800	297.00	237,600
パイオラックス	2,000	2,277.00	4,554,000
エイチワン	1,700	836.00	1,421,200
日本発條	14,300	1,159.50	16,580,850
中央発條	1,200	731.00	877,200
アドバネクス	100	971.00	97,100
立川ブラインド工業	700	1,452.00	1,016,400
三益半導体工業	1,300	2,613.00	3,396,900
日本ドライケミカル	200	2,326.00	465,200
日本製鋼所	4,400	2,501.00	11,004,400
三浦工業	6,600	3,031.00	20,004,600
タクマ	5,400	1,503.00	8,116,200
ツガミ	3,500	1,112.00	3,892,000
オークマ	1,400	6,293.00	8,810,200
芝浦機械	1,600	3,790.00	6,064,000
アマダ	25,300	1,510.50	38,215,650
アイダエンジニアリング	3,700	945.00	3,496,500
T A K I S A W A	300	2,598.00	779,400
F U J I	7,500	2,275.00	17,062,500
牧野フライス製作所	1,700	5,740.00	9,758,000
オーエスジー	7,000	1,763.00	12,341,000
ダイジェット工業	100	907.00	90,700

旭ダイヤモンド工業	3,800	862.00	3,275,600
D M G 森精機	9,600	2,633.00	25,276,800
ソディック	3,900	755.00	2,944,500
ディスコ	7,600	29,065.00	220,894,000
日東工器	800	1,878.00	1,502,400
日進工具	1,500	1,047.00	1,570,500
パンチ工業	900	432.00	388,800
富士ダイス	900	660.00	594,000
豊和工業	500	765.00	382,500
リケンN P R	1,700	1,785.00	3,034,500
東洋機械金属	800	645.00	516,000
島精機製作所	2,500	1,555.00	3,887,500
オプトラン	2,600	1,791.00	4,656,600
N C ホールディングス	200	1,762.00	352,400
イワキポンプ	1,100	1,927.00	2,119,700
フリー	1,500	1,562.00	2,343,000
ヤマシンフィルタ	3,900	316.00	1,232,400
日阪製作所	1,700	984.00	1,672,800
やまびこ	2,600	1,433.00	3,725,800
野村マイクロ・サイエンス	500	8,450.00	4,225,000
平田機工	800	7,150.00	5,720,000
P E G A S U S	1,800	490.00	882,000
マルマエ	700	1,440.00	1,008,000
タツモ	1,000	2,886.00	2,886,000
ナプテスコ	9,900	2,797.00	27,690,300
三井海洋開発	2,000	1,698.00	3,396,000
レオン自動機	1,800	1,400.00	2,520,000
S M C	4,700	77,300.00	363,310,000
ホソカワミクロン	1,000	4,280.00	4,280,000
ユニオンツール	700	3,635.00	2,544,500
瑞光	1,200	1,388.00	1,665,600
オイレス工業	2,200	1,970.00	4,334,000
日精エー・エス・ビー機械	600	4,855.00	2,913,000
サトーホールディングス	2,300	2,085.00	4,795,500
技研製作所	1,500	1,898.00	2,847,000
日本エアテック	800	1,373.00	1,098,400
カワタ	300	1,068.00	320,400
日精樹脂工業	1,200	1,052.00	1,262,400
オカダアイヨン	300	2,026.00	607,800
ワイエイシイホールディングス	500	2,412.00	1,206,000
小松製作所	74,200	3,647.00	270,607,400
住友重機械工業	9,400	3,561.00	33,473,400

日立建機	6,300	4,038.00	25,439,400
日工	2,400	670.00	1,608,000
巴工業	600	2,761.00	1,656,600
井関農機	1,500	1,111.00	1,666,500
TOWA	1,800	5,400.00	9,720,000
丸山製作所	200	2,082.00	416,400
北川鉄工所	600	1,455.00	873,000
ローツェ	800	12,190.00	9,752,000
タカキタ	300	463.00	138,900
クボタ	83,100	2,137.50	177,626,250
荏原実業	800	2,752.00	2,201,600
三菱化工機	600	2,935.00	1,761,000
月島ホールディングス	2,200	1,332.00	2,930,400
帝国電機製作所	1,100	2,496.00	2,745,600
新東工業	3,200	1,072.00	3,430,400
澁谷工業	1,500	2,532.00	3,798,000
アイチ コーポレーション	2,200	909.00	1,999,800
小森コーポレーション	4,000	1,264.00	5,056,000
鶴見製作所	1,200	3,435.00	4,122,000
酒井重工業	200	5,330.00	1,066,000
荏原製作所	6,500	7,116.00	46,254,000
石井鐵工所	100	2,703.00	270,300
西島製作所	1,400	1,930.00	2,702,000
北越工業	1,600	1,906.00	3,049,600
ダイキン工業	18,900	23,090.00	436,401,000
オルガノ	1,900	5,790.00	11,001,000
トーヨーカネツ	600	3,390.00	2,034,000
栗田工業	8,900	4,860.00	43,254,000
椿本チエイン	2,200	3,795.00	8,349,000
大同工業	400	738.00	295,200
木村化工機	1,300	729.00	947,700
アネスト岩田	2,500	1,158.00	2,895,000
ダイフク	26,700	2,699.00	72,063,300
サムコ	400	4,395.00	1,758,000
加藤製作所	500	1,218.00	609,000
油研工業	200	2,235.00	447,000
タダノ	9,100	1,168.50	10,633,350
フジテック	3,700	3,390.00	12,543,000
C K D	4,400	2,084.00	9,169,600
平和	4,700	2,134.00	10,029,800
理想科学工業	1,300	2,596.00	3,374,800
SANKYO	3,900	6,214.00	24,234,600

日本金銭機械	1,900	1,003.00	1,905,700
マースグループホールディングス	800	2,553.00	2,042,400
フクシマガリレイ	1,000	4,820.00	4,820,000
オーイズミ	400	367.00	146,800
ダイコク電機	800	4,675.00	3,740,000
竹内製作所	2,900	4,580.00	13,282,000
アマノ	4,500	3,179.00	14,305,500
J U K I	2,500	525.00	1,312,500
サンデン	1,400	173.00	242,200
ジャノメ	1,600	731.00	1,169,600
マックス	2,200	2,827.00	6,219,400
グローリー	3,800	2,930.50	11,135,900
新晃工業	1,600	2,332.00	3,731,200
大和冷機工業	2,400	1,368.00	3,283,200
セガサミーホールディングス	14,100	2,433.00	34,305,300
T P R	2,000	1,862.00	3,724,000
ツバキ・ナカシマ	3,200	750.00	2,400,000
ホシザキ	9,300	4,960.00	46,128,000
大豊工業	1,400	864.00	1,209,600
日本精工	29,300	824.30	24,151,990
N T N	34,400	297.20	10,223,680
ジェイテクト	14,100	1,305.50	18,407,550
不二越	1,200	3,950.00	4,740,000
日本トムソン	4,300	565.00	2,429,500
T H K	9,100	2,850.00	25,935,000
ユーシン精機	1,300	672.00	873,600
前澤給装工業	1,200	1,443.00	1,731,600
イーグル工業	1,800	1,663.00	2,993,400
前澤工業	500	941.00	470,500
日本ピラー工業	1,500	4,085.00	6,127,500
キッツ	5,300	1,047.00	5,549,100
マキタ	18,100	3,869.00	70,028,900
三井E & S	7,600	435.00	3,306,000
日立造船	14,000	823.00	11,522,000
三菱重工業	27,700	8,525.00	236,142,500
I H I	11,800	3,002.00	35,423,600
サノヤスホールディングス	1,500	136.00	204,000
スター精密	3,000	1,831.00	5,493,000
日清紡ホールディングス	11,900	1,129.00	13,435,100
イビデン	8,300	7,129.00	59,170,700
コニカミノルタ	35,300	460.40	16,252,120
ブラザー工業	21,100	2,435.50	51,389,050

ミネベアミツミ	27,500	2,750.00	75,625,000
日立製作所	77,000	9,696.00	746,592,000
東芝	12,700	4,602.00	58,445,400
三菱電機	176,200	1,908.00	336,189,600
富士電機	9,600	6,507.00	62,467,200
東洋電機製造	300	937.00	281,100
安川電機	17,200	5,468.00	94,049,600
シンフォニアテクノロジー	1,800	1,634.00	2,941,200
明電舎	2,900	2,435.00	7,061,500
オリジン	200	1,246.00	249,200
山洋電気	700	5,900.00	4,130,000
デンヨー	1,200	2,261.00	2,713,200
P H C ホールディングス	3,000	1,468.00	4,404,000
ソシオネクスト	2,300	14,315.00	32,924,500
東芝テック	2,000	3,260.00	6,520,000
芝浦メカトロニクス	900	7,090.00	6,381,000
マブチモーター	3,900	4,594.00	17,916,600
ニデック	34,900	5,753.00	200,779,700
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,000	419.00	419,000
トレックス・セミコンダクター	800	1,954.00	1,563,200
東光高岳	900	2,131.00	1,917,900
ダブル・スコープ	4,500	920.00	4,140,000
ダイヘン	1,600	5,500.00	8,800,000
ヤーマン	2,800	1,086.00	3,040,800
J V C ケンウッド	12,500	590.00	7,375,000
ミマキエンジニアリング	1,500	769.00	1,153,500
I - P E X	1,100	1,536.00	1,689,600
大崎電気工業	3,400	651.00	2,213,400
オムロン	12,100	5,915.00	71,571,500
日東工業	2,100	3,555.00	7,465,500
I D E C	2,300	2,890.00	6,647,000
正興電機製作所	300	1,077.00	323,100
不二電機工業	200	1,111.00	222,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,200	2,536.00	13,187,200
サクサホールディングス	200	2,251.00	450,200
メルコホールディングス	500	3,505.00	1,752,500
テクノメディカ	400	2,433.00	973,200
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	600	851.00	510,600
日本電気	20,800	7,604.00	158,163,200
富士通	14,600	19,775.00	288,715,000
沖電気工業	7,200	965.00	6,948,000
岩崎通信機	400	759.00	303,600

電気興業	700	2,603.00	1,822,100	
サンケン電気	1,500	7,958.00	11,937,000	
ナカヨ	100	1,225.00	122,500	
アイホン	900	3,045.00	2,740,500	
ルネサスエレクトロニクス	103,300	2,310.00	238,623,000	
セイコーエプソン	20,300	2,153.50	43,716,050	
ワコム	12,100	702.00	8,494,200	
アルバック	3,800	5,622.00	21,363,600	
アクセル	500	1,863.00	931,500	
E I Z O	1,200	4,805.00	5,766,000	
日本信号	3,600	946.00	3,405,600	
京三製作所	3,300	493.00	1,626,900	
能美防災	2,100	1,911.00	4,013,100	
ホーチキ	1,200	1,730.00	2,076,000	
星和電機	400	489.00	195,600	
エレコム	3,800	1,743.00	6,623,400	
パナソニック ホールディングス	187,000	1,392.00	260,304,000	
シャープ	26,600	999.90	26,597,340	
アンリツ	11,100	1,196.00	13,275,600	
富士通ゼネラル	4,500	2,722.00	12,249,000	
ソニーグループ	110,800	13,085.00	1,449,818,000	代用有価証券 35,000株
T D K	25,100	6,050.00	151,855,000	
帝国通信工業	700	1,928.00	1,349,600	
タムラ製作所	6,300	509.00	3,206,700	
アルプスアルパイン	14,100	1,224.50	17,265,450	
池上通信機	200	877.00	175,400	
日本電波工業	1,900	1,234.00	2,344,600	
鈴木	800	1,202.00	961,600	
メイコー	1,600	3,375.00	5,400,000	
日本トリム	300	2,962.00	888,600	
ローランド ディー . ジー .	900	3,385.00	3,046,500	
フォスター電機	1,200	906.00	1,087,200	
S M K	400	2,521.00	1,008,400	
ヨコオ	1,400	1,322.00	1,850,800	
ホシデン	3,600	1,818.00	6,544,800	
ヒロセ電機	2,300	16,735.00	38,490,500	
日本航空電子工業	3,800	3,015.00	11,457,000	
T O A	1,800	1,161.00	2,089,800	
マクセル	3,500	1,662.00	5,817,000	
古野電気	2,100	1,731.00	3,635,100	
スミダコーポレーション	2,100	1,088.00	2,284,800	
アイコム	600	3,585.00	2,151,000	



リオン	600	2,238.00	1,342,800
横河電機	17,300	2,820.00	48,786,000
新電元工業	600	2,947.00	1,768,200
アズビル	10,900	4,810.00	52,429,000
東亜ディーケーケー	400	884.00	353,600
日本光電工業	6,700	3,684.00	24,682,800
チノー	600	2,111.00	1,266,600
共和電業	700	379.00	265,300
日本電子材料	1,000	1,433.00	1,433,000
堀場製作所	3,000	7,989.00	23,967,000
アドバンテスト	44,900	4,271.00	191,767,900
小野測器	300	442.00	132,600
エスペック	1,300	2,288.00	2,974,400
キーエンス	15,700	62,160.00	975,912,000
日置電機	700	6,670.00	4,669,000
シスメックス	13,500	7,566.00	102,141,000
日本マイクロニクス	2,800	2,387.00	6,683,600
メガチップス	1,200	4,005.00	4,806,000
O B A R A G R O U P	900	3,675.00	3,307,500
澤藤電機	100	1,259.00	125,900
原田工業	400	802.00	320,800
コーセル	1,900	1,146.00	2,177,400
イリソ電子工業	1,400	3,880.00	5,432,000
オブテックスグループ	2,900	1,722.00	4,993,800
千代田インテグレ	600	2,864.00	1,718,400
レーザーテック	7,200	27,000.00	194,400,000
スタンレー電気	10,000	2,744.50	27,445,000
ウシオ電機	7,900	1,876.00	14,820,400
岡谷電機産業	600	305.00	183,000
ヘリオス テクノ ホールディング	800	389.00	311,200
エノモト	200	1,519.00	303,800
日本セラミック	1,300	2,834.00	3,684,200
遠藤照明	400	1,180.00	472,000
古河電池	1,100	930.00	1,023,000
双信電機	300	325.00	97,500
山一電機	1,400	1,786.00	2,500,400
図研	1,400	3,955.00	5,537,000
日本電子	3,900	5,025.00	19,597,500
カシオ計算機	11,300	1,226.50	13,859,450
ファナック	76,400	4,016.00	306,822,400
日本シイエムケイ	3,300	672.00	2,217,600
エンプラス	500	10,190.00	5,095,000

大真空	2,300	760.00	1,748,000	
ローム	29,000	2,600.00	75,400,000	
浜松ホトニクス	12,600	6,004.00	75,650,400	
三井ハイテック	1,400	6,894.00	9,651,600	
新光電気工業	5,500	5,345.00	29,397,500	
京セラ	24,300	8,080.00	196,344,000	
太陽誘電	7,600	3,747.00	28,477,200	
村田製作所	142,600	2,883.00	411,115,800	
双葉電子工業	2,900	513.00	1,487,700	
北陸電気工業	300	1,358.00	407,400	
ニチコン	4,100	1,294.00	5,305,400	
日本ケミコン	1,600	1,341.00	2,145,600	
K O A	2,400	1,517.00	3,640,800	
市光工業	2,800	551.00	1,542,800	
小糸製作所	16,900	2,434.50	41,143,050	
ミツバ	2,900	727.00	2,108,300	
S C R E E Nホールディングス	5,400	8,289.00	44,760,600	
キャノン電子	1,700	1,943.00	3,303,100	
キャノン	78,200	3,719.00	290,825,800	代用有価証券 10,000株
リコー	39,300	1,255.50	49,341,150	
象印マホービン	4,300	1,599.00	6,875,700	
M U T O Hホールディングス	100	2,000.00	200,000	
東京エレクトロン	33,200	21,510.00	714,132,000	
イノテック	1,000	1,590.00	1,590,000	
トヨタ紡織	6,600	2,767.50	18,265,500	
芦森工業	200	2,192.00	438,400	
ユニプレス	2,800	1,140.00	3,192,000	
豊田自動織機	13,400	12,045.00	161,403,000	
モリタホールディングス	2,800	1,552.00	4,345,600	
三櫻工業	2,300	913.00	2,099,900	
デンソー	129,300	2,392.00	309,285,600	
東海理化電機製作所	4,400	2,501.00	11,004,400	
川崎重工業	12,800	3,453.00	44,198,400	
名村造船所	3,400	852.00	2,896,800	
日本車輛製造	500	2,161.00	1,080,500	
三菱ロジスネクスト	2,500	1,336.00	3,340,000	
近畿車輛	100	2,035.00	203,500	
日産自動車	222,700	607.00	135,178,900	
いすゞ自動車	45,500	1,745.00	79,397,500	
トヨタ自動車	860,300	2,846.00	2,448,413,800	
日野自動車	23,500	472.60	11,106,100	
三菱自動車工業	61,100	498.00	30,427,800	

エフテック	600	761.00	456,600
レシップホールディングス	300	510.00	153,000
GMB	100	1,800.00	180,000
ファルテック	100	561.00	56,100
武蔵精密工業	3,800	1,570.00	5,966,000
日産車体	1,800	889.00	1,600,200
新明和工業	4,500	1,256.00	5,652,000
極東開発工業	2,600	1,850.00	4,810,000
トピー工業	1,300	2,465.00	3,204,500
ティラド	400	2,222.00	888,800
タチエス	2,900	1,643.00	4,764,700
NOK	6,100	1,851.00	11,291,100
フタバ産業	4,200	792.00	3,326,400
カヤバ	1,500	4,535.00	6,802,500
大同メタル工業	3,000	561.00	1,683,000
プレス工業	6,300	644.00	4,057,200
ミクニ	1,100	443.00	487,300
太平洋工業	3,600	1,436.00	5,169,600
アイシン	12,100	5,548.00	67,130,800
マツダ	51,800	1,500.00	77,700,000
今仙電機製作所	500	593.00	296,500
本田技研工業	382,100	1,621.00	619,384,100
スズキ	28,800	6,105.00	175,824,000
SUBARU	49,600	2,745.00	136,152,000
安永	300	714.00	214,200
ヤマハ発動機	22,600	3,836.00	86,693,600
TBK	900	391.00	351,900
エクセディ	2,600	2,613.00	6,793,800
豊田合成	4,600	3,316.00	15,253,600
愛三工業	2,600	1,304.00	3,390,400
盟和産業	100	987.00	98,700
日本プラスト	700	558.00	390,600
ヨロズ	1,400	914.00	1,279,600
エフ・シー・シー	2,800	1,876.00	5,252,800
シマノ	6,400	22,475.00	143,840,000
テイ・エス テック	5,600	1,754.50	9,825,200
ジャムコ	600	1,540.00	924,000
テルモ	43,800	4,283.00	187,595,400
クリエートメディック	300	889.00	266,700
日機装	3,600	973.00	3,502,800
日本エム・ディ・エム	1,200	656.00	787,200
島津製作所	20,800	3,802.00	79,081,600

JMS	1,500	535.00	802,500
長野計器	1,100	2,431.00	2,674,100
ブイ・テクノロジー	800	1,950.00	1,560,000
東京計器	1,200	1,549.00	1,858,800
愛知時計電機	700	2,266.00	1,586,200
インターアクション	800	1,024.00	819,200
オーバル	800	431.00	344,800
東京精密	3,200	8,192.00	26,214,400
マニー	6,300	2,131.00	13,425,300
ニコン	22,600	1,498.50	33,866,100
トプコン	7,600	1,509.00	11,468,400
オリンパス	96,500	2,073.50	200,092,750
理研計器	1,100	6,340.00	6,974,000
タムロン	1,000	4,195.00	4,195,000
HOYA	31,100	15,695.00	488,114,500
シード	400	763.00	305,200
ノーリツ鋼機	1,500	3,245.00	4,867,500
A & Dホロンホールディングス	2,300	1,591.00	3,659,300
朝日インテック	17,500	2,659.00	46,532,500
シチズン時計	14,400	891.00	12,830,400
リズム	200	2,608.00	521,600
大研医器	800	537.00	429,600
メニコン	5,400	1,839.00	9,930,600
シンシア	100	516.00	51,600
松風	700	2,457.00	1,719,900
セイコーグループ	2,200	2,349.00	5,167,800
ニプロ	13,100	1,143.50	14,979,850
KYORITSU	1,300	171.00	222,300
中本パックス	300	1,661.00	498,300
スノーピーク	2,200	1,030.00	2,266,000
パラマウントベッドホールディングス	3,300	2,535.00	8,365,500
トランザクション	1,000	2,049.00	2,049,000
粧美堂	200	485.00	97,000
ニホンフラッシュ	1,500	886.00	1,329,000
前田工織	1,300	2,944.00	3,827,200
永大産業	1,000	216.00	216,000
アートネイチャー	1,400	801.00	1,121,400
バンダイナムコホールディングス	42,900	3,251.00	139,467,900
アイフィスジャパン	200	593.00	118,600
SHOEI	3,500	2,108.00	7,378,000
フランスベッドホールディングス	2,000	1,224.00	2,448,000
パイロットコーポレーション	2,200	5,319.00	11,701,800

萩原工業	1,000	1,594.00	1,594,000
フジシールインターナショナル	3,200	1,644.00	5,260,800
タカラトミー	7,100	2,078.00	14,753,800
広済堂ホールディングス	700	3,000.00	2,100,000
エステールホールディングス	200	630.00	126,000
タカノ	300	822.00	246,600
プロネクサス	1,600	1,214.00	1,942,400
ホクシン	600	120.00	72,000
ウッドワン	300	1,046.00	313,800
大建工業	500	2,992.00	1,496,000
TOPPANホールディングス	19,300	3,484.00	67,241,200
大日本印刷	17,100	4,043.00	69,135,300
共同印刷	400	3,430.00	1,372,000
NISSHA	2,700	1,588.00	4,287,600
光村印刷	100	1,252.00	125,200
TAKARA & COMPANY	1,000	2,406.00	2,406,000
アシックス	13,400	5,074.00	67,991,600
ツツミ	400	2,304.00	921,600
ローランド	1,200	4,355.00	5,226,000
小松ウオール工業	600	2,958.00	1,774,800
ヤマハ	9,900	3,762.00	37,243,800
河合楽器製作所	500	3,835.00	1,917,500
クリナップ	1,500	694.00	1,041,000
ピジョン	10,000	1,638.00	16,380,000
キングジム	1,400	874.00	1,223,600
リンテック	3,100	2,581.00	8,001,100
イトーキ	3,200	1,459.00	4,668,800
任天堂	98,900	6,432.00	636,124,800
三菱鉛筆	2,200	1,868.00	4,109,600
タカラスタンダード	3,300	1,747.00	5,765,100
コクヨ	6,400	2,401.50	15,369,600
ナカバヤシ	1,700	519.00	882,300
グローブライド	1,400	1,948.00	2,727,200
オカムラ	4,700	2,234.00	10,499,800
美津濃	1,600	4,495.00	7,192,000
東京電力ホールディングス	141,300	690.60	97,581,780
中部電力	57,800	1,938.00	112,016,400
関西電力	60,500	2,014.50	121,877,250
中国電力	27,200	1,129.00	30,708,800
北陸電力	16,000	863.80	13,820,800
東北電力	41,300	995.30	41,105,890
四国電力	14,600	1,136.00	16,585,600

九州電力	36,100	1,090.00	39,349,000
北海道電力	15,100	693.00	10,464,300
沖縄電力	4,000	1,136.00	4,544,000
電源開発	12,900	2,307.50	29,766,750
エフオン	1,100	481.00	529,100
イーレックス	2,800	764.00	2,139,200
レノバ	4,200	1,159.00	4,867,800
東京瓦斯	33,200	3,538.00	117,461,600
大阪瓦斯	31,700	2,877.00	91,200,900
東邦瓦斯	6,800	2,832.00	19,257,600
北海道瓦斯	900	2,389.00	2,150,100
広島ガス	3,400	391.00	1,329,400
西部ガスホールディングス	1,600	1,973.00	3,156,800
静岡ガス	3,100	1,018.00	3,155,800
メタウォーター	1,900	2,103.00	3,995,700
SBSホールディングス	1,400	2,715.00	3,801,000
東武鉄道	17,200	3,910.00	67,252,000
相鉄ホールディングス	5,600	2,711.50	15,184,400
東急	43,900	1,743.50	76,539,650
京浜急行電鉄	19,400	1,308.50	25,384,900
小田急電鉄	25,900	2,277.50	58,987,250
京王電鉄	7,500	4,656.00	34,920,000
京成電鉄	10,100	6,329.00	63,922,900
富士急行	1,900	4,385.00	8,331,500
東日本旅客鉄道	28,800	8,072.00	232,473,600
西日本旅客鉄道	18,600	6,066.00	112,827,600
東海旅客鉄道	60,400	3,467.00	209,406,800
西武ホールディングス	18,900	1,500.00	28,350,000
鴻池運輸	2,700	1,993.00	5,381,100
西日本鉄道	4,200	2,436.00	10,231,200
ハマキョウレックス	1,300	3,970.00	5,161,000
サカイ引越センター	1,800	2,571.00	4,627,800
近鉄グループホールディングス	15,600	4,276.00	66,705,600
阪急阪神ホールディングス	20,900	4,910.00	102,619,000
南海電気鉄道	7,000	3,012.00	21,084,000
京阪ホールディングス	8,600	3,756.00	32,301,600
神戸電鉄	400	2,871.00	1,148,400
名古屋鉄道	16,100	2,144.50	34,526,450
山陽電気鉄道	1,200	2,124.00	2,548,800
アルプス物流	1,200	1,606.00	1,927,200
ヤマトホールディングス	20,000	2,531.00	50,620,000
山九	4,000	4,836.00	19,344,000

丸運	500	253.00	126,500
丸全昭和運輸	1,000	3,855.00	3,855,000
センコーグループホールディングス	8,300	1,052.00	8,731,600
トナミホールディングス	300	4,620.00	1,386,000
ニッコンホールディングス	5,000	3,242.00	16,210,000
日本石油輸送	100	2,884.00	288,400
福山通運	1,800	4,090.00	7,362,000
セイノーホールディングス	8,800	2,190.00	19,272,000
エスライングループ本社	300	876.00	262,800
神奈川中央交通	400	3,095.00	1,238,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	3,800	2,079.00	7,900,200
C & F ロジホールディングス	1,500	1,451.00	2,176,500
九州旅客鉄道	11,100	3,128.00	34,720,800
S Gホールディングス	26,300	2,121.50	55,795,450
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	5,300	7,676.00	40,682,800
日本郵船	44,900	3,594.00	161,370,600
商船三井	34,000	3,809.00	129,506,000
川崎汽船	13,200	4,760.00	62,832,000
N Sユナイテッド海運	900	4,530.00	4,077,000
飯野海運	5,900	1,155.00	6,814,500
乾汽船	1,900	1,207.00	2,293,300
日本航空	38,400	2,789.50	107,116,800
A N Aホールディングス	42,600	3,033.00	129,205,800
パスコ	100	1,624.00	162,400
トランコム	500	7,120.00	3,560,000
日新	1,200	2,607.00	3,128,400
三菱倉庫	3,800	4,240.00	16,112,000
三井倉庫ホールディングス	1,500	4,375.00	6,562,500
住友倉庫	4,200	2,382.00	10,004,400
澁澤倉庫	700	2,973.00	2,081,100
東陽倉庫	200	1,458.00	291,600
日本トランスシティ	3,100	669.00	2,073,900
ケイヒン	100	1,784.00	178,400
中央倉庫	800	1,075.00	860,000
川西倉庫	100	1,036.00	103,600
安田倉庫	1,100	1,107.00	1,217,700
ファイズホールディングス	100	1,040.00	104,000
東洋埠頭	200	1,379.00	275,800
上組	7,500	3,071.00	23,032,500
サンリツ	200	741.00	148,200
キムラユニティー	400	1,326.00	530,400
キューソー流通システム	600	966.00	579,600

東海運	500	282.00	141,000
エーアイティー	1,000	1,656.00	1,656,000
内外トランスライン	600	2,443.00	1,465,800
日本コンセプト	600	1,800.00	1,080,000
N E C ネットズエスアイ	6,100	2,143.00	13,072,300
クロスキャット	1,000	1,069.00	1,069,000
システナ	23,900	258.00	6,166,200
デジタルアーツ	1,000	4,420.00	4,420,000
日鉄ソリューションズ	2,700	4,500.00	12,150,000
キューブシステム	800	1,123.00	898,400
コア	700	1,733.00	1,213,100
手間いらず	300	2,574.00	772,200
ラクーンホールディングス	1,300	720.00	936,000
ソリトンシステムズ	800	1,127.00	901,600
ソフトクリエイイトホールディングス	1,300	1,732.00	2,251,600
T I S	17,200	3,013.00	51,823,600
テクミラホールディングス	400	429.00	171,600
グリー	4,200	565.00	2,373,000
G M O ペパボ	200	1,269.00	253,800
コーエーテクモホールディングス	9,800	1,966.00	19,266,800
三菱総合研究所	800	4,680.00	3,744,000
ボルテージ	300	261.00	78,300
電算	100	1,526.00	152,600
A G S	400	708.00	283,200
ファインデックス	1,300	866.00	1,125,800
K L a b	3,000	269.00	807,000
ポルトトゥウィンホールディングス	2,700	473.00	1,277,100
ネクソン	35,100	2,833.50	99,455,850
アイスタイル	4,600	460.00	2,116,000
エムアップホールディングス	1,900	1,230.00	2,337,000
エイチーム	1,000	629.00	629,000
エニグモ	2,100	352.00	739,200
テクノスジャパン	800	641.00	512,800
e n i s h	900	165.00	148,500
コロブラ	6,100	587.00	3,580,700
ブロードリーフ	7,500	546.00	4,095,000
クロス・マーケティンググループ	600	699.00	419,400
デジタルハーツホールディングス	1,000	945.00	945,000
システム情報	1,300	929.00	1,207,700
メディアドゥ	700	1,426.00	998,200
じげん	4,600	513.00	2,359,800
バイキューブ	2,000	384.00	768,000



エンカレッジ・テクノロジー	200	491.00	98,200
サイバーリンクス	300	728.00	218,400
フィックスターズ	1,800	1,080.00	1,944,000
CARTA HOLDINGS	700	1,233.00	863,100
オブティム	1,600	865.00	1,384,000
セレス	700	954.00	667,800
SHIFT	1,000	30,150.00	30,150,000
ティーガイア	1,700	1,762.00	2,995,400
セック	200	3,715.00	743,000
テクマトリックス	2,900	1,663.00	4,822,700
プロシップ	800	1,305.00	1,044,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,100	2,284.50	9,366,450
GMOペイメントゲートウェイ	3,100	7,275.00	22,552,500
ザッパラス	200	439.00	87,800
システムリサーチ	500	3,430.00	1,715,000
インターネットイニシアティブ	7,500	2,619.50	19,646,250
さくらインターネット	1,800	1,121.00	2,017,800
ヴィンクス	200	1,208.00	241,600
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	2,676.00	1,338,000
SRAホールディングス	800	3,395.00	2,716,000
システムインテグレータ	300	399.00	119,700
朝日ネット	1,700	618.00	1,050,600
eBASE	2,200	742.00	1,632,400
アバントグループ	2,000	1,386.00	2,772,000
アドソル日進	700	1,629.00	1,140,300
ODKソリューションズ	200	550.00	110,000
フリービット	800	1,091.00	872,800
コムチュア	2,300	2,094.00	4,816,200
サイバーコム	200	1,108.00	221,600
アステリア	1,300	705.00	916,500
アイル	700	3,735.00	2,614,500
マークラインズ	800	2,944.00	2,355,200
メディカル・データ・ビジョン	1,900	737.00	1,400,300
gumi	2,300	431.00	991,300
ショーケース	200	305.00	61,000
モバイルファクトリー	200	717.00	143,400
テラスカイ	700	1,604.00	1,122,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	900	1,636.00	1,472,400
PCIホールディングス	400	1,060.00	424,000
アイビーシー	100	530.00	53,000
ネオジャパン	600	995.00	597,000
PR TIMES	300	1,688.00	506,400

ラクス	7,400	2,180.50	16,135,700
ランドコンピュータ	500	649.00	324,500
ダブルスタンダード	500	1,442.00	721,000
オープンドア	1,000	833.00	833,000
マイネット	300	317.00	95,100
アカツキ	800	2,102.00	1,681,600
ベネフィットジャパン	100	1,104.00	110,400
U b i c o mホールディングス	500	1,244.00	622,000
カナミックネットワーク	1,800	480.00	864,000
ノムラシステムコーポレーション	1,000	108.00	108,000
チェンジホールディングス	3,400	1,602.00	5,446,800
シンクロ・フード	600	589.00	353,400
オークネット	600	1,813.00	1,087,800
キャピタル・アセット・プランニング	200	774.00	154,800
エイトレッド	100	1,321.00	132,100
マクロミル	3,100	689.00	2,135,900
ビーグリー	200	1,091.00	218,200
オロ	600	2,115.00	1,269,000
ユーザーローカル	600	1,683.00	1,009,800
テモナ	200	244.00	48,800
マネーフォワード	3,500	4,248.00	14,868,000
サインポスト	400	483.00	193,200
Sun Asterisk	1,100	1,369.00	1,505,900
プラスアルファ・コンサルティング	900	2,695.00	2,425,500
電算システムホールディングス	700	2,853.00	1,997,100
A p p i e r Group	5,400	1,488.00	8,035,200
ソルクシーズ	700	412.00	288,400
フェイス	300	494.00	148,200
プロトコーポレーション	1,700	1,310.00	2,227,000
ハイマックス	500	1,353.00	676,500
野村総合研究所	34,800	4,204.00	146,299,200
サイバネットシステム	1,100	812.00	893,200
C Eホールディングス	500	543.00	271,500
日本システム技術	500	2,246.00	1,123,000
インテージホールディングス	1,800	1,753.00	3,155,400
東邦システムサイエンス	500	1,163.00	581,500
ソースネクスト	7,300	181.00	1,321,300
インフォコム	2,000	2,582.00	5,164,000
シンプレクス・ホールディングス	2,400	2,505.00	6,012,000
H E R O Z	600	1,401.00	840,600
ラクスル	3,800	1,381.00	5,247,800
メルカリ	9,500	3,294.00	31,293,000

I P S	400	2,626.00	1,050,400
F I G	1,100	336.00	369,600
システムサポート	600	2,045.00	1,227,000
イーソル	1,200	716.00	859,200
東海ソフト	100	1,130.00	113,000
ウイングアーク1st	1,600	2,909.00	4,654,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	500	1,283.00	641,500
サーバーワークス	300	3,455.00	1,036,500
東名	100	1,755.00	175,500
ヴィッツ	100	976.00	97,600
トピラシステムズ	300	859.00	257,700
S a n s a n	5,200	1,356.00	7,051,200
L i n k - U	200	771.00	154,200
ギフトィ	1,400	1,423.00	1,992,200
メドレー	2,100	4,855.00	10,195,500
ベース	500	4,390.00	2,195,000
J M D C	2,700	5,063.00	13,670,100
フォーカスシステムズ	1,100	996.00	1,095,600
クレスコ	1,300	1,717.00	2,232,100
フジ・メディア・ホールディングス	15,100	1,531.00	23,118,100
オービック	5,300	22,735.00	120,495,500
ジャストシステム	2,300	2,824.00	6,495,200
T D C ソフト	1,500	1,680.00	2,520,000
L I N E ヤフー	223,700	410.00	91,717,000
トレンドマイクロ	7,400	5,845.00	43,253,000
I D ホールディングス	1,100	1,520.00	1,672,000
日本オラクル	3,000	10,920.00	32,760,000
アルファシステムズ	400	2,860.00	1,144,000
フューチャー	3,400	1,743.00	5,926,200
C A C H o l d i n g s	800	1,771.00	1,416,800
S B テクノロジー	700	2,368.00	1,657,600
トーセ	300	701.00	210,300
オービックビジネスコンサルタント	2,200	6,644.00	14,616,800
伊藤忠テクノソリューションズ	4,200	4,324.00	18,160,800
アイティフォー	2,000	1,098.00	2,196,000
東計電算	200	6,240.00	1,248,000
エクスネット	100	1,066.00	106,600
大塚商会	7,800	6,055.00	47,229,000
サイボウズ	2,200	2,040.00	4,488,000
電通国際情報サービス	1,900	4,505.00	8,559,500
A C C E S S	1,700	780.00	1,326,000
デジタルガレージ	2,500	3,015.00	7,537,500

EMシステムズ	2,600	753.00	1,957,800
ウェザーニューズ	500	5,990.00	2,995,000
C I J	2,600	603.00	1,567,800
ビジネスエンジニアリング	300	3,470.00	1,041,000
日本エンタープライズ	900	120.00	108,000
WOWOW	1,200	1,069.00	1,282,800
スカラ	1,500	765.00	1,147,500
インテリジェント ウェイブ	500	893.00	446,500
ANYCOLOR	600	3,710.00	2,226,000
IMAGICA GROUP	1,600	604.00	966,400
ネットワンシステムズ	6,300	2,272.00	14,313,600
システムソフト	5,800	68.00	394,400
アルゴグラフィックス	1,500	3,500.00	5,250,000
マーベラス	2,500	685.00	1,712,500
エイベックス	2,700	1,405.00	3,793,500
B I P R O G Y	5,100	4,138.00	21,103,800
都築電気	800	2,243.00	1,794,400
T B Sホールディングス	8,000	2,684.00	21,472,000
日本テレビホールディングス	13,900	1,506.50	20,940,350
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	1,655.00	6,289,000
スカパーJ S A Tホールディングス	12,200	711.00	8,674,200
テレビ東京ホールディングス	1,100	2,983.00	3,281,300
日本BS放送	300	898.00	269,400
ビジョン	2,400	1,407.00	3,376,800
スマートバリュー	200	364.00	72,800
USEN-NEXT HOLDINGS	1,800	3,560.00	6,408,000
日本通信	15,600	213.00	3,322,800
クロップス	100	957.00	95,700
日本電信電話	4,674,700	176.90	826,954,430
K D D I	121,400	4,675.00	567,545,000
ソフトバンク	252,900	1,699.50	429,803,550
光通信	1,600	21,740.00	34,784,000
エムティーアイ	1,100	612.00	673,200
GMOインターネットグループ	5,800	2,305.50	13,371,900
ファイバーゲート	700	1,150.00	805,000
アйдママーケティングコミュニケーション	300	230.00	69,000
K A D O K A W A	8,300	2,864.00	23,771,200
学研ホールディングス	2,600	861.00	2,238,600
ゼンリン	2,700	921.00	2,486,700
昭文社ホールディングス	400	364.00	145,600
インプレスホールディングス	900	174.00	156,600

アイネット	1,000	1,758.00	1,758,000
松竹	800	10,000.00	8,000,000
東宝	8,700	5,271.00	45,857,700
東映	500	18,620.00	9,310,000
N T Tデータグループ	41,100	1,908.50	78,439,350
ピー・シー・エー	900	1,181.00	1,062,900
ビジネスブレイン太田昭和	600	2,082.00	1,249,200
D T S	3,300	3,245.00	10,708,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,200	5,128.00	36,921,600
シーイーシー	2,000	1,594.00	3,188,000
カプコン	14,100	5,099.00	71,895,900
アイ・エス・ピー	800	1,450.00	1,160,000
ジャステック	1,000	1,534.00	1,534,000
S C S K	11,000	2,739.00	30,129,000
N S W	700	2,796.00	1,957,200
アイネス	1,200	1,606.00	1,927,200
T K C	2,500	3,615.00	9,037,500
富士ソフト	3,200	5,510.00	17,632,000
N S D	5,600	2,703.00	15,136,800
コナミグループ	5,900	8,022.00	47,329,800
福井コンピュータホールディングス	1,000	2,684.00	2,684,000
J B C Cホールディングス	1,100	3,000.00	3,300,000
ミロク情報サービス	1,400	1,501.00	2,101,400
ソフトバンクグループ	77,500	6,409.00	496,697,500
高千穂交易	500	3,395.00	1,697,500
オルパヘルスケアホールディングス	200	1,795.00	359,000
伊藤忠食品	400	6,840.00	2,736,000
エレマテック	1,500	1,715.00	2,572,500
あらた	1,300	5,530.00	7,189,000
トーマンデバイス	300	4,995.00	1,498,500
東京エレクトロン デバイス	1,700	4,090.00	6,953,000
円谷フィールズホールディングス	2,900	1,683.00	4,880,700
双日	18,500	3,173.00	58,700,500
アルフレッサ ホールディングス	16,700	2,450.00	40,915,000
横浜冷凍	4,600	1,180.00	5,428,000
神栄	200	1,773.00	354,600
ラサ商事	600	1,719.00	1,031,400
アルコニックス	2,200	1,373.00	3,020,600
神戸物産	12,800	3,848.00	49,254,400
ハイパー	300	299.00	89,700
あい ホールディングス	2,700	2,428.00	6,555,600
ディーブイエックス	300	1,036.00	310,800

ダイワボウホールディングス	7,400	2,953.00	21,852,200
マクニカホールディングス	3,900	6,618.00	25,810,200
ラクト・ジャパン	700	2,001.00	1,400,700
グリムス	700	2,080.00	1,456,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,500	1,076.00	2,690,000
八洲電機	1,400	1,278.00	1,789,200
メディアスホールディングス	1,200	804.00	964,800
レスターホールディングス	1,400	2,538.00	3,553,200
ジオリーブグループ	200	1,179.00	235,800
大光	400	673.00	269,200
OCHIホールディングス	200	1,390.00	278,000
TOKAIホールディングス	9,000	984.00	8,856,000
黒谷	300	589.00	176,700
Cominix	200	760.00	152,000
三洋貿易	1,900	1,361.00	2,585,900
ビューティガレージ	600	2,387.00	1,432,200
ウイン・パートナーズ	1,100	1,185.00	1,303,500
ミタチ産業	300	1,044.00	313,200
シップヘルスケアホールディングス	6,000	2,352.50	14,115,000
明治電機工業	700	1,423.00	996,100
デリカフーズホールディングス	500	614.00	307,000
スターティアホールディングス	300	1,284.00	385,200
コメダホールディングス	4,100	2,753.00	11,287,300
ピーバンドットコム	200	381.00	76,200
アセンテック	700	527.00	368,900
富士興産	300	1,884.00	565,200
協栄産業	100	2,333.00	233,300
フルサト・マルカホールディングス	1,500	2,857.00	4,285,500
ヤマエグループホールディングス	1,000	3,760.00	3,760,000
小野建	1,700	1,689.00	2,871,300
南陽	200	2,038.00	407,600
佐島電機	800	1,899.00	1,519,200
エコートレーディング	200	1,461.00	292,200
伯東	1,000	5,190.00	5,190,000
コンドーテック	1,300	1,159.00	1,506,700
中山福	600	349.00	209,400
ナガイレーベン	2,100	2,149.00	4,512,900
三菱食品	1,600	4,405.00	7,048,000
松田産業	1,300	2,605.00	3,386,500
第一興商	6,400	2,271.00	14,534,400
メディバルホールディングス	17,200	2,540.00	43,688,000
SPK	800	1,799.00	1,439,200

萩原電気ホールディングス	700	4,605.00	3,223,500
アズワン	2,600	5,005.00	13,013,000
スズデン	600	2,173.00	1,303,800
シモジマ	1,200	1,183.00	1,419,600
ドウシシャ	1,600	2,108.00	3,372,800
小津産業	200	1,566.00	313,200
高速	1,000	2,049.00	2,049,000
たけびし	700	1,847.00	1,292,900
リックス	300	3,305.00	991,500
丸文	1,500	1,255.00	1,882,500
ハピネット	1,400	2,492.00	3,488,800
橋本総業ホールディングス	700	1,229.00	860,300
日本ライフライン	4,900	1,108.00	5,429,200
タカショー	1,500	602.00	903,000
I D O M	4,500	858.00	3,861,000
進和	1,000	2,445.00	2,445,000
エスケイジャパン	300	784.00	235,200
ダイترون	700	2,877.00	2,013,900
シークス	2,400	1,454.00	3,489,600
田中商事	300	668.00	200,400
オーハシテクニカ	900	1,769.00	1,592,100
白銅	500	2,196.00	1,098,000
ダイコー通産	100	1,106.00	110,600
伊藤忠商事	109,300	5,692.00	622,135,600
丸紅	138,300	2,336.00	323,068,800
高島	700	921.00	644,700
長瀬産業	7,600	2,274.00	17,282,400
蝶理	1,100	3,040.00	3,344,000
豊田通商	14,500	8,960.00	129,920,000
三共生興	2,300	745.00	1,713,500
兼松	6,900	2,028.00	13,993,200
ツカモトコーポレーション	200	1,156.00	231,200
三井物産	124,900	5,754.00	718,674,600
日本紙パルプ商事	800	4,800.00	3,840,000
カメイ	1,800	1,568.00	2,822,400
東都水産	100	6,900.00	690,000
O U Gホールディングス	200	2,404.00	480,800
スターゼン	1,200	2,580.00	3,096,000
山善	5,100	1,214.00	6,191,400
椿本興業	400	5,440.00	2,176,000
住友商事	100,400	3,199.00	321,179,600
内田洋行	700	6,850.00	4,795,000

三菱商事	109,500	6,998.00	766,281,000
第一実業	1,600	2,026.00	3,241,600
キヤノンマーケティングジャパン	3,900	3,722.00	14,515,800
西華産業	700	2,210.00	1,547,000
佐藤商事	1,200	1,500.00	1,800,000
菱洋エレクトロ	1,600	3,555.00	5,688,000
東京産業	1,600	846.00	1,353,600
ユアサ商事	1,300	4,140.00	5,382,000
神鋼商事	400	5,460.00	2,184,000
トルク	700	266.00	186,200
阪和興業	3,000	4,505.00	13,515,000
正栄食品工業	1,100	4,355.00	4,790,500
カナデン	1,300	1,513.00	1,966,900
R Y O D E N	1,400	2,495.00	3,493,000
岩谷産業	3,800	7,313.00	27,789,400
ナイス	300	1,432.00	429,600
ニチモウ	200	3,965.00	793,000
極東貿易	1,000	1,821.00	1,821,000
アステナホールディングス	3,200	526.00	1,683,200
三愛オブリ	4,000	1,600.00	6,400,000
稲畑産業	3,300	3,175.00	10,477,500
G S I クレオス	900	2,077.00	1,869,300
明和産業	2,000	654.00	1,308,000
クワザワホールディングス	400	539.00	215,600
ワキタ	2,800	1,516.00	4,244,800
東邦ホールディングス	4,600	3,461.00	15,920,600
サンゲツ	3,800	2,856.00	10,852,800
ミツウロコグループホールディングス	2,200	1,372.00	3,018,400
シナネンホールディングス	500	4,040.00	2,020,000
伊藤忠エネクス	4,200	1,545.00	6,489,000
サンリオ	4,700	7,187.00	33,778,900
サンワテクノス	900	2,259.00	2,033,100
リョーサン	1,200	4,645.00	5,574,000
新光商事	2,300	1,144.00	2,631,200
トーヨー	700	3,070.00	2,149,000
三信電気	700	2,303.00	1,612,100
東陽テクニカ	1,700	1,328.00	2,257,600
モスフードサービス	2,500	3,285.00	8,212,500
加賀電子	1,500	6,200.00	9,300,000
ソーダニッカ	1,300	1,066.00	1,385,800
立花エレテック	1,100	2,773.00	3,050,300
フォーバル	700	1,161.00	812,700



PAL TAC	2,200	5,021.00	11,046,200
三谷産業	3,000	332.00	996,000
太平洋興発	400	774.00	309,600
西本Wismettacホールディングス	400	6,090.00	2,436,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	2,053.00	205,300
コア商事ホールディングス	1,000	734.00	734,000
KPPグループホールディングス	4,400	660.00	2,904,000
ヤマタネ	800	2,192.00	1,753,600
丸紅建材リース	100	2,545.00	254,500
泉州電業	900	3,160.00	2,844,000
トラスコ中山	3,500	2,229.00	7,801,500
オートバックスセブン	5,800	1,508.00	8,746,400
モリト	1,200	1,329.00	1,594,800
加藤産業	2,100	4,360.00	9,156,000
北恵	300	999.00	299,700
イエローハット	2,700	1,731.00	4,673,700
JKホールディングス	1,300	957.00	1,244,100
日伝	1,200	2,732.00	3,278,400
北沢産業	700	268.00	187,600
杉本商事	800	2,191.00	1,752,800
因幡電機産業	4,300	3,260.00	14,018,000
東テク	600	5,000.00	3,000,000
ミスミグループ本社	25,000	2,500.50	62,512,500
アルテック	600	244.00	146,400
タキヒヨー	300	1,013.00	303,900
蔵王産業	200	2,427.00	485,400
スズケン	6,300	4,544.00	28,627,200
ジェコス	1,000	956.00	956,000
グローセル	1,900	453.00	860,700
ローソン	3,500	7,049.00	24,671,500
サンエー	1,300	4,550.00	5,915,000
カワチ薬品	1,300	2,401.00	3,121,300
エービーシー・マート	7,300	2,460.00	17,958,000
ハードオフコーポレーション	600	1,429.00	857,400
アスクル	3,400	2,042.00	6,942,800
ゲオホールディングス	1,900	2,389.00	4,539,100
アダストリア	2,000	3,210.00	6,420,000
ジーフット	900	279.00	251,100
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	709.00	141,800
くら寿司	2,000	3,615.00	7,230,000
キャンドゥ	600	2,515.00	1,509,000
IKホールディングス	400	354.00	141,600

パルグループホールディングス	3,300	1,995.00	6,583,500
エディオン	6,600	1,549.00	10,223,400
サーラコーポレーション	3,500	750.00	2,625,000
ワッツ	500	552.00	276,000
ハローズ	800	4,295.00	3,436,000
フジオフードグループ本社	1,900	1,416.00	2,690,400
あみやき亭	400	3,720.00	1,488,000
ひらまつ	2,400	249.00	597,600
大黒天物産	500	6,130.00	3,065,000
ハニーズホールディングス	1,300	1,515.00	1,969,500
ファーマライズホールディングス	200	649.00	129,800
アルペン	1,400	1,958.00	2,741,200
ハブ	300	736.00	220,800
クオールホールディングス	2,300	1,549.00	3,562,700
ジinzホールディングス	1,000	4,115.00	4,115,000
ビックカメラ	8,800	1,156.00	10,172,800
D C Mホールディングス	8,800	1,180.00	10,384,000
ペッパーフードサービス	4,100	112.00	459,200
MonotaRO	23,500	1,455.00	34,192,500
東京一番フーズ	300	503.00	150,900
J.フロント リテイリング	19,000	1,458.00	27,702,000
ドトール・日レスホールディングス	3,000	2,186.00	6,558,000
マツキヨココカラ&カンパニー	30,200	2,625.50	79,290,100
ブロンコビリー	1,000	3,090.00	3,090,000
Z O Z O	11,000	3,024.00	33,264,000
トレジャー・ファクトリー	800	1,201.00	960,800
物語コーポレーション	2,800	4,065.00	11,382,000
三越伊勢丹ホールディングス	27,900	1,690.00	47,151,000
Hamee	600	964.00	578,400
マーケットエンタープライズ	100	1,399.00	139,900
ウエルシアホールディングス	8,600	2,456.00	21,121,600
クリエイトSDホールディングス	2,700	3,205.00	8,653,500
丸善CHIホールディングス	1,200	330.00	396,000
ミサワ	200	627.00	125,400
ティーライフ	100	1,363.00	136,300
チムニー	300	1,417.00	425,100
シュッピン	1,500	1,059.00	1,588,500
オイシックス・ラ・大地	2,300	1,272.00	2,925,600
ネクステージ	3,800	2,165.00	8,227,000
ジョイフル本田	4,800	1,770.00	8,496,000
鳥貴族ホールディングス	600	3,010.00	1,806,000
ホットランド	1,300	2,001.00	2,601,300

すかいらーくホールディングス	22,700	2,308.50	52,402,950
SFPホールディングス	900	2,282.00	2,053,800
綿半ホールディングス	1,300	1,352.00	1,757,600
ヨシックスホールディングス	300	2,857.00	857,100
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,700	1,041.00	4,892,700
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	713.00	570,400
BEENOS	700	1,527.00	1,068,900
あさひ	1,500	1,285.00	1,927,500
日本調剤	1,100	1,265.00	1,391,500
コスモス薬品	1,600	15,595.00	24,952,000
トーエル	400	696.00	278,400
セブン&アイ・ホールディングス	57,200	5,620.00	321,464,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	11,200	1,032.00	11,558,400
ツルハホールディングス	3,500	10,845.00	37,957,500
サンマルクホールディングス	1,300	1,928.00	2,506,400
フェリシモ	200	915.00	183,000
トリドールホールディングス	4,600	3,688.00	16,964,800
TOKYO BASE	2,200	306.00	673,200
ウイルプラスホールディングス	200	1,219.00	243,800
JMホールディングス	1,300	2,006.00	2,607,800
サツドラホールディングス	500	774.00	387,000
アレンザホールディングス	1,300	1,006.00	1,307,800
串カツ田中ホールディングス	500	1,711.00	855,500
パロックジャパンリミテッド	1,300	792.00	1,029,600
クスリのアオキホールディングス	1,500	9,720.00	14,580,000
力の源ホールディングス	800	1,920.00	1,536,000
FOOD & LIFE COMPANIE	8,900	2,629.00	23,398,100
メディカルシステムネットワーク	1,900	469.00	891,100
一家ホールディングス	300	667.00	200,100
ジャパングラフトホールディングス	600	185.00	111,000
はるやまホールディングス	500	533.00	266,500
ノジマ	4,900	1,417.00	6,943,300
カップ・クリエイト	2,600	1,583.00	4,115,800
ライトオン	700	432.00	302,400
良品計画	18,100	2,179.00	39,439,900
パリミキホールディングス	1,300	378.00	491,400
アドヴァングループ	1,600	1,052.00	1,683,200
アルビス	600	2,558.00	1,534,800
コナカ	1,100	391.00	430,100
ハウス オブ ローゼ	100	1,596.00	159,600
G-7ホールディングス	1,800	1,164.00	2,095,200

イオン北海道	5,000	885.00	4,425,000
コジマ	2,800	645.00	1,806,000
ヒマラヤ	300	918.00	275,400
コーナン商事	2,000	3,880.00	7,760,000
エコス	600	2,160.00	1,296,000
ワタミ	1,800	1,142.00	2,055,600
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	33,500	3,056.00	102,376,000
西松屋チェーン	3,300	1,886.00	6,223,800
ゼンショーホールディングス	8,200	8,089.00	66,329,800
ハークスレイ	300	697.00	209,100
サイゼリヤ	2,500	5,880.00	14,700,000
V Tホールディングス	6,400	510.00	3,264,000
魚力	600	2,206.00	1,323,600
フジ・コーポレーション	800	1,723.00	1,378,400
ユナイテッドアローズ	2,000	1,917.00	3,834,000
ハイデイ日高	2,500	2,746.00	6,865,000
Y U - W A C r e a t i o n H o l d i n g s	600	156.00	93,600
コロワイド	7,100	2,384.00	16,926,400
壱番屋	1,300	5,420.00	7,046,000
P L A N T	200	1,246.00	249,200
スギホールディングス	3,300	6,070.00	20,031,000
薬王堂ホールディングス	800	2,718.00	2,174,400
スクロール	2,500	924.00	2,310,000
ヨンドシーホールディングス	1,600	1,903.00	3,044,800
木曽路	2,500	2,696.00	6,740,000
S R Sホールディングス	2,800	1,031.00	2,886,800
千趣会	3,100	409.00	1,267,900
リテールパートナーズ	2,500	1,757.00	4,392,500
ケーヨー	2,300	1,298.00	2,985,400
上新電機	1,700	2,353.00	4,000,100
日本瓦斯	8,800	2,413.50	21,238,800
ロイヤルホールディングス	2,900	2,594.00	7,522,600
東天紅	100	809.00	80,900
いなげや	1,600	1,602.00	2,563,200
チヨダ	1,600	826.00	1,321,600
ライフコーポレーション	1,800	3,450.00	6,210,000
リンガーハット	2,200	2,319.00	5,101,800
M r M a x H D	2,100	620.00	1,302,000
A O K Iホールディングス	3,600	1,014.00	3,650,400
オークワ	2,400	838.00	2,011,200
コメリ	2,600	3,190.00	8,294,000

青山商事	3,600	1,494.00	5,378,400
しまむら	1,900	15,060.00	28,614,000
はせがわ	500	330.00	165,000
高島屋	11,500	2,057.00	23,655,500
松屋	2,800	927.00	2,595,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,300	1,690.00	12,337,000
近鉄百貨店	700	2,692.00	1,884,400
丸井グループ	11,000	2,430.50	26,735,500
アクシアル リテイリング	1,100	3,775.00	4,152,500
イオン	56,200	3,211.00	180,458,200
イズミ	2,900	3,805.00	11,034,500
平和堂	2,800	2,345.00	6,566,000
フジ	2,600	1,904.00	4,950,400
ヤオコー	1,900	7,625.00	14,487,500
ゼビオホールディングス	2,300	986.00	2,267,800
ケーズホールディングス	11,700	1,311.00	15,338,700
Olympicグループ	500	509.00	254,500
日産東京販売ホールディングス	1,500	465.00	697,500
シルバーライフ	400	1,023.00	409,200
Genky DrugStores	700	5,420.00	3,794,000
ナルミヤ・インターナショナル	200	1,146.00	229,200
ブックオフグループホールディングス	900	1,037.00	933,300
ギフトホールディングス	700	2,196.00	1,537,200
アインホールディングス	2,300	4,197.00	9,653,100
元気寿司	1,000	3,530.00	3,530,000
ヤマダホールディングス	51,000	434.30	22,149,300
アークランズ	4,900	1,624.00	7,957,600
ニトリホールディングス	6,000	16,345.00	98,070,000
愛眼	800	172.00	137,600
ケーユーホールディングス	800	1,112.00	889,600
吉野家ホールディングス	6,100	3,492.00	21,301,200
松屋フーズホールディングス	800	4,510.00	3,608,000
サガミホールディングス	2,500	1,351.00	3,377,500
関西フードマーケット	1,100	1,385.00	1,523,500
王将フードサービス	1,200	7,980.00	9,576,000
ミニストップ	1,200	1,511.00	1,813,200
アークス	3,000	2,797.00	8,391,000
パローホールディングス	3,200	2,249.00	7,196,800
ベルク	800	6,880.00	5,504,000
大庄	700	1,281.00	896,700
ファーストリテイリング	7,500	34,720.00	260,400,000
サンドラッグ	5,600	4,019.00	22,506,400

サクスパー ホールディングス	1,400	918.00	1,285,200	
ヤマザワ	200	1,259.00	251,800	
やまや	200	2,886.00	577,200	
ペルーナ	4,000	627.00	2,508,000	
いよぎんホールディングス	18,400	1,076.50	19,807,600	
しずおかフィナンシャルグループ	34,300	1,267.50	43,475,250	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	13,000	1,209.50	15,723,500	
楽天銀行	5,400	2,620.00	14,148,000	
京都フィナンシャルグループ	4,900	8,753.00	42,889,700	
島根銀行	200	550.00	110,000	
じもとホールディングス	700	478.00	334,600	
めぶきフィナンシャルグループ	76,600	455.50	34,891,300	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	4,460.00	8,920,000	
九州フィナンシャルグループ	29,900	960.10	28,706,990	
ゆうちょ銀行	169,600	1,400.00	237,440,000	
富山第一銀行	4,900	992.00	4,860,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	82,800	694.80	57,529,440	
西日本フィナンシャルホールディングス	8,700	1,889.00	16,434,300	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,961.00	2,745,400	
第四北越フィナンシャルグループ	2,400	3,905.00	9,372,000	
ひろぎんホールディングス	22,000	972.10	21,386,200	
おきなわフィナンシャルグループ	1,300	2,557.00	3,324,100	
十六フィナンシャルグループ	2,000	4,065.00	8,130,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,600	4,765.00	7,624,000	
プロクレアホールディングス	1,800	1,978.00	3,560,400	
あいちフィナンシャルグループ	2,400	2,431.00	5,834,400	
あおぞら銀行	11,100	3,023.00	33,555,300	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	966,500	1,269.50	1,226,971,750	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	180,000	794.10	142,938,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	27,700	5,664.00	156,892,800	
三井住友フィナンシャルグループ	109,700	7,340.00	805,198,000	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	43,000	1,112.00	47,816,000	
群馬銀行	29,900	716.50	21,423,350	
武蔵野銀行	2,200	2,871.00	6,316,200	
千葉興業銀行	2,500	989.00	2,472,500	
筑波銀行	6,700	298.00	1,996,600	
七十七銀行	4,500	3,450.00	15,525,000	
秋田銀行	1,000	2,132.00	2,132,000	
山形銀行	1,700	1,198.00	2,036,600	
岩手銀行	1,000	2,802.00	2,802,000	
東邦銀行	12,200	298.00	3,635,600	

東北銀行	400	1,222.00	488,800
ふくおかフィナンシャルグループ	13,400	3,950.00	52,930,000
スルガ銀行	13,600	648.00	8,812,800
八十二銀行	33,100	876.00	28,995,600
山梨中央銀行	1,700	1,963.00	3,337,100
大垣共立銀行	3,000	2,106.00	6,318,000
福井銀行	1,400	1,636.00	2,290,400
清水銀行	600	1,692.00	1,015,200
富山銀行	100	1,762.00	176,200
滋賀銀行	2,600	4,060.00	10,556,000
南都銀行	2,300	2,690.00	6,187,000
百五銀行	14,500	578.00	8,381,000
紀陽銀行	5,500	1,594.00	8,767,000
ほくほくフィナンシャルグループ	9,500	1,785.50	16,962,250
山陰合同銀行	9,600	1,042.00	10,003,200
鳥取銀行	300	1,354.00	406,200
百十四銀行	1,500	2,964.00	4,446,000
四国銀行	2,200	1,059.00	2,329,800
阿波銀行	2,200	2,472.00	5,438,400
大分銀行	900	2,791.00	2,511,900
宮崎銀行	900	2,929.00	2,636,100
佐賀銀行	900	2,053.00	1,847,700
琉球銀行	3,300	1,250.00	4,125,000
セブン銀行	48,300	303.10	14,639,730
みずほフィナンシャルグループ	208,300	2,550.00	531,165,000
高知銀行	300	1,035.00	310,500
山口フィナンシャルグループ	15,100	1,390.50	20,996,550
名古屋銀行	1,000	6,040.00	6,040,000
北洋銀行	23,400	403.00	9,430,200
大光銀行	300	1,466.00	439,800
愛媛銀行	2,100	1,134.00	2,381,400
トマト銀行	300	1,180.00	354,000
京葉銀行	6,500	682.00	4,433,000
栃木銀行	7,700	356.00	2,741,200
北日本銀行	500	2,332.00	1,166,000
東和銀行	2,800	701.00	1,962,800
福島銀行	900	276.00	248,400
大東銀行	400	795.00	318,000
トモニホールディングス	12,500	517.00	6,462,500
フィデアホールディングス	1,600	1,630.00	2,608,000
池田泉州ホールディングス	21,400	385.00	8,239,000
F P G	5,200	1,491.00	7,753,200

ジャパンインベストメントアドバイザー	1,200	1,580.00	1,896,000
マーキュリアホールディングス	400	762.00	304,800
S B Iホールディングス	22,600	3,296.00	74,489,600
ジャフコ グループ	4,600	1,635.50	7,523,300
大和証券グループ本社	119,600	961.10	114,947,560
野村ホールディングス	259,600	616.70	160,095,320
岡三証券グループ	13,500	697.00	9,409,500
丸三証券	5,200	847.00	4,404,400
東洋証券	4,100	305.00	1,250,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,300	541.00	9,900,300
光世証券	200	542.00	108,400
水戸証券	4,500	442.00	1,989,000
いちよし証券	2,900	716.00	2,076,400
松井証券	7,600	759.00	5,768,400
マネックスグループ	15,100	663.00	10,011,300
極東証券	2,100	1,028.00	2,158,800
岩井コスモホールディングス	1,800	1,772.00	3,189,600
アイザワ証券グループ	2,300	1,199.00	2,757,700
マネーパートナーズグループ	900	285.00	256,500
スパークス・グループ	1,700	1,488.00	2,529,600
かんぽ生命保険	15,700	2,882.00	45,247,400
F Pパートナー	300	4,225.00	1,267,500
S O M P Oホールディングス	24,500	6,670.00	163,415,000
アニコム ホールディングス	5,200	548.00	2,849,600
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	34,600	5,727.00	198,154,200
第一生命ホールディングス	75,400	3,192.00	240,676,800
東京海上ホールディングス	152,500	3,494.00	532,835,000
T & Dホールディングス	44,900	2,716.00	121,948,400
アドバンスクリエイト	900	984.00	885,600
全国保証	4,000	4,877.00	19,508,000
あんしん保証	300	287.00	86,100
ジェイリース	400	1,915.00	766,000
イントラスト	300	826.00	247,800
日本モーゲージサービス	500	522.00	261,000
C a s a	300	828.00	248,400
アルヒ	1,500	815.00	1,222,500
プレミアグループ	2,600	1,639.00	4,261,400
ネットプロテクションズホールディングス	5,100	285.00	1,453,500
クレディセゾン	9,800	2,309.50	22,633,100
芙蓉総合リース	1,400	12,525.00	17,535,000
みずほリース	2,600	4,940.00	12,844,000
東京センチュリー	2,900	5,789.00	16,788,100



日本証券金融	5,700	1,575.00	8,977,500
アイフル	22,700	376.00	8,535,200
リコーリース	1,500	4,665.00	6,997,500
イオンフィナンシャルサービス	8,800	1,249.00	10,991,200
アコム	27,500	358.70	9,864,250
ジャックス	1,600	5,240.00	8,384,000
オリエントコーポレーション	5,100	1,072.00	5,467,200
オリックス	94,100	2,711.00	255,105,100
三菱H C キャピタル	68,800	999.60	68,772,480
九州リースサービス	300	977.00	293,100
日本取引所グループ	40,300	3,173.00	127,871,900
イー・ギャランティ	2,500	1,810.00	4,525,000
アサックス	400	656.00	262,400
N E C キャピタルソリューション	700	3,185.00	2,229,500
大東建託	5,700	16,120.00	91,884,000
いちご	18,200	342.00	6,224,400
日本駐車場開発	16,900	208.00	3,515,200
スター・マイカ・ホールディングス	2,000	630.00	1,260,000
S R E ホールディングス	700	2,503.00	1,752,100
A D ワークスグループ	2,700	259.00	699,300
ヒューリック	36,100	1,422.50	51,352,250
野村不動産ホールディングス	8,600	3,667.00	31,536,200
三重交通グループホールディングス	3,500	567.00	1,984,500
サムティ	2,500	2,502.00	6,255,000
ディア・ライフ	2,700	771.00	2,081,700
コーセーアールイー	400	1,001.00	400,400
地主	1,200	2,016.00	2,419,200
プレサンスコーポレーション	2,500	1,667.00	4,167,500
T H E グローバル社	800	377.00	301,600
ハウスコム	200	809.00	161,800
J P M C	1,000	1,124.00	1,124,000
サンセイランディック	300	1,025.00	307,500
エストラスト	200	627.00	125,400
フージャースホールディングス	2,500	1,078.00	2,695,000
オープンハウスグループ	5,700	5,036.00	28,705,200
東急不動産ホールディングス	46,500	925.00	43,012,500
飯田グループホールディングス	14,800	2,454.00	36,319,200
イーランド	200	1,474.00	294,800
ムゲンエステート	700	1,062.00	743,400
ビーロッド	700	835.00	584,500
ファーストブラザーズ	300	1,141.00	342,300
A n d D o ホールディングス	1,000	1,010.00	1,010,000

シーアールイー	900	1,580.00	1,422,000
ケイアイスター不動産	800	4,320.00	3,456,000
アグレ都市デザイン	200	1,488.00	297,600
グッドコムアセット	1,500	924.00	1,386,000
ジェイ・エス・ビー	800	2,368.00	1,894,400
ロードスターキャピタル	1,100	2,063.00	2,269,300
テンポイノベーション	300	1,122.00	336,600
グローバル・リンク・マネジメント	200	1,971.00	394,200
フェイスネットワーク	300	1,336.00	400,800
パーク24	10,100	1,734.00	17,513,400
パラカ	600	2,009.00	1,205,400
ミガロホールディングス	200	1,232.00	246,400
三井不動産	71,400	3,459.00	246,972,600
三菱地所	101,000	1,986.50	200,636,500
平和不動産	2,500	3,995.00	9,987,500
東京建物	13,500	2,075.00	28,012,500
京阪神ビルディング	3,000	1,405.00	4,215,000
住友不動産	22,300	4,005.00	89,311,500
テオオーシー	2,900	638.00	1,850,200
東京楽天地	300	4,215.00	1,264,500
スターツコーポレーション	2,300	2,935.00	6,750,500
フジ住宅	2,100	713.00	1,497,300
空港施設	2,400	570.00	1,368,000
明和地所	900	1,182.00	1,063,800
ゴールドクレスト	1,300	2,117.00	2,752,100
エスリード	800	3,120.00	2,496,000
日神グループホールディングス	2,700	524.00	1,414,800
日本エスコン	3,000	886.00	2,658,000
MIRARTHホールディングス	7,300	447.00	3,263,100
AVANTIA	600	840.00	504,000
イオンモール	8,000	1,739.50	13,916,000
毎日コムネット	400	710.00	284,000
ファースト住建	400	1,093.00	437,200
カチタス	4,200	2,228.00	9,357,600
トーセイ	2,600	1,937.00	5,036,200
サンフロンティア不動産	2,400	1,481.00	3,554,400
FJネクストホールディングス	1,700	1,062.00	1,805,400
インテリックス	400	505.00	202,000
ランドビジネス	600	306.00	183,600
グランディハウス	1,200	625.00	750,000
日本空港ビルデング	5,500	6,945.00	38,197,500
明豊ファシリティワークス	500	786.00	393,000

L I F U L L	5,600	232.00	1,299,200
M I X I	3,500	2,333.00	8,165,500
ジェイエイシーリクルートメント	1,500	2,491.00	3,736,500
日本M&Aセンターホールディングス	25,700	680.80	17,496,560
メンバーズ	600	1,179.00	707,400
中広	100	429.00	42,900
UTグループ	2,100	2,086.00	4,380,600
アイティメディア	600	992.00	595,200
E・Jホールディングス	900	1,626.00	1,463,400
オープンアップグループ	4,800	1,945.00	9,336,000
コシダカホールディングス	4,900	1,049.00	5,140,100
アルトナー	400	1,761.00	704,400
パソナグループ	2,000	1,402.00	2,804,000
C D S	200	1,722.00	344,400
リンクアンドモチベーション	4,600	423.00	1,945,800
エス・エム・エス	5,600	2,585.00	14,476,000
サニーサイドアップグループ	300	828.00	248,400
パーソルホールディングス	163,900	247.40	40,548,860
リニカル	600	609.00	365,400
クックパッド	4,500	114.00	513,000
エスクリ	300	268.00	80,400
アイ・ケイ・ケイホールディングス	400	657.00	262,800
学情	800	1,748.00	1,398,400
スタジオアリス	800	2,037.00	1,629,600
シミックホールディングス	800	1,719.00	1,375,200
エプロ	300	773.00	231,900
N J S	400	2,867.00	1,146,800
総合警備保障	26,900	866.80	23,316,920
カカクコム	10,600	1,470.50	15,587,300
アイロムグループ	600	1,737.00	1,042,200
セントケア・ホールディング	1,200	866.00	1,039,200
サイネックス	200	847.00	169,400
ルネサンス	1,200	894.00	1,072,800
ディップ	2,500	3,055.00	7,637,500
デジタルホールディングス	800	1,057.00	845,600
新日本科学	1,500	1,835.00	2,752,500
キャリアデザインセンター	200	1,977.00	395,400
ベネフィット・ワン	5,600	1,158.00	6,484,800
エムスリー	31,800	2,588.50	82,314,300
ツカダ・グローバルホールディング	600	400.00	240,000
プラス	100	637.00	63,700
アウトソーシング	10,300	1,189.50	12,251,850

ウェルネット	700	560.00	392,000
ワールドホールディングス	700	2,394.00	1,675,800
ディー・エヌ・エー	5,700	1,510.50	8,609,850
博報堂DYホールディングス	20,500	1,275.00	26,137,500
ぐるなび	3,100	305.00	945,500
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	607.00	485,600
ファンコミュニケーションズ	2,200	402.00	884,400
ライク	600	1,394.00	836,400
A o b a - B B T	300	399.00	119,700
エスプール	4,600	383.00	1,761,800
W D B ホールディングス	800	2,264.00	1,811,200
ティア	500	449.00	224,500
C D G	100	1,208.00	120,800
アドウェイズ	2,200	494.00	1,086,800
バリューコマース	1,400	1,242.00	1,738,800
インフォマート	16,800	434.00	7,291,200
J P ホールディングス	4,100	352.00	1,443,200
エコナックホールディングス	700	141.00	98,700
C L ホールディングス	400	809.00	323,600
プレステージ・インターナショナル	7,600	642.00	4,879,200
アミューズ	1,000	1,512.00	1,512,000
ドリームインキュベータ	600	2,892.00	1,735,200
クイック	1,100	2,195.00	2,414,500
T A C	400	200.00	80,000
電通グループ	15,800	4,503.00	71,147,400
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	936.00	561,600
ぴあ	500	3,615.00	1,807,500
イオンファンタジー	600	2,738.00	1,642,800
シーティーエス	2,000	668.00	1,336,000
ネクシィーズグループ	300	836.00	250,800
H . U . グループホールディングス	4,700	2,526.00	11,872,200
アルプス技研	1,500	2,660.00	3,990,000
日本空調サービス	1,700	791.00	1,344,700
オリエンタルランド	85,300	5,292.00	451,407,600
ダスキン	3,600	3,199.00	11,516,400
明光ネットワークジャパン	1,900	706.00	1,341,400
ファルコホールディングス	700	2,033.00	1,423,100
秀英予備校	200	385.00	77,000
ラウンドワン	15,100	556.00	8,395,600
リゾートトラスト	7,000	2,194.00	15,358,000
ビー・エム・エル	2,000	2,888.00	5,776,000

リソー教育	8,200	246.00	2,017,200
早稲田アカデミー	900	1,507.00	1,356,300
ユー・エス・エス	18,100	2,727.00	49,358,700
東京個別指導学院	1,900	506.00	961,400
サイバーエージェント	35,600	841.40	29,953,840
楽天グループ	138,000	568.80	78,494,400
クリーク・アンド・リバー社	800	2,037.00	1,629,600
SBIグローバルアセットマネジメント	3,100	561.00	1,739,100
テー・オー・ダブリュー	3,100	317.00	982,700
山田コンサルティンググループ	700	1,611.00	1,127,700
セントラルスポーツ	600	2,409.00	1,445,400
フルキャストホールディングス	1,600	1,834.00	2,934,400
エン・ジャパン	2,600	2,321.00	6,034,600
リソルホールディングス	100	5,210.00	521,000
テクノプロ・ホールディングス	9,500	3,287.00	31,226,500
アトラグループ	200	216.00	43,200
アイ・アールジャパンホールディングス	800	1,476.00	1,180,800
Keeper 技研	1,000	6,410.00	6,410,000
ファーストロジック	200	490.00	98,000
三機サービス	100	1,149.00	114,900
Gunosy	1,300	674.00	876,200
デザインワン・ジャパン	200	151.00	30,200
イー・ガーディアン	600	1,692.00	1,015,200
リブセンス	400	303.00	121,200
ジャパンマテリアル	4,900	2,310.00	11,319,000
ベクトル	2,000	1,131.00	2,262,000
ウチヤマホールディングス	400	356.00	142,400
チャーム・ケア・コーポレーション	1,300	1,137.00	1,478,100
キャリアリンク	600	2,080.00	1,248,000
I B J	1,300	651.00	846,300
アサンテ	800	1,605.00	1,284,000
バリューHR	1,400	1,306.00	1,828,400
M&Aキャピタルパートナーズ	1,300	2,195.00	2,853,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,055.00	738,500
E R Iホールディングス	200	1,657.00	331,400
アビスト	100	3,085.00	308,500
シグマクシス・ホールディングス	2,200	1,386.00	3,049,200
ウィルグループ	1,300	1,094.00	1,422,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,100	140.00	154,000
メドピア	1,400	1,014.00	1,419,600
レアジョブ	200	940.00	188,000
リクルートホールディングス	119,300	4,929.00	588,029,700

エラン	2,100	778.00	1,633,800
土木管理総合試験所	400	321.00	128,400
日本郵政	189,300	1,335.00	252,715,500
ベルシステム24ホールディングス	1,800	1,582.00	2,847,600
鎌倉新書	1,400	602.00	842,800
S MN	200	312.00	62,400
一蔵	100	574.00	57,400
グローバルキッズCOMPANY	200	655.00	131,000
エアトリ	1,200	1,912.00	2,294,400
アトラエ	900	1,037.00	933,300
ストライク	700	3,890.00	2,723,000
ソラスト	4,400	603.00	2,653,200
セラク	500	1,278.00	639,000
インソース	3,500	967.00	3,384,500
バイカレント・コンサルティング	11,800	4,310.00	50,858,000
Orchestra Holdings	400	1,019.00	407,600
アイモバイル	2,100	474.00	995,400
キャリアインデックス	300	263.00	78,900
MS - Japan	500	1,180.00	590,000
船場	200	942.00	188,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,200	2,079.00	10,810,800
フルテック	100	1,155.00	115,500
グリーンズ	300	1,546.00	463,800
ツナググループ・ホールディングス	300	771.00	231,300
GameWith	300	307.00	92,100
MS&Consulting	100	677.00	67,700
ウェルビー	900	628.00	565,200
エル・ティー・エス	200	3,205.00	641,000
ミダックホールディングス	1,000	1,846.00	1,846,000
キュービーネットホールディングス	800	1,653.00	1,322,400
RPAホールディングス	2,300	295.00	678,500
スプリックス	300	807.00	242,100
マネジメントソリューションズ	700	2,835.00	1,984,500
プロレド・パートナーズ	400	402.00	160,800
and factory	300	346.00	103,800
テノ・ホールディングス	100	482.00	48,200
フロンティア・マネジメント	400	1,652.00	660,800
ピアラ	200	411.00	82,200
コプロ・ホールディングス	300	1,252.00	375,600
ギークス	100	663.00	66,300
アンビスホールディングス	1,700	2,852.00	4,848,400
カーブスホールディングス	4,500	672.00	3,024,000

フォーラムエンジニアリング	1,100	1,348.00	1,482,800
Fast Fitness Japan	600	1,274.00	764,400
ダイレクトマーケティングミックス	1,700	439.00	746,300
ポピンズ	200	1,231.00	246,200
LITALICO	1,200	2,116.00	2,539,200
アドバンテッジリスクマネジメント	500	431.00	215,500
リログループ	8,100	1,524.00	12,344,400
東祥	1,100	920.00	1,012,000
ID&Eホールディングス	1,000	3,360.00	3,360,000
ビーウィズ	400	2,091.00	836,400
TREホールディングス	3,100	1,172.00	3,633,200
人・夢・技術グループ	600	1,705.00	1,023,000
NISSOホールディングス	1,400	773.00	1,082,200
大栄環境	2,900	2,118.00	6,142,200
日本管財ホールディングス	1,700	2,526.00	4,294,200
M&A総研ホールディングス	800	3,660.00	2,928,000
エイチ・アイ・エス	4,700	1,735.00	8,154,500
ラックランド	700	2,852.00	1,996,400
共立メンテナンス	2,500	6,029.00	15,072,500
イチネンホールディングス	1,700	1,454.00	2,471,800
建設技術研究所	800	4,750.00	3,800,000
スペース	1,000	917.00	917,000
燦ホールディングス	1,500	1,062.00	1,593,000
スバル興業	100	12,980.00	1,298,000
東京テアトル	300	1,077.00	323,100
タナベコンサルティンググループ	500	1,127.00	563,500
ナガワ	500	6,590.00	3,295,000
東京都競馬	1,400	4,195.00	5,873,000
常磐興産	300	1,233.00	369,900
カナモト	2,500	2,494.00	6,235,000
ニシオホールディングス	1,500	3,510.00	5,265,000
トランス・コスモス	2,000	3,155.00	6,310,000
乃村工藝社	7,100	883.00	6,269,300
藤田観光	700	4,120.00	2,884,000
KNT-CTホールディングス	1,000	1,284.00	1,284,000
トーカイ	1,400	1,923.00	2,692,200
白洋舎	100	2,549.00	254,900
セコム	16,400	10,580.00	173,512,000
セントラル警備保障	900	2,606.00	2,345,400
丹青社	3,200	861.00	2,755,200
メイテックグループホールディングス	5,800	2,762.50	16,022,500
応用地質	1,500	2,389.00	3,583,500

船井総研ホールディングス	3,300	2,564.00	8,461,200	
進学会ホールディングス	200	272.00	54,400	
オオバ	600	934.00	560,400	
いであ	200	1,639.00	327,800	
学究社	600	2,024.00	1,214,400	
ベネッセホールディングス	5,400	1,779.50	9,609,300	
イオンディライト	1,800	3,400.00	6,120,000	
ナック	700	979.00	685,300	
ダイセキ	3,300	4,295.00	14,173,500	
ステップ	600	1,882.00	1,129,200	
合 計	23,598,300		52,617,187,660	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

## 貸借対照表

（単位：円）

	2022年11月 7日現在	2023年11月 6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	523,877,387	408,433,421
コール・ローン	1,223,548,757	3,625,129,197
株式	245,823,775,339	302,865,738,679
投資証券	5,778,898,058	6,178,478,022
派生商品評価勘定	69,749,980	136,284,443
未収入金	63,736,671	1,337,338
未収配当金	173,219,298	156,767,619
差入委託証拠金	2,851,468,691	415,280,406
流動資産合計	256,508,274,181	313,787,449,125
資産合計		
	256,508,274,181	313,787,449,125
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	43,385,741	13,037,499
未払金	12,815,074	-
未払解約金	127,255,249	110,218,720
未払利息	1,829	668
流動負債合計	183,457,893	123,256,887
負債合計		
	183,457,893	123,256,887
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	59,202,311,151	60,904,952,761
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	197,122,505,137	252,759,239,477
元本等合計	256,324,816,288	313,664,192,238
純資産合計		
	256,324,816,288	313,664,192,238
負債純資産合計		
	256,508,274,181	313,787,449,125

## 注記表



## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)で評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 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。 (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。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 (2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び第61条にしたがって処理しております。

## (貸借対照表に関する注記)

		2022年11月 7日現在	2023年11月 6日現在
1.	期首	2021年11月 9日	2022年11月 8日
	期首元本額	62,029,182,999円	59,202,311,151円
	期首からの追加設定元本額	11,184,661,253円	9,450,699,077円
	期首からの一部解約元本額	14,011,533,101円	7,748,057,467円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外株式ヘッジなし(DC専用)	29,833,098,571円	33,249,241,900円
	DCインデックスバランス(株式20)	118,853,718円	117,741,897円
	DCインデックスバランス(株式40)	324,006,756円	322,405,329円
	DCインデックスバランス(株式60)	642,259,230円	682,562,314円
	DCインデックスバランス(株式80)	698,807,858円	814,906,805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	1,448,605,235円	1,252,135,558円
	日興五大陸株式ファンド	3,615,709,890円	3,478,589,862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)	13,870,404円	13,258,596円
	インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	90,192,400円	75,144,450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)	5,909,335,825円	5,879,043,409円
	グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	10,381,598,812円	8,685,455,095円
	Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	- 円	8,712,673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	251,058,476円
	Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス(全世界株式)	- 円	309,166,276円
	Niつみインデックスラップ世界10指数(均等型)	- 円	266,848円
	Niつみインデックスラップ世界10指数(安定成長型)	- 円	151,348円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	1,802,386,658円	1,338,394,962円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	17,776,357円	16,033,125円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	50,998,904円	46,733,638円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	77,934,113円	73,720,471円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	76,151,427円	74,507,576円
	インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	4,100,724,993円	4,215,722,153円
	計	59,202,311,151円	60,904,952,761円
2.	受益権の総数	59,202,311,151口	60,904,952,761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11月 9日 至 2022年11月 7日	自 2022年11月 8日 至 2023年11月 6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11月 7日現在	2023年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2022年11月 7日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,198,873,514
投資証券	42,740,395
合計	3,156,133,119

(2023年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	10,640,554,988
投資証券	496,097,102
合計	11,136,652,090

(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11月 7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	4,763,988,331	-	4,790,843,862	26,855,531
	合計	4,763,988,331	-	4,790,843,862	26,855,531

(2023年11月 6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	4,592,485,152	-	4,677,893,280	85,408,128
	合計	4,592,485,152	-	4,677,893,280	85,408,128

(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11月 7日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,352,029,765	-	1,351,630,730	399,035
	米ドル	735,301,500	-	732,400,480	2,901,020
	ユーロ	616,728,265	-	619,230,250	2,501,985
	売建	11,866,800	-	11,959,057	92,257
	加ドル	11,866,800	-	11,959,057	92,257
	合計	1,363,896,565	-	1,363,589,787	491,292

(2023年11月 6日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	3,781,351,249	-	3,819,264,795	37,913,546
	米ドル	3,153,722,060	-	3,180,417,600	26,695,540
	ユーロ	627,629,189	-	638,847,195	11,218,006
	売建	10,877,700	-	10,952,430	74,730
	加ドル	10,877,700	-	10,952,430	74,730

合計	3,792,228,949	-	3,830,217,225	37,838,816
----	---------------	---	---------------	------------

## (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11月 7日現在		2023年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	4.3296円	1口当たり純資産額	5.1501円
(1万口当たり純資産額)	(43,296円)	(1万口当たり純資産額)	(51,501円)

## 附属明細表

## 第 1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	APA CORP	12,750	39.96	509,490.00	
	BAKER HUGHES CO	40,615	35.19	1,429,241.85	
	CHENIERE ENERGY INC	9,500	173.59	1,649,105.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	3,750	89.36	335,100.00	
	CHEVRON CORP	72,391	147.61	10,685,635.51	
	CONOCOPHILLIPS	48,126	119.75	5,763,088.50	
	COTERRA ENERGY INC	32,460	28.04	910,178.40	
	DEVON ENERGY CORPORATION	25,260	47.34	1,195,808.40	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	6,540	162.10	1,060,134.00	
	EOG RESOURCES INC	23,472	128.16	3,008,171.52	
	EQT CORP	12,660	44.72	566,155.20	
	EXXON MOBIL CORP	161,521	107.78	17,408,733.38	
	HALLIBURTON CO	37,607	40.29	1,515,186.03	
	HESS CORP	10,870	146.26	1,589,846.20	
	HF SINCLAIR CORP	5,940	56.28	334,303.20	
	KINDER MORGAN INC	81,490	16.87	1,374,736.30	
	MARATHON OIL CORP	28,380	27.46	779,314.80	
	MARATHON PETROLEUM CORP	17,692	150.78	2,667,599.76	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	28,351	63.01	1,786,396.51	
ONEOK INC	22,440	66.84	1,499,889.60		

OVINTIV INC	9,400	48.81	458,814.00
PHILLIPS 66	18,855	116.79	2,202,075.45
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,130	243.69	2,224,889.70
SCHLUMBERGER LTD	56,921	56.87	3,237,097.27
TARGA RESOURCES CORP	8,180	88.12	720,821.60
TEXAS PACIFIC LAND CORP	245	1,809.01	443,207.45
VALERO ENERGY CORP	14,682	126.43	1,856,245.26
WILLIAMS COS INC	47,324	36.08	1,707,449.92
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,115	293.20	2,672,518.00
ALBEMARLE CORP	4,750	127.98	607,905.00
AMCOR PLC	65,600	9.11	597,616.00
AVERY DENNISON CORP	3,040	181.24	550,969.60
BALL CORP	12,500	51.22	640,250.00
CELANESE CORP	4,090	120.96	494,726.40
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,820	81.55	637,721.00
CLEVELAND-CLIFFS INC	21,150	17.12	362,088.00
CORTEVA INC	28,172	50.23	1,415,079.56
CROWN HOLDINGS INC	4,565	83.31	380,310.15
DOW INC	28,025	49.73	1,393,683.25
DUPONT DE NEMOURS INC	19,162	69.67	1,335,016.54
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,815	77.03	370,899.45
ECOLAB INC	10,200	174.77	1,782,654.00
FMC CORP	4,840	55.39	268,087.60
FREEMONT-MCMORAN INC	56,338	35.15	1,980,280.70
INTERNATIONAL PAPER CO	13,670	34.60	472,982.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,675	72.71	776,179.25
LINDE PLC	19,590	392.51	7,689,270.90
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,570	92.70	979,839.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,720	442.88	1,204,633.60
MOSAIC CO/THE	13,580	33.36	453,028.80
NEWMONT CORP	45,872	39.02	1,789,925.44
NUCOR CORP	9,959	152.31	1,516,855.29
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	158.27	566,606.60
PPG INDUSTRIES INC	9,394	128.31	1,205,344.14
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	2,210	265.10	585,871.00
RPM INTERNATIONAL INC	4,960	96.33	477,796.80
SEALED AIR CORP	5,746	34.62	198,926.52
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,626	250.91	2,415,259.66
STEEL DYNAMICS INC	6,010	111.87	672,338.70
VULCAN MATERIALS CO	5,563	207.78	1,155,880.14
WESTLAKE CORP	1,360	123.65	168,164.00
WESTROCK CO	9,989	37.85	378,083.65
3M CO	21,546	93.86	2,022,307.56

AECOM	4,930	79.01	389,519.30
AERCAP HOLDINGS NV	6,970	65.38	455,698.60
ALLEGION PLC	3,340	101.89	340,312.60
AMETEK INC	9,033	143.70	1,298,042.10
AXON ENTERPRISE INC	2,540	217.25	551,815.00
BOEING CO/THE	22,962	195.05	4,478,738.10
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	5,240	126.79	664,379.60
CARLISLE COS INC	2,250	270.55	608,737.50
CARRIER GLOBAL CORP	33,088	50.53	1,671,936.64
CATERPILLAR INC	20,576	240.75	4,953,672.00
CUMMINS INC	5,535	225.88	1,250,245.80
DEERE & CO	11,095	382.20	4,240,509.00
DOVER CORP	5,350	134.36	718,826.00
EATON CORP PLC	15,996	214.79	3,435,780.84
EMERSON ELECTRIC CO	22,490	91.97	2,068,405.30
FASTENAL CO	22,796	59.80	1,363,200.80
FERGUSON PLC	8,440	157.28	1,327,443.20
FORTIVE CORP	14,854	65.95	979,621.30
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	5,050	61.76	311,888.00
GENERAC HOLDINGS INC	2,440	104.92	256,004.80
GENERAL DYNAMICS CORP	9,397	243.21	2,285,444.37
GENERAL ELECTRIC CO	43,327	108.92	4,719,176.84
GRACO INC	6,310	77.05	486,185.50
HEICO CORP	1,800	162.00	291,600.00
HEICO CORP-CLASS A	3,120	129.91	405,319.20
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	26,766	188.99	5,058,506.34
HOWMET AEROSPACE INC	17,943	47.98	860,905.14
HUBBELL INC	2,320	281.84	653,868.80
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,530	233.96	357,958.80
IDEX CORP	2,880	195.17	562,089.60
ILLINOIS TOOL WORKS	12,175	233.11	2,838,114.25
INGERSOLL-RAND INC	16,398	65.36	1,071,773.28
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,570	40.92	268,844.40
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	27,484	51.48	1,414,876.32
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,750	185.67	1,438,942.50
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,385	387.12	536,161.20
LOCKHEED MARTIN CORP	9,156	453.34	4,150,781.04
MASCO CORP	9,849	55.09	542,581.41
NORDSON CORP	2,345	221.54	519,511.30
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,784	470.58	2,721,834.72
OTIS WORLDWIDE CORP	17,124	79.81	1,366,666.44
OWENS CORNING	3,550	122.66	435,443.00
PACCAR INC	20,706	86.80	1,797,280.80

PARKER HANNIFIN CORP	5,265	401.19	2,112,265.35
PENTAIR PLC	6,918	61.64	426,425.52
QUANTA SERVICES INC	5,710	169.18	966,017.80
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,618	263.70	1,217,766.60
RTX CORP	58,756	82.72	4,860,296.32
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,420	32.46	208,393.20
SMITH (A.O.) CORP	5,020	71.56	359,231.20
SNAP-ON INC	1,975	270.86	534,948.50
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,806	88.87	515,979.22
TEXTRON INC	7,956	77.52	616,749.12
TORO CO	3,890	86.08	334,851.20
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,066	218.00	1,976,388.00
TRANSDIGM GROUP INC	2,180	882.08	1,922,934.40
UNITED RENTALS INC	2,805	451.51	1,266,485.55
WABTEC CORP	7,130	111.29	793,497.70
WATSCO INC	1,240	368.07	456,406.80
WW GRAINGER INC	1,847	767.73	1,417,997.31
XYLEM INC	9,468	96.93	917,733.24
AUTOMATIC DATA PROCESSING	16,521	219.31	3,623,220.51
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,070	123.01	623,660.70
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,400	177.12	779,328.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,280	65.20	344,256.00
CINTAS CORP	3,592	518.45	1,862,272.40
CLARIVATE PLC	14,250	6.87	97,897.50
COPART INC	35,140	45.93	1,613,980.20
EQUIFAX INC	5,024	181.82	913,463.68
JACOBS SOLUTIONS INC	4,880	133.97	653,773.60
LEIDOS HOLDINGS INC	4,960	103.94	515,542.40
PAYCHEX INC	13,072	110.46	1,443,933.12
PAYCOM SOFTWARE INC	1,945	159.02	309,293.90
PAYLOCITY HOLDING CORP	1,730	145.26	251,299.80
REPUBLIC SERVICES INC	8,920	153.45	1,368,774.00
ROBERT HALF INC	4,415	76.35	337,085.25
ROLLINS INC	8,265	38.12	315,061.80
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	52.46	444,336.20
TRANSUNION	7,940	50.31	399,461.40
VERALTO CORP	9,343	70.80	661,484.40
VERISK ANALYTICS INC	5,810	230.62	1,339,902.20
WASTE CONNECTIONS INC	10,606	133.23	1,413,037.38
WASTE MANAGEMENT INC	16,514	168.12	2,776,333.68
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,930	81.69	402,731.70
CSX CORP	81,669	30.40	2,482,737.60
DELTA AIR LINES INC	5,705	33.35	190,261.75

EXPEDITORS INTL WASH INC	6,467	112.95	730,447.65
FEDEX CORP	9,448	247.14	2,334,978.72
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	77,000	3.16	243,320.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,140	175.69	551,666.60
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,140	50.88	312,403.20
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,915	194.56	1,734,502.40
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,955	392.34	1,551,704.70
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	23.70	129,639.00
U-HAUL HOLDING CO	3,375	49.69	167,703.75
UBER TECHNOLOGIES INC	72,550	47.75	3,464,262.50
UNION PACIFIC CORP	24,426	212.13	5,181,487.38
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	29,147	142.86	4,163,940.42
APTIV PLC	11,080	77.50	858,700.00
BORGWARNER INC	9,120	33.36	304,243.20
FORD MOTOR COMPANY	159,205	10.56	1,681,204.80
GENERAL MOTORS CORP	52,765	29.77	1,570,814.05
LEAR CORP	2,290	130.76	299,440.40
LUCID GROUP INC	36,360	4.62	167,983.20
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	27,210	17.71	481,889.10
TESLA INC	114,285	219.96	25,138,128.60
DECKERS OUTDOOR CORP	990	597.10	591,129.00
DR HORTON INC	12,896	118.86	1,532,818.56
GARMIN LTD	5,865	115.61	678,052.65
HASBRO INC	5,188	46.94	243,524.72
LENNAR CORP-CL A	10,040	119.82	1,202,992.80
LULULEMON ATHLETICA INC	4,710	407.93	1,921,350.30
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,878	84.99	159,611.22
NIKE INC -CL B	49,228	107.06	5,270,349.68
NVR INC	148	5,890.63	871,813.24
PULTE GROUP INC	8,850	83.37	737,824.50
VF CORP	12,170	15.50	188,635.00
WHIRLPOOL CORP	2,079	111.46	231,725.34
AIRBNB INC-CLASS A	16,340	122.64	2,003,937.60
ARAMARK	8,880	28.35	251,748.00
BOOKING HOLDINGS INC	1,498	2,858.75	4,282,407.50
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,970	44.40	353,868.00
CARNIVAL CORP	38,787	12.55	486,776.85
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,065	2,040.53	2,173,164.45
DARDEN RESTAURANTS INC	4,853	150.71	731,395.63
DOMINO'S PIZZA INC	1,375	361.94	497,667.50
DOORDASH INC - A	10,020	92.49	926,749.80
DRAFTKINGS INC-CL A	15,800	33.75	533,250.00
EXPEDIA GROUP INC	6,032	112.71	679,866.72



HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,650	156.81	1,670,026.50
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,680	104.66	175,828.80
LAS VEGAS SANDS CORP	14,390	48.84	702,807.60
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,673	191.30	2,041,744.90
MCDONALD'S CORP	29,251	267.87	7,835,465.37
MGM RESORTS INTERNATIONAL	12,900	38.16	492,264.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,358	92.36	864,304.88
STARBUCKS CORP	46,124	102.65	4,734,628.60
VAIL RESORTS INC	1,520	225.01	342,015.20
WYNN RESORTS LTD	4,180	92.76	387,736.80
YUM! BRANDS INC	11,394	126.34	1,439,517.96
ALPHABET INC-CL A	238,020	129.10	30,728,382.00
ALPHABET INC-CL C	211,550	130.37	27,579,773.50
CHARTER COMMUNICATION-A	3,926	420.11	1,649,351.86
COMCAST CORP-CLASS A	166,584	43.18	7,193,097.12
ELECTRONIC ARTS INC	10,834	129.59	1,403,978.06
FOX CORP - CLASS A	13,084	31.82	416,332.88
FOX CORP- CLASS B	5,466	29.33	160,317.78
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,096	29.76	449,256.96
LIBERTY BROADBAND-C	4,850	86.15	417,827.50
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	7,780	65.23	507,489.40
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW C	5,726	26.10	149,448.60
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,420	85.36	548,011.20
MATCH GROUP INC	10,912	29.44	321,249.28
META PLATFORMS INC-CLASS A	88,560	314.60	27,860,976.00
NETFLIX INC	17,800	432.36	7,696,008.00
NEWS CORP - CLASS A	14,750	21.93	323,467.50
OMNICOM GROUP	7,477	77.65	580,589.05
PARAMOUNT GLOBAL	22,823	13.76	314,044.48
PINTEREST INC- CLASS A	22,100	30.94	683,774.00
ROBLOX CORP -CLASS A	19,130	34.90	667,637.00
ROKU INC	4,700	84.75	398,325.00
SEA LTD-ADR	14,470	44.79	648,111.30
SIRIUS XM HOLDINGS INC	30,280	4.95	149,886.00
SNAP INC - A	45,300	10.72	485,616.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,240	138.91	1,005,708.40
THE WALT DISNEY CO.	73,422	85.07	6,246,009.54
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	17,500	79.08	1,383,900.00
WARNER BROS DISCOVERY INC	94,890	11.77	1,116,855.30
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	9,840	13.63	134,119.20
AMAZON.COM INC	369,750	138.60	51,247,350.00
AUTOZONE INC	722	2,574.54	1,858,817.88
BATH & BODY WORKS INC	9,270	32.59	302,109.30

BEST BUY CO INC	7,814	67.19	525,022.66
BURLINGTON STORES INC	2,585	132.46	342,409.10
CARMAX INC	5,949	66.97	398,404.53
CHEWY INC - CLASS A	4,860	21.13	102,691.80
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,270	115.27	261,662.90
EBAY INC	21,897	40.54	887,704.38
ETSY INC	4,800	65.25	313,200.00
GENUINE PARTS CO	5,751	134.02	770,749.02
GLOBAL-E ONLINE LTD	3,050	37.05	113,002.50
HOME DEPOT INC	40,105	295.61	11,855,439.05
LKQ CORP	10,260	44.94	461,084.40
LOWE'S COS INC	23,492	194.94	4,579,530.48
MERCADOLIBRE INC	1,790	1,387.79	2,484,144.10
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,420	952.84	2,305,872.80
POOL CORP	1,540	336.66	518,456.40
ROSS STORES INC	13,762	121.25	1,668,642.50
TJX COMPANIES INC	45,856	91.00	4,172,896.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,530	199.28	902,738.40
ULTA BEAUTY INC	2,100	385.88	810,348.00
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	10,260	21.95	225,207.00
COSTCO WHOLESALE CORP	17,664	560.90	9,907,737.60
DOLLAR GENERAL CORP	8,725	119.24	1,040,369.00
DOLLAR TREE INC	8,986	116.35	1,045,521.10
KROGER CO	26,880	45.37	1,219,545.60
SYSCO CORP	19,996	67.02	1,340,131.92
TARGET CORP	17,980	112.85	2,029,043.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	30,782	22.11	680,590.02
WALMART INC	59,162	164.66	9,741,614.92
ALTRIA GROUP INC	71,048	40.67	2,889,522.16
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,143	72.91	1,614,446.13
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,770	59.55	760,453.50
BUNGE GLOBAL SA	5,847	106.06	620,132.82
CAMPBELL SOUP CO	7,885	40.99	323,206.15
COCA-COLA CO/THE	164,852	56.74	9,353,702.48
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	7,710	60.47	466,223.70
CONAGRA BRANDS INC	20,640	27.81	573,998.40
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,560	241.68	1,585,420.80
DARLING INGREDIENTS INC	5,880	45.22	265,893.60
GENERAL MILLS INC	23,059	65.74	1,515,898.66
HERSHEY CO/THE	5,945	187.99	1,117,600.55
HORMEL FOODS CORP	11,500	32.87	378,005.00
JM SMUCKER CO/THE	4,100	113.47	465,227.00
KELLANOVA	11,098	52.06	577,761.88

KEURIG DR PEPPER INC	39,700	31.12	1,235,464.00
KRAFT HEINZ CO/THE	32,911	33.27	1,094,948.97
LAMB WESTON HOLDING INC	6,150	94.09	578,653.50
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,420	64.96	676,883.20
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,570	59.03	446,857.10
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	54,225	68.82	3,731,764.50
MONSTER BEVERAGE CORP	31,880	55.56	1,771,252.80
PEPSICO INC	55,211	166.79	9,208,642.69
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	62,368	91.52	5,707,919.36
TYSON FOODS INC-CL A	10,906	47.06	513,236.36
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,310	86.80	894,908.00
CLOROX COMPANY	5,266	125.55	661,146.30
COLGATE-PALMOLIVE CO	30,440	74.82	2,277,520.80
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,200	110.96	1,020,832.00
KENVUE INC	60,000	19.37	1,162,200.00
KIMBERLY-CLARK CORP	13,663	119.39	1,631,225.57
PROCTER & GAMBLE CO	94,409	150.07	14,167,958.63
ABBOTT LABORATORIES	69,536	95.84	6,664,330.24
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,060	197.44	604,166.40
BAXTER INTERNATIONAL INC	19,439	33.96	660,148.44
BECTON DICKINSON AND CO	11,387	258.91	2,948,208.17
BOSTON SCIENTIFIC CORP	57,708	52.53	3,031,401.24
CARDINAL HEALTH INC	10,305	100.21	1,032,664.05
CENCORA INC	7,014	195.17	1,368,922.38
CENTENE CORP	22,367	69.32	1,550,480.44
CIGNA GROUP/THE	11,760	310.65	3,653,244.00
COOPER COS INC/THE	2,025	334.64	677,646.00
CVS HEALTH CORP	51,648	70.25	3,628,272.00
DAVITA INC	2,108	79.45	167,480.60
DENTSPLY SIRONA INC	8,222	29.21	240,164.62
DEXCOM INC	15,500	97.46	1,510,630.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	24,120	67.07	1,617,728.40
ELEVANCE HEALTH INC	9,436	449.86	4,244,878.96
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	16,705	71.57	1,195,576.85
HCA HEALTHCARE INC	8,190	230.84	1,890,579.60
HENRY SCHEIN INC	5,280	62.40	329,472.00
HOLOGIC INC	9,858	68.67	676,948.86
HUMANA INC	5,055	477.01	2,411,285.55
IDEXX LABORATORIES INC	3,360	429.30	1,442,448.00
INSULET CORP	2,745	162.58	446,282.10
INTUITIVE SURGICAL INC	14,035	278.52	3,909,028.20
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,415	210.22	717,901.30
MCKESSON CORP	5,439	452.76	2,462,561.64

MEDTRONIC PLC	53,528	72.56	3,883,991.68
MOLINA HEALTHCARE INC	2,655	337.43	895,876.65
QUEST DIAGNOSTICS	4,386	133.91	587,329.26
RESMED INC	5,830	152.81	890,882.30
STERIS PLC	4,240	217.23	921,055.20
STRYKER CORP	13,693	276.22	3,782,280.46
TELEFLEX INC	1,820	211.03	384,074.60
UNITEDHEALTH GROUP INC	37,185	530.90	19,741,516.50
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,920	128.25	246,240.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	5,790	194.59	1,126,676.10
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,412	108.75	914,805.00
ABBVIE INC	70,306	141.42	9,942,674.52
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,750	109.02	1,390,005.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,040	167.35	843,444.00
AMGEN INC	21,231	269.86	5,729,397.66
AVANTOR INC	27,110	18.37	498,010.70
BIO-RAD LABORATORIES-A	950	287.88	273,486.00
BIO-TECHNE CORP	6,730	58.72	395,185.60
BIOGEN INC	5,643	249.50	1,407,928.50
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,380	79.59	666,964.20
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	83,555	52.82	4,413,375.10
CATALENT INC	6,520	35.27	229,960.40
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,910	181.91	347,448.10
DANAHER CORP	28,029	197.87	5,546,098.23
ELI LILLY & CO	32,269	567.81	18,322,660.89
EXACT SCIENCES CORP	7,370	67.02	493,937.40
GILEAD SCIENCES INC	49,954	81.59	4,075,746.86
ILLUMINA INC	6,275	116.92	733,673.00
INCYTE CORP	7,670	54.85	420,699.50
IQVIA HOLDINGS INC	7,438	197.20	1,466,773.60
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,450	132.06	323,547.00
JOHNSON & JOHNSON	96,501	151.34	14,604,461.34
MERCK & CO. INC.	101,193	103.38	10,461,332.34
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	890	1,032.06	918,533.40
MODERNA INC	12,875	77.53	998,198.75
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,630	112.44	408,157.20
PFIZER INC	226,080	31.26	7,067,260.80
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,310	816.90	3,520,839.00
REPLIGEN CORP	2,250	150.36	338,310.00
REVVITY INC	4,910	88.16	432,865.60
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	14,330	27.95	400,523.50
SEAGEN INC	5,620	215.00	1,208,300.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43,590	8.99	391,874.10

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	15,414	454.74	7,009,362.36
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,900	224.43	426,417.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10,330	376.20	3,886,146.00
VIATRIS INC	45,819	9.27	424,742.13
WATERS CORP	2,331	260.49	607,202.19
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,960	335.00	991,600.00
ZOETIS INC	18,525	162.23	3,005,310.75
BANK OF AMERICA CORP	287,899	28.42	8,182,089.58
CITIGROUP INC	78,467	42.26	3,316,015.42
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,310	26.17	505,342.70
FIFTH THIRD BANCORP	26,459	26.46	700,105.14
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	450	1,434.98	645,741.00
FIRST HORIZON CORP	19,800	11.86	234,828.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,720	10.62	570,506.40
JPMORGAN CHASE & CO	116,880	143.00	16,713,840.00
KEYCORP	36,108	11.39	411,270.12
M & T BANK CORP	6,913	122.55	847,188.15
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	16,200	123.21	1,996,002.00
REGIONS FINANCIAL CORP	35,844	15.74	564,184.56
TRUIST FINANCIAL CORP	53,220	31.19	1,659,931.80
US BANCORP	59,781	35.49	2,121,627.69
WEBSTER FINANCIAL CORP	6,370	41.30	263,081.00
WELLS FARGO & CO	148,260	41.62	6,170,581.20
ALLY FINANCIAL INC	12,240	27.14	332,193.60
AMERICAN EXPRESS CO	25,314	152.76	3,866,966.64
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,225	335.74	1,418,501.50
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,800	85.03	1,343,474.00
ARES MANAGEMENT CORP-A	7,150	107.07	765,550.50
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	30,612	45.25	1,385,193.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	51,825	351.81	18,232,553.25
BLACKROCK INC	6,025	657.97	3,964,269.25
BLACKSTONE INC	28,460	100.90	2,871,614.00
BLOCK INC	21,450	48.68	1,044,186.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15,435	106.32	1,641,049.20
CARLYLE GROUP INC/THE	7,650	29.38	224,757.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,940	169.50	667,830.00
CME GROUP INC	14,510	208.62	3,027,076.20
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	6,900	85.80	592,020.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,750	87.18	937,185.00
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,420	27.64	398,568.80
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,590	443.79	705,626.10
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	24,198	51.96	1,257,328.08
FISERV INC	24,884	119.54	2,974,633.36

FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,880	236.66	681,580.80
FRANKLIN RESOURCES INC	11,755	24.25	285,058.75
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	58.72	146,800.00
GLOBAL PAYMENTS INC	10,989	113.76	1,250,108.64
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,378	327.62	4,382,900.36
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	22,740	107.91	2,453,873.40
INVESCO LTD	13,527	13.88	187,754.76
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,200	144.85	463,520.00
KKR & CO INC -A	24,780	61.09	1,513,810.20
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,185	218.03	694,425.55
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,545	220.07	340,008.15
MASTERCARD INC - A	33,865	386.05	13,073,583.25
MOODY'S CORP	6,502	331.42	2,154,892.84
MORGAN STANLEY	50,403	76.26	3,843,732.78
MSCI INC	3,175	497.76	1,580,388.00
NASDAQ INC	11,725	50.22	588,829.50
NORTHERN TRUST CORP	7,690	71.35	548,681.50
PAYPAL HOLDINGS INC	42,267	56.10	2,371,178.70
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,470	101.26	857,672.20
ROBINHOOD MARKETS INC - A	17,810	9.69	172,578.90
S&P GLOBAL INC	13,185	382.90	5,048,536.50
SCHWAB (CHARLES) CORP	60,543	55.83	3,380,115.69
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,375	56.02	245,087.50
STATE STREET CORP	12,947	67.76	877,288.72
SYNCHRONY FINANCIAL	19,010	30.15	573,151.50
T ROWE PRICE GROUP INC	8,675	95.67	829,937.25
TOAST INC-CLASS A	12,760	17.49	223,172.40
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,200	91.95	386,190.00
VISA INC-CLASS A SHARES	64,762	243.60	15,776,023.20
AFLAC INC	23,424	82.23	1,926,155.52
ALLSTATE CORP	10,513	131.73	1,384,877.49
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,660	109.86	292,227.60
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	30,345	63.74	1,934,190.30
AON PLC	8,077	323.28	2,611,132.56
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,535	85.55	1,243,469.25
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,610	242.33	2,086,461.30
ASSURANT INC	1,960	163.50	320,460.00
BROWN & BROWN INC	9,090	70.53	641,117.70
CHUBB LTD	16,685	218.79	3,650,511.15
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,880	100.88	593,174.40
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	940	278.28	261,583.20
EVEREST GROUP LTD	1,469	385.41	566,167.29
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	11,071	42.82	474,060.22

GLOBE LIFE INC	3,586	117.16	420,135.76
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,382	74.13	917,877.66
LOEWS CORP	7,145	65.79	470,069.55
MARKEL GROUP INC	530	1,336.97	708,594.10
MARSH & MCLENNAN COS	19,918	193.93	3,862,697.74
METLIFE INC	26,335	61.76	1,626,449.60
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,520	71.69	682,488.80
PROGRESSIVE CORP	23,340	156.21	3,645,941.40
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,962	94.15	1,408,672.30
TRAVELERS COS INC/THE	8,889	168.41	1,496,996.49
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,198	236.26	991,819.48
WR BERKLEY CORP	8,091	67.88	549,217.08
ACCENTURE PLC-CL A	25,308	313.49	7,933,804.92
ADOBE INC	18,194	563.66	10,255,230.04
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,030	108.50	654,255.00
ANSYS INC	3,515	287.74	1,011,406.10
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,300	175.05	227,565.00
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	6,020	176.90	1,064,938.00
AUTODESK INC	8,720	203.98	1,778,705.60
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,530	49.35	371,605.50
BILL HOLDINGS INC	3,910	66.93	261,696.30
CADENCE DESIGN SYS INC	10,570	249.54	2,637,637.80
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,840	136.92	525,772.80
CLOUDFLARE INC-CLASS A	10,740	64.42	691,870.80
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	20,318	66.27	1,346,473.86
CONFLUENT INC-CLASS A	6,870	17.75	121,942.50
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	8,990	188.24	1,692,277.60
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,650	180.19	297,313.50
DATADOG INC-CLASS A	9,910	82.04	813,016.40
DOCUSIGN INC	8,320	41.09	341,868.80
DROPBOX INC-CLASS A	11,660	26.00	303,160.00
DYNATRACE INC	9,850	47.66	469,451.00
EPAM SYSTEMS INC	2,280	240.70	548,796.00
FAIR ISAAC CORP	970	930.41	902,497.70
FORTINET INC	26,965	50.48	1,361,193.20
GARTNER INC	3,050	386.71	1,179,465.50
GEN DIGITAL INC	24,365	17.63	429,554.95
GODADDY INC-CLASS A	6,020	85.56	515,071.20
HUBSPOT INC	1,885	422.89	797,147.65
INTL BUSINESS MACHINES CORP	36,342	147.90	5,374,981.80
INTUIT INC	11,241	498.51	5,603,750.91
MANHATTAN ASSOCIATES INC	2,350	208.86	490,821.00
MICROSOFT CORP	282,814	352.80	99,776,779.20

MONDAY.COM LTD	980	131.96	129,320.80
MONGODB INC	2,820	343.11	967,570.20
OKTA INC	6,340	69.88	443,039.20
ORACLE CORP	65,133	108.05	7,037,620.65
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	72,800	18.89	1,375,192.00
PALO ALTO NETWORKS INC	12,205	243.53	2,972,283.65
PTC INC	4,160	147.51	613,641.60
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,200	502.54	2,110,668.00
SALESFORCE INC	39,026	207.47	8,096,724.22
SERVICENOW INC	8,125	606.76	4,929,925.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	10,490	149.99	1,573,395.10
SPLUNK INC	6,120	146.48	896,457.60
SYNOPSYS INC	6,082	487.94	2,967,651.08
TWILIO INC - A	7,225	54.10	390,872.50
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,830	416.25	761,737.50
UIPATH INC - CLASS A	17,970	17.32	311,240.40
UNITY SOFTWARE INC	9,650	27.64	266,726.00
VERISIGN INC	3,690	202.49	747,188.10
VMWARE INC-CLASS A	9,517	146.79	1,397,000.43
WIX.COM LTD	2,280	87.66	199,864.80
WORKDAY INC-CLASS A	7,990	218.41	1,745,095.90
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	9,630	62.99	606,593.70
ZSCALER INC	3,630	164.37	596,663.10
AMPHENOL CORP-CL A	23,350	84.77	1,979,379.50
APPLE INC	629,794	176.65	111,253,110.10
ARISTA NETWORKS INC	10,420	212.49	2,214,145.80
ARROW ELECTRONICS INC	2,520	120.95	304,794.00
CDW CORP/DE	5,895	209.46	1,234,766.70
CISCO SYSTEMS INC	162,490	53.01	8,613,594.90
COGNEX CORP	6,480	36.26	234,964.80
CORNING INC	33,518	27.93	936,157.74
DELL TECHNOLOGIES -C	11,022	69.51	766,139.22
F5 INC	2,385	154.08	367,480.80
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	50,105	15.93	798,172.65
HP INC	34,495	27.42	945,852.90
JABIL INC	4,990	128.40	640,716.00
JUNIPER NETWORKS INC	13,453	27.26	366,728.78
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,160	125.76	900,441.60
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,610	299.42	1,979,166.20
NETAPP INC	8,246	75.90	625,871.40
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,794	72.28	563,350.32
SUPER MICRO COMPUTER INC	1,790	255.00	456,450.00
TE CONNECTIVITY LTD	12,995	125.76	1,634,251.20



TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,020	379.46	766,509.20
TRIMBLE INC	9,520	42.41	403,743.20
WESTERN DIGITAL CORP	11,688	43.01	502,700.88
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,075	214.30	444,672.50
AT&T INC	287,257	15.88	4,561,641.16
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	10,361	17.47	181,006.67
T-MOBILE US INC	21,939	147.49	3,235,783.11
VERIZON COMMUNICATIONS INC	168,177	36.02	6,057,735.54
AES CORP	27,958	16.79	469,414.82
ALLIANT ENERGY CORP	12,150	51.10	620,865.00
AMEREN CORPORATION	10,152	78.51	797,033.52
AMERICAN ELECTRIC POWER	20,348	79.72	1,622,142.56
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,705	130.04	1,001,958.20
ATMOS ENERGY CORP	5,310	111.49	592,011.90
CENTERPOINT ENERGY INC	23,972	27.39	656,593.08
CMS ENERGY CORP	11,090	55.74	618,156.60
CONSOLIDATED EDISON INC	14,236	90.07	1,282,236.52
CONSTELLATION ENERGY	13,168	117.07	1,541,577.76
DOMINION ENERGY INC	33,331	43.61	1,453,564.91
DTE ENERGY COMPANY	8,318	100.18	833,297.24
DUKE ENERGY CORP	30,796	90.28	2,780,262.88
EDISON INTERNATIONAL	16,329	64.05	1,045,872.45
ENERGY CORP	7,967	98.18	782,200.06
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,210	35.82	401,542.20
EVERGY INC	8,720	51.21	446,551.20
EVERSOURCE ENERGY	14,310	55.43	793,203.30
EXELON CORP	39,706	40.56	1,610,475.36
FIRSTENERGY CORP	23,295	36.82	857,721.90
NEXTERA ENERGY INC	80,990	59.38	4,809,186.20
NISOURCE INC	15,610	25.72	401,489.20
NRG ENERGY INC	8,760	45.00	394,200.00
P G & E CORP	73,270	16.89	1,237,530.30
PPL CORP	30,338	25.37	769,675.06
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	19,888	63.59	1,264,677.92
SEMPRA	24,864	72.35	1,798,910.40
SOUTHERN CO	43,485	70.39	3,060,909.15
VISTRA CORP	14,720	34.99	515,052.80
WEC ENERGY GROUP INC	12,220	83.95	1,025,869.00
XCEL ENERGY INC	22,174	61.03	1,353,279.22
ADVANCED MICRO DEVICES	64,304	112.25	7,218,124.00
ANALOG DEVICES INC	20,097	167.92	3,374,688.24
APPLIED MATERIALS INC	33,733	139.75	4,714,186.75
BROADCOM INC	16,530	882.68	14,590,700.40

	ENPHASE ENERGY INC	5,440	80.81	439,606.40	
	ENTEGRIS INC	5,660	92.26	522,191.60	
	FIRST SOLAR INC	4,260	151.94	647,264.40	
	INTEL CORP	167,432	38.14	6,385,856.48	
	KLA CORP	5,489	499.62	2,742,414.18	
	LAM RESEARCH CORP	5,402	634.08	3,425,300.16	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	5,150	57.63	296,794.50	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	33,614	51.36	1,726,415.04	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,028	76.43	1,683,600.04	
	MICRON TECHNOLOGY INC	44,157	72.58	3,204,915.06	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,820	492.93	897,132.60	
	NVIDIA CORP	98,880	450.05	44,500,944.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	10,447	181.55	1,896,652.85	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	17,340	68.25	1,183,455.00	
	QORVO INC	4,240	88.33	374,519.20	
	QUALCOMM INC	44,802	119.52	5,354,735.04	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,440	91.05	586,362.00	
	SOLAREDDGE TECHNOLOGIES INC	2,310	75.60	174,636.00	
	TERADYNE INC	6,190	87.70	542,863.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	36,472	150.23	5,479,188.56	
	WOLFSPEED INC	5,080	34.82	176,885.60	
	CBRE GROUP INC - A	12,560	76.01	954,685.60	
	COSTAR GROUP INC	16,800	77.38	1,299,984.00	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,500	3.33	134,865.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	6,370	37.69	240,085.30	
	米ドル小計	13,671,030		1,509,102,226.73 (225,867,330,274)	
加ドル	ARC RESOURCES LTD	25,510	23.44	597,954.40	
	CAMECO CORP	16,352	57.37	938,114.24	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	44,054	91.55	4,033,143.70	
	CENOVUS ENERGY INC	57,213	26.14	1,495,547.82	
	ENBRIDGE INC	81,027	46.26	3,748,309.02	
	IMPERIAL OIL LTD	8,922	78.50	700,377.00	
	KEYERA CORP	8,460	32.89	278,249.40	
	PARKLAND CORP	6,170	42.16	260,127.20	
	PEMBINA PIPELINE CORP	23,552	43.96	1,035,345.92	
	SUNCOR ENERGY INC	53,489	46.11	2,466,377.79	
	TC ENERGY CORP	41,663	49.92	2,079,816.96	
	TOURMALINE OIL CORP	12,040	72.88	877,475.20	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	21,496	67.60	1,453,129.60	
	BARRICK GOLD CORP	69,624	22.54	1,569,324.96	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	55.57	319,527.50	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	17.46	395,469.00	

FRANCO-NEVADA CORP	8,125	170.43	1,384,743.75
IVANHOE MINES LTD-CL A	24,510	10.85	265,933.50
KINROSS GOLD CORP	46,025	7.58	348,869.50
LUNDIN MINING CORP	25,010	8.90	222,589.00
NUTRIEN LTD	20,908	76.87	1,607,197.96
PAN AMERICAN SILVER CORP	12,860	20.98	269,802.80
TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,975	50.94	915,646.50
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,450	101.61	248,944.50
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,165	61.39	1,176,539.35
CAE INC	12,305	29.52	363,243.60
STANTEC INC	4,100	87.07	356,987.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,260	110.05	358,763.00
WSP GLOBAL INC	4,590	187.42	860,257.80
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,410	40.88	302,920.80
RB GLOBAL INC	7,560	93.02	703,231.20
THOMSON REUTERS CORP	6,310	174.24	1,099,454.40
AIR CANADA	7,190	18.05	129,779.50
CANADIAN NATL RAILWAY CO	22,438	151.77	3,405,415.26
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	37,551	101.55	3,813,304.05
TFI INTERNATIONAL INC	3,210	155.86	500,310.60
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,668	73.13	780,150.84
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,570	101.24	158,946.80
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,040	45.42	319,756.80
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,998	92.68	1,019,294.64
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,250	144.81	325,822.50
DOLLARAMA INC	12,990	95.96	1,246,520.40
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	30,860	76.80	2,370,048.00
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	39.66	275,637.00
LOBLAW COMPANIES LTD	6,339	119.57	757,954.23
METRO INC	9,570	73.33	701,768.10
WESTON (GEORGE) LTD	2,808	160.83	451,610.64
SAPUTO INC	9,620	28.86	277,633.20
BANK OF MONTREAL	27,631	109.49	3,025,318.19
BANK OF NOVA SCOTIA	47,539	59.17	2,812,882.63
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	37,740	51.82	1,955,686.80
NATIONAL BANK OF CANADA	13,750	88.66	1,219,075.00
ROYAL BANK OF CANADA	54,929	116.05	6,374,510.45
TORONTO-DOMINION BANK	73,180	80.98	5,926,116.40
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	13,859	43.30	600,094.70
BROOKFIELD CORP	57,209	45.43	2,599,004.87
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	13,800	19.83	273,654.00
IGM FINANCIAL INC	3,335	34.11	113,756.85
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,250	21.06	47,385.00

ONEX CORPORATION	2,765	82.45	227,974.25
TMX GROUP LTD	10,850	29.06	315,301.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	1,223.48	1,101,132.00
GREAT-WEST LIFECO INC	11,324	40.15	454,658.60
IA FINANCIAL CORP INC	4,075	84.73	345,274.75
INTACT FINANCIAL CORP	7,215	198.84	1,434,630.60
MANULIFE FINANCIAL CORP	71,921	25.48	1,832,547.08
POWER CORP OF CANADA	20,479	34.93	715,331.47
SUN LIFE FINANCIAL INC	24,774	65.68	1,627,156.32
CGI INC	8,030	138.18	1,109,585.40
CONSTELLATION SOFTWARE INC	810	2,864.51	2,320,253.10
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,740	99.81	373,289.40
OPEN TEXT CORP	11,190	49.63	555,359.70
SHOPIFY INC - CLASS-A	47,780	84.06	4,016,386.80
BCE INC	3,000	54.52	163,560.00
QUEBECOR INC -CL B	6,110	30.62	187,088.20
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	13,875	55.76	773,670.00
TELUS CORP	12,662	24.25	307,053.50
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	7.86	212,848.80
ALTAGAS LTD	11,170	27.30	304,941.00
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	33.73	183,659.85
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	31.29	142,682.40
EMERA INC	10,460	48.48	507,100.80
FORTIS INC	19,055	56.85	1,083,276.75
HYDRO ONE LTD	13,230	37.43	495,198.90
NORTHLAND POWER INC	8,600	22.33	192,038.00
FIRSTSERVICE CORP	1,500	200.88	301,320.00
加ドル小計	1,610,409		95,498,170.49 (10,460,869,595)
ユーロ			
ENI SPA	89,476	15.36	1,374,888.21
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	18,755	14.06	263,695.30
NESTE OYJ	16,380	32.19	527,272.20
OMV AG	5,480	40.42	221,501.60
REPSOL SA	54,849	13.77	755,270.73
TENARIS SA	17,895	16.31	292,010.61
TOTALENERGIES SE	90,417	62.33	5,635,691.61
AIR LIQUIDE SA	20,889	163.18	3,408,667.02
AKZO NOBEL	6,937	64.14	444,939.18
ARCELORMITTAL	20,552	21.69	445,875.64
ARKEMA	2,215	89.86	199,039.90
BASF SE	37,045	43.87	1,625,164.15
COVESTRO AG	7,410	47.54	352,271.40
DSM-FIRMENICH AG	7,552	89.69	677,338.88

EVONIK INDUSTRIES AG	8,230	17.90	147,317.00
HEIDELBERG MATERIALS AG	5,715	68.22	389,877.30
OCI NV	4,810	22.22	106,878.20
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,050	32.15	290,957.50
SOLVAY SA	2,811	98.08	275,702.88
STORA ENSO OYJ-R SHS	25,365	11.76	298,419.22
SYMRISE AG	5,790	95.44	552,597.60
UMICORE	7,960	23.89	190,164.40
UPM-KYMMENE OYJ	21,098	32.58	687,372.84
VOESTALPINE AG	4,249	24.48	104,015.52
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,876	33.89	266,917.64
AIRBUS GROUP SE	23,598	129.06	3,045,557.88
ALSTOM	11,635	13.89	161,668.32
BOUYGUES SA	8,460	33.54	283,748.40
BRENNTAG SE	6,865	71.36	489,886.40
CNH INDUSTRIAL NV	39,510	10.74	424,337.40
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	19,106	54.27	1,036,882.62
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	18,186	29.88	543,397.68
DASSAULT AVIATION SA	900	180.70	162,630.00
EIFFAGE	3,250	88.50	287,625.00
FERROVIAL SE	17,825	28.88	514,786.00
GEA GROUP AG	6,020	33.21	199,924.20
IMCD NV	2,120	121.70	258,004.00
KINGSPAN GROUP PLC	5,900	69.38	409,342.00
KNORR-BREMSE AG	2,970	54.24	161,092.80
KONE OYJ-B	13,614	42.06	572,604.84
LEGRAND SA	11,128	83.50	929,188.00
METSO CORPORATION	24,200	8.63	208,991.20
MTU AERO ENGINES AG	2,020	183.30	370,266.00
PRYSMIAN SPA	9,565	35.81	342,522.65
RATIONAL AG	230	563.50	129,605.00
RHEINMETALL AG	1,730	270.40	467,792.00
SAFRAN SA	13,080	150.06	1,962,784.80
SCHNEIDER ELECTRIC SE	21,918	150.70	3,303,042.60
SIEMENS AG-REG	30,576	127.80	3,907,612.80
SIEMENS ENERGY AG	21,343	9.54	203,740.27
THALES SA	4,015	135.10	542,426.50
VINCI SA	20,600	106.38	2,191,428.00
WARTSILA OYJ ABP	18,180	11.52	209,433.60
BUREAU VERITAS SA	10,920	22.50	245,700.00
RANDSTAD NV	4,675	51.82	242,258.50
TELEPERFORMANCE	2,240	123.75	277,200.00
WOLTERS KLUWER	10,027	115.90	1,162,129.30

ADP	1,090	111.80	121,862.00
AENA SA	2,870	145.30	417,011.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	7.53	179,864.16
DEUTSCHE POST AG-REG	39,823	37.73	1,502,720.90
GETLINK	17,310	15.62	270,382.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,355	92.95	1,241,347.25
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,210	84.50	186,745.00
CONTINENTAL AG	4,385	62.76	275,202.60
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	4,380	90.14	394,813.20
FERRARI NV	5,019	308.70	1,549,365.30
MERCEDES-BENZ GROUP AG	34,202	57.90	1,980,295.80
MICHELIN (CGDE)	24,706	28.24	697,697.44
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	44.76	253,789.20
RENAULT SA	8,247	34.73	286,459.54
STELLANTIS NV	90,796	18.69	1,697,522.01
VALEO SA	7,420	13.86	102,878.30
VOLKSWAGEN AG	1,151	117.30	135,012.30
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,073	105.04	847,987.92
ADIDAS AG	6,571	170.48	1,120,224.08
HERMES INTERNATIONAL	1,272	1,814.60	2,308,171.20
KERING	3,007	407.25	1,224,600.75
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	11,084	702.80	7,789,835.20
MONCLER SPA	8,080	51.00	412,080.00
PUMA SE	4,200	55.70	233,940.00
SEB SA	987	97.80	96,528.60
ACCOR SA	6,056	29.70	179,863.20
AMADEUS IT GROUP SA	18,350	56.38	1,034,573.00
DELIVERY HERO SE	6,600	27.50	181,500.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,816	159.45	1,086,811.20
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	30.56	119,184.00
SODEXO	3,240	98.68	319,723.20
BOLLORE SE	33,530	5.22	175,194.25
PUBLICIS GROUPE	9,305	71.74	667,540.70
SCOUT24 SE	2,970	58.94	175,051.80
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	31,460	23.63	743,399.80
VIVENDI SE	26,070	8.66	225,818.34
D'IETTEREN GROUP	1,050	148.20	155,610.00
INDITEX	43,905	33.53	1,472,134.65
PROSUS NV	62,794	28.30	1,777,384.17
ZALANDO SE	8,260	22.50	185,850.00
CARREFOUR SA	22,633	17.13	387,703.29
HELLOFRESH SE	6,070	21.68	131,597.60
JERONIMO MARTINS	10,585	22.44	237,527.40

KESKO OYJ-B SHS	10,930	16.52	180,563.60
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	40,028	28.32	1,133,793.10
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	33,221	55.11	1,830,809.31
DANONE	25,794	57.05	1,471,547.70
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,850	10.78	214,082.25
HEINEKEN HOLDING NV	4,895	74.00	362,230.00
HEINEKEN NV	11,343	86.92	985,933.56
JDE PEET'S NV	6,290	26.60	167,314.00
KERRY GROUP PLC-A	6,460	75.18	485,662.80
PERNOD-RICARD SA	8,296	173.45	1,438,941.20
REMY COINTREAU	810	117.05	94,810.50
BEIERSDORF AG	4,375	123.30	539,437.50
HENKEL AG & CO KGAA	4,520	59.50	268,940.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,793	67.94	461,516.42
L'OREAL	9,651	403.70	3,896,108.70
AMPLIFON SPA	4,830	27.70	133,791.00
BIOMERIEUX	1,690	94.40	159,536.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	84.82	136,560.20
DIASORIN ITALIA SPA	930	90.24	83,923.20
ESSILORLUXOTTICA	11,505	174.24	2,004,631.20
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,613	32.30	245,899.90
FRESENIUS SE & CO KGAA	15,695	25.31	397,240.45
KONINKLIJKE PHILIPS NV	36,772	19.22	706,904.92
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,640	47.98	510,507.20
ARGENX SE	2,315	465.60	1,077,864.00
BAYER AG-REG	39,064	42.06	1,643,031.84
EUROFINS SCIENTIFIC	5,050	51.50	260,075.00
GRIFOLS SA	12,050	11.64	140,262.00
IPSEN	1,600	110.20	176,320.00
MERCK KGAA	5,150	146.35	753,702.50
ORION OYJ-CLASS B	4,500	36.69	165,105.00
QIAGEN N.V.	10,384	36.65	380,573.60
RECORDATI SPA	3,720	43.95	163,494.00
SANOFI	45,686	85.35	3,899,300.10
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,230	257.00	316,110.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	187.45	202,446.00
UCB SA	4,928	69.40	342,003.20
ABN AMRO BANK NV-CVA	15,170	13.05	197,968.50
AIB GROUP PLC	51,000	4.17	212,874.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	241,763	7.73	1,869,795.04
BANCO SANTANDER SA	662,389	3.57	2,369,696.64
BANK OF IRELAND GROUP PLC	44,790	8.60	385,194.00
BNP PARIBAS	44,242	56.64	2,505,866.88

CAIXABANK S.A	163,050	3.78	617,307.30
COMMERZBANK AG	40,474	10.33	418,298.79
CREDIT AGRICOLE SA	49,662	11.68	580,250.80
ERSTE GROUP BANK AG	13,018	34.60	450,422.80
FINECOBANK SPA	23,540	11.91	280,361.40
ING GROEP NV-CVA	146,925	12.25	1,800,418.95
INTESA SANPAOLO	658,093	2.56	1,687,021.40
KBC GROEP NV	9,719	54.04	525,214.76
MEDIOBANCA SPA	19,520	11.49	224,382.40
SOCIETE GENERALE	30,909	21.80	673,816.20
UNICREDIT SPA	73,256	23.43	1,716,388.08
ADYEN NV	865	708.80	613,112.00
AMUNDI SA	2,140	53.45	114,383.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	80,935	10.66	862,767.10
DEUTSCHE BOERSE AG	7,600	158.50	1,204,600.00
EDENRED	9,626	50.72	488,230.72
EURAZEO SE	1,487	55.75	82,900.25
EURONEXT NV	3,470	67.90	235,613.00
EXOR NV	4,164	85.02	354,023.28
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,452	72.26	249,441.52
NEXI SPA	21,240	6.12	130,031.28
SOFINA	655	194.80	127,594.00
WENDEL	1,000	74.95	74,950.00
WORLDLINE SA	8,950	13.69	122,570.25
AEGON LTD	69,679	4.74	330,557.17
AGEAS	5,924	37.33	221,142.92
ALLIANZ SE-REG	16,233	221.00	3,587,493.00
ASR NEDERLAND NV	5,880	36.14	212,503.20
ASSICURAZIONI GENERALI	42,248	19.01	803,345.72
AXA SA	75,752	28.17	2,133,933.84
HANNOVER RUECK SE-REG	2,275	206.60	470,015.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,626	375.00	2,109,750.00
NN GROUP NV	10,270	31.23	320,732.10
POSTE ITALIANE SPA	19,560	9.53	186,406.80
SAMPO OYJ-A SHS	19,639	37.83	742,943.37
TALANX AG	2,500	59.65	149,125.00
BECHTLE AG	3,070	43.44	133,360.80
CAP GEMINI SA	6,509	173.55	1,129,636.95
DASSAULT SYSTEMES SE	27,400	39.44	1,080,656.00
NEMETSCHKE SE	2,350	68.78	161,633.00
SAP SE	41,962	129.28	5,424,847.36
NOKIA OYJ	213,336	3.21	685,021.89
CELLNEX TELECOM SA	21,660	30.45	659,547.00



	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	128,776	21.39	2,754,518.64
	ELISA OYJ	6,005	42.15	253,110.75
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	10.81	163,987.70
	KONINKLIJKE KPN NV	122,956	3.18	391,737.81
	ORANGE S.A.	72,804	11.14	811,327.77
	TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.25	104,013.22
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	46,470	1.68	78,069.60
	TELEFONICA SA	195,629	3.75	734,195.63
	ACCIONA SA	830	127.20	105,576.00
	E.ON SE	90,999	11.37	1,034,658.63
	EDP RENOVAVEIS SA	11,156	16.59	185,133.82
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	126,131	4.21	531,894.42
	ELIA GROUP SA/NV	1,356	96.85	131,328.60
	ENAGAS SA	8,610	16.10	138,621.00
	ENDESA SA	12,050	18.57	223,828.75
	ENEL SPA	309,737	6.16	1,907,979.92
	ENGIE	71,874	15.15	1,089,178.59
	FORTUM OYJ	16,755	12.08	202,484.17
	IBERDROLA SA	244,512	10.68	2,611,388.16
	NATURGY ENERGY GROUP SA	4,522	26.60	120,285.20
	REDEIA CORP SA	15,580	14.92	232,531.50
	RWE AG	25,835	36.84	951,761.40
	SNAM SPA	91,120	4.38	399,925.68
	TERNA SPA	53,627	7.35	394,587.46
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	25,530	26.85	685,480.50
	VERBUND AG	2,780	84.60	235,188.00
	ASM INTERNATIONAL NV	1,935	417.70	808,249.50
	ASML HOLDING NV	16,172	597.70	9,666,004.40
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	2,870	107.05	307,233.50
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	51,775	29.18	1,511,053.37
	STMICROELECTRONICS NV	27,283	38.42	1,048,212.86
	LEG IMMOBILIEN SE	3,010	67.14	202,091.40
	VONOVIA SE	27,119	24.51	664,686.69
	ユーロ小計	7,196,360		179,193,699.89 (28,757,004,958)
英ポンド	BP PLC	703,648	4.89	3,446,819.72
	SHELL PLC-NEW	270,927	26.52	7,186,338.67
	ANGLO AMERICAN PLC	54,004	22.08	1,192,408.32
	ANTOFAGASTA PLC	14,330	13.57	194,529.75
	CRH PLC	30,060	46.26	1,390,575.60
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,131	45.58	279,450.98
	ENDEAVOUR MINING PLC	6,490	17.41	112,990.90
	GLENCORE PLC	417,803	4.39	1,836,661.98

JOHNSON MATTHEY PLC	7,339	15.65	114,892.04
MONDI PLC	18,370	13.53	248,637.95
RIO TINTO PLC	44,725	53.30	2,383,842.50
ASHTED GROUP PLC	17,770	49.58	881,036.60
BAE SYSTEMS PLC ORD	124,235	10.82	1,344,222.70
BUNZL PLC	12,896	29.18	376,305.28
DCC PLC	3,820	46.53	177,744.60
MELROSE INDUSTRIES PLC	50,400	4.89	246,859.20
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	353,031	2.20	779,845.47
SMITHS GROUP PLC	13,603	16.29	221,592.87
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,890	84.76	244,956.40
EXPERIAN PLC	37,408	26.49	990,937.92
INTERTEK GROUP PLC	6,025	38.74	233,408.50
RELX PLC	76,445	28.35	2,167,215.75
RENTOKIL INITIAL PLC	115,300	4.42	509,856.60
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	4.42	180,145.28
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,515	42.27	190,849.05
BURBERRY GROUP PLC	15,504	17.20	266,746.32
PERSIMMON PLC	12,440	11.15	138,768.20
TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.14	141,834.87
COMPASS GROUP PLC	72,268	20.52	1,482,939.36
ENTAIN PLC	24,860	9.19	228,612.56
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,473	57.46	429,398.58
PEARSON PLC	26,089	9.53	248,628.17
WHITBREAD PLC	8,110	32.51	263,656.10
AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	6.25	228,072.96
INFORMA PLC	56,580	7.18	406,583.88
WPP PLC	41,144	7.44	306,111.36
JD SPORTS FASHION PLC	97,350	1.31	127,869.22
KINGFISHER PLC	78,137	2.22	173,854.82
NEXT PLC	5,667	73.30	415,391.10
OCADO GROUP PLC	22,670	5.42	122,916.74
SAINSBURY (J) PLC	70,601	2.74	193,799.74
TESCO PLC	288,058	2.75	794,463.96
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,125	21.24	278,775.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	84,677	25.26	2,139,364.40
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	21.15	162,643.50
DIAGEO PLC	90,492	31.93	2,889,409.56
IMPERIAL BRANDS PLC	38,792	18.02	699,225.80
HALEON PLC	218,251	3.20	699,276.20
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	28,605	54.12	1,548,102.60
UNILEVER PLC	100,772	38.54	3,884,256.74
NMC HEALTH PLC	8,090	-	-

	SMITH & NEPHEW PLC	33,906	9.81	332,821.29
	ASTRAZENECA PLC	61,752	102.70	6,341,930.40
	GSK PLC	163,260	13.95	2,278,456.56
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,740	18.04	103,578.30
	BARCLAYS PLC	639,751	1.36	872,236.51
	HSBC HOLDINGS PLC	789,061	6.02	4,751,725.34
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,649,936	0.42	1,124,500.34
	NATWEST GROUP PLC	204,035	1.86	381,443.43
	STANDARD CHARTERED PLC	95,420	6.19	590,840.64
	3I GROUP PLC	40,649	19.93	810,134.57
	ABRDN PLC	88,515	1.68	149,192.03
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	7.50	97,728.12
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	16,267	82.94	1,349,184.98
	M&G PLC	99,522	2.02	201,631.57
	SCHRODERS PLC	30,300	3.93	119,109.30
	ST JAMES'S PLACE PLC	20,540	6.68	137,371.52
	WISE PLC - A	21,400	6.78	145,092.00
	ADMIRAL GROUP PLC	6,795	24.91	169,263.45
	AVIVA PLC	94,524	4.07	384,996.25
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	225,651	2.22	502,524.77
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,230	4.72	142,866.98
	PRUDENTIAL PLC	110,702	8.99	995,653.78
	SAGE GROUP PLC/THE	38,840	9.70	376,748.00
	HALMA PLC	14,690	18.96	278,522.40
	BT GROUP PLC	267,752	1.24	332,414.10
	VODAFONE GROUP PLC	996,528	0.78	784,367.18
	CENTRICA PLC	209,200	1.53	320,703.60
	NATIONAL GRID PLC	140,528	9.96	1,400,783.10
	SEVERN TRENT PLC	9,023	26.93	242,989.39
	SSE PLC	43,667	16.91	738,408.97
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	10.80	282,064.52
英債券小計		11,198,209		71,942,109.76 (13,314,326,253)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,990	13.36	106,746.40
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	612.50	165,375.00
	GIVAUDAN-REG	378	3,057.00	1,155,546.00
	HOLCIM LTD	22,219	58.94	1,309,587.86
	SIG GROUP AG	10,900	20.42	222,578.00
	SIKA AG-REG	5,675	227.80	1,292,765.00
	ABB LTD-REG	61,275	31.12	1,906,878.00
	GEBERIT AG-REG	1,490	472.90	704,621.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,070	181.00	193,670.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	187.95	278,166.00

VAT GROUP AG	1,015	345.70	350,885.50	
ADECCO GROUP AG-REG	6,817	39.84	271,589.28	
SGS SA-REG	5,950	75.96	451,962.00	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,160	242.50	523,800.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	20,559	112.45	2,311,859.55	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,125	240.40	270,450.00	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,950	45.55	88,822.50	
DUFREY AG-REG	3,460	32.89	113,799.40	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	130	1,475.00	191,750.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	40	10,350.00	414,000.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	101,600.00	508,000.00	
NESTLE SA-REG	107,170	99.75	10,690,207.50	
ALCON INC	19,554	67.02	1,310,509.08	
SONOVA HOLDING AG-REG	2,051	225.90	463,320.90	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,370	111.10	485,507.00	
BACHEM HOLDING AG	1,400	69.05	96,670.00	
LONZA GROUP AG-REG	2,973	329.10	978,414.30	
NOVARTIS AG-REG	82,243	83.34	6,854,131.62	
ROCHE HOLDING AG-BR	1,280	252.80	323,584.00	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	28,203	237.25	6,691,161.75	
SANDOZ GROUP AG	16,448	24.26	399,110.72	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,510	102.40	154,624.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	8,420	54.28	457,037.60	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	900	1,007.50	906,750.00	
UBS GROUP AG-REG	132,512	21.98	2,912,613.76	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,740	132.10	229,854.00	
HELVETIA HOLDING AG-REG	1,320	124.80	164,736.00	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,285	589.20	757,122.00	
SWISS RE AG	12,289	99.26	1,219,806.14	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,011	437.30	2,628,610.30	
TEMENOS AG	2,280	66.50	151,620.00	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	71.46	475,923.60	
SWISSCOM AG-REG	1,024	513.80	526,131.20	
BKW AG	840	154.40	129,696.00	
SWISS PRIME SITE-REG	3,441	85.20	293,173.20	
スイスフラン小計	601,882		52,133,166.16 (8,676,522,844)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	10,290	284.20	2,924,418.00
	HOLMEN AB-B SHARES	3,520	423.40	1,490,368.00
	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	22,680	155.25	3,521,070.00
	ALFA LAVAL AB	10,710	365.10	3,910,221.00
	ASSA ABLOY AB-B	42,940	245.50	10,541,770.00
	ATLAS COPCO AB-A SHS	111,390	149.20	16,619,388.00

ATLAS COPCO AB-B SHS	56,870	128.55	7,310,638.50	
BEIJER REF AB	15,480	113.00	1,749,240.00	
EPIROC AB-A	31,565	186.15	5,875,824.75	
EPIROC AB-B	15,450	158.30	2,445,735.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	76.02	1,140,300.00	
INDUTRADE AB	10,180	206.20	2,099,116.00	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	205.20	1,395,360.00	
LIFCO AB-B SHS	8,470	212.60	1,800,722.00	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	63,000	68.96	4,344,480.00	
SAAB AB-B	2,780	575.40	1,599,612.00	
SANDVIK AB	40,890	194.75	7,963,327.50	
SKANSKA AB-B SHS	14,390	153.15	2,203,828.50	
SKF AB-B SHARES-B	14,079	184.55	2,598,279.45	
VOLVO AB-A SHS	9,530	231.80	2,209,054.00	
VOLVO AB-B SHS-B	58,430	225.80	13,193,494.00	
SECURITAS AB-B SHS	17,788	91.90	1,634,717.20	
VOLVO CAR AB-B	20,400	40.98	835,992.00	
EVOLUTION AB	7,140	1,020.20	7,284,228.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,848	160.10	4,458,464.80	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	23,695	255.50	6,054,072.50	
GETINGE AB-B SHS	9,470	207.30	1,963,131.00	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	8,148	231.60	1,887,076.80	
NORDEA BANK ABP	131,132	118.50	15,539,142.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	62,450	124.30	7,762,535.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60,120	97.58	5,866,509.60	
SWEDBANK AB - A SHARES	34,550	183.70	6,346,835.00	
EQT AB	14,450	215.50	3,113,975.00	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	295.90	1,474,765.60	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	294.70	1,762,306.00	
INVESTOR AB-B SHS	69,350	206.70	14,334,645.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	3,590	464.70	1,668,273.00	
ERICSSON LM-B SHS	114,915	50.85	5,843,427.75	
HEXAGON AB-B SHS	80,990	94.50	7,653,555.00	
TELE2 AB-B SHS	23,245	81.82	1,901,905.90	
TELIA CO AB	118,530	24.66	2,922,949.80	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	23,220	54.00	1,253,880.00	
SAGAX AB-B	7,910	221.30	1,750,483.00	
スウェーデンクローナ小計	1,434,349		200,249,116.65 (2,751,422,862)	
ノルウェークローネ				
AKER BP ASA	12,100	313.60	3,794,560.00	
EQUINOR ASA	39,014	366.75	14,308,384.50	
NORSK HYDRO A S	50,660	63.06	3,194,619.60	
YARA INTERNATIONAL ASA	6,670	368.20	2,455,894.00	

	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,900	450.60	1,757,340.00	
	ADEVINTA ASA	11,400	100.60	1,146,840.00	
	MOWI ASA	16,360	180.55	2,953,798.00	
	ORKLA ASA	32,290	77.74	2,510,224.60	
	SALMAR ASA	3,590	535.60	1,922,804.00	
	DNB BANK ASA	35,845	198.95	7,131,362.75	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,410	166.90	1,236,729.00	
	TELENOR ASA	23,915	115.95	2,772,944.25	
ノルウェークローネ小計		243,154		45,185,500.70 (612,263,534)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,840	511.40	1,963,776.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,165	337.50	2,755,687.50	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	315	1,630.50	513,607.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	41,480	161.30	6,690,724.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	115	10,000.00	1,150,000.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	195	10,130.00	1,975,350.00	
	DSV A/S	7,890	1,083.00	8,544,870.00	
	PANDORA A/S	3,310	813.20	2,691,692.00	
	CARLSBERG AS-B	3,910	834.40	3,262,504.00	
	COLOPLAST-B	5,015	763.80	3,830,457.00	
	DEMANT A/S	3,640	275.50	1,002,820.00	
	GENMAB A/S	2,580	2,020.00	5,211,600.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	131,150	683.90	89,693,485.00	
	DANSKE BANK A/S	26,635	167.50	4,461,362.50	
	TRYG A/S	13,945	139.40	1,943,933.00	
ORSTED A/S	7,570	284.00	2,149,880.00		
デンマーククローネ小計		259,755		137,841,748.50 (2,963,597,592)	
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	33.08	290,277.00	
	SANTOS LTD	121,660	7.42	902,717.20	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	75,946	34.01	2,582,923.46	
	BHP GROUP LTD	203,587	45.50	9,263,208.50	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	19.50	357,045.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	65,915	23.23	1,531,205.45	
	IGO LTD	24,300	9.69	235,467.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	16,955	41.10	696,850.50	
	MINERAL RESOURCES LTD	7,320	61.07	447,032.40	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42,190	11.62	490,247.80	
	ORICA LIMITED	17,675	14.92	263,711.00	
	PILBARA MINERALS LTD	114,530	3.75	429,487.50	
	RIO TINTO LTD	14,858	122.60	1,821,590.80	
	SOUTH32 LTD	207,787	3.32	689,852.84	
REECE LTD	10,200	18.37	187,374.00		

	BRAMBLES LTD	54,798	13.45	737,033.10
	COMPUTERSHARE LTD	20,910	25.13	525,468.30
	AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	3.54	260,437.80
	QANTAS AIRWAYS LTD	35,030	5.18	181,455.40
	TRANSURBAN GROUP	129,996	12.36	1,606,750.56
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,520	39.32	924,806.40
	IDP EDUCATION LTD	10,150	23.20	235,480.00
	LOTTERY CORP LTD/THE	85,554	4.60	393,548.40
	REA GROUP LTD	1,820	155.40	282,828.00
	SEEK LTD	12,860	21.80	280,348.00
	WESFARMERS LTD	47,855	52.32	2,503,773.60
	COLES GROUP LTD	57,925	15.45	894,941.25
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	50,462	5.01	252,814.62
	WOOLWORTHS GROUP LTD	49,102	35.50	1,743,121.00
	TREASURY WINE ESTA-RIGHTS(N)	2,953	0.49	1,461.73
	TREASURY WINE ESTATES LTD	27,906	11.04	308,082.24
	COCHLEAR LTD	2,947	247.58	729,618.26
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,105	50.70	360,223.50
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	29.52	521,323.20
	CSL LTD	19,212	244.00	4,687,728.00
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	120,799	25.60	3,092,454.40
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	67,117	99.93	6,707,001.81
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	124,183	29.06	3,608,757.98
	WESTPAC BANKING CORP	140,651	21.50	3,023,996.50
	ASX LTD	7,105	57.04	405,269.20
	MACQUARIE GROUP LTD	14,604	163.24	2,383,956.96
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,370	34.35	287,509.50
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	5.77	548,871.25
	MEDIBANK PRIVATE LTD	108,430	3.46	375,167.80
	QBE INSURANCE GROUP LTD	55,210	15.68	865,692.80
	SUNCORP GROUP LTD	44,036	13.52	595,366.72
	WISETECH GLOBAL LTD	5,920	60.05	355,496.00
	XERO LTD	5,960	112.29	669,248.40
	TELSTRA GROUP LTD	164,284	3.87	635,779.08
	APA GROUP	45,818	8.37	383,496.66
	ORIGIN ENERGY LTD	68,320	8.38	572,521.60
豪ドル小計		2,757,275		62,130,820.47 (6,057,754,995)
ニュージーランド ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,165	7.73	364,821.27
	EBOS GROUP LTD	5,630	37.08	208,760.40
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,130	21.90	506,547.00
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	5.01	383,650.77
	MERCURY NZ LTD	34,100	5.97	203,577.00

	MERIDIAN ENERGY LTD	57,830	5.00	289,150.00	
ニュージーランドドル小計		244,432		1,956,506.44 (175,400,802)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	103,208	40.85	4,216,046.80	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	52,500	74.45	3,908,625.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	71,000	9.28	658,880.00	
	MTR CORP	62,500	30.40	1,900,000.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	12.48	648,960.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	91,000	44.80	4,076,800.00	
	SANDS CHINA LTD	96,600	21.55	2,081,730.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	15.34	1,041,586.00	
	WH GROUP LTD	299,894	4.70	1,409,501.80	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	148,000	21.40	3,167,200.00	
	HANG SENG BANK LTD	29,100	91.70	2,668,470.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	48,300	285.60	13,794,480.00	
	AIA GROUP LTD	460,390	70.90	32,641,651.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	8.32	1,248,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	37.95	948,750.00	
	CLP HOLDINGS LTD	63,000	58.95	3,713,850.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	456,237	5.67	2,586,863.79	
	POWER ASSETS HOLDINGS	58,000	39.85	2,311,300.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	80,538	39.50	3,181,251.00	
	ESR GROUP LTD	75,800	10.28	779,224.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	10.74	837,720.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	22.20	1,285,402.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	61,666	15.46	953,356.36	
SINO LAND CO	123,050	8.18	1,006,549.00		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,480	84.80	5,128,704.00		
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	17,517	50.95	892,491.15		
SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	15.56	647,296.00		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	28.10	1,792,780.00		
香港ドル小計		2,994,981		99,527,468.10 (1,903,960,464)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	68,560	6.41	439,469.60	
	SEATRUM LTD	1,488,177	0.11	166,675.82	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	63,300	3.91	247,503.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	6.21	334,719.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.87	184,712.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	3.64	269,214.40	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	71,195	33.29	2,370,081.55	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	134,240	13.01	1,746,462.40	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	49,900	27.71	1,382,729.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	9.53	405,025.00	



	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	354,480	2.45	868,476.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	30,200	4.84	146,168.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	105,000	3.07	322,350.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	6.46	111,758.00	
	UOL GROUP LTD	15,550	5.99	93,144.50	
シンガポールドル小計		2,779,362		9,088,488.77 (1,005,459,512)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	26,090	19.98	521,278.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,010	740.00	747,400.00	
	BANK HAPOLIM BM	50,495	30.58	1,544,137.10	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	62,565	28.25	1,767,461.25	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	48,330	19.05	920,686.50	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,900	135.20	932,880.00	
	NICE LTD	2,440	660.00	1,610,400.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,780	190.50	339,090.00	
イスラエルシュケル小計		199,610		8,383,333.05 (319,824,994)	
合 計		45,190,808		302,865,738,679 (302,865,738,679)	

(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	6,910	707,031.20	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	12,110	428,815.10	
		AMERICAN TOWER CORP	18,549	3,534,882.93	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	18,847	323,791.46	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,790	991,942.80	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,717	336,788.47	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,810	435,641.70	
		CROWN CASTLE INC	16,330	1,606,872.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,695	1,554,616.35	
		EQUINIX INC	3,728	2,873,393.28	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,550	444,548.50	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	15,450	860,874.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	538,804.80	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,800	941,336.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,340	524,475.00	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	14,810	220,669.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	350,653.75	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	27,179	455,520.04	
		INVITATION HOMES INC	25,700	821,629.00	
		IRON MOUNTAIN INC	13,365	825,288.75	

		KIMCO REALTY CORP	23,760	445,500.00
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,300	534,318.00
		NET LEASE OFFICE PROPERTY(N)	574	7,416.08
		PROLOGIS INC	37,145	3,957,799.75
		PUBLIC STORAGE	6,319	1,600,349.94
		REALTY INCOME CORP	28,201	1,434,020.85
		REGENCY CENTERS CORP	6,005	376,753.70
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,175	948,100.75
		SIMON PROPERTY GROUP INC	13,394	1,579,018.66
		SUN COMMUNITIES INC	4,640	554,665.60
		UDR INC	12,100	402,567.00
		VENTAS INC	17,025	750,462.00
		VICI PROPERTIES INC	39,120	1,141,130.40
		WELLTOWER INC	20,360	1,800,842.00
		WEYERHAEUSER CO	29,998	932,637.82
		WP CAREY INC	8,610	474,152.70
米ドル小計			506,261	35,717,309.38 (5,345,809,694)
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	128,100.00
加ドル小計			2,800	128,100.00 (14,032,074)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	85,701.00
		GECINA SA	1,950	194,512.50
		KLEPIERRE	8,402	205,260.86
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,990	262,873.20
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,730	198,042.60
ユーロ小計			24,997	946,390.16 (151,876,692)
英ポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	164,110.33
		SEGRO PLC	45,033	352,878.58
英ポンド小計			71,657	516,988.91 (95,679,137)
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	42,067	289,841.63
		GOODMAN GROUP	70,642	1,556,949.68
		GPT GROUP	71,335	277,493.15
		LENDLEASE GROUP	23,367	149,081.46
		MIRVAC GROUP	159,875	310,956.87
		SCENTRE GROUP	198,271	511,539.18
		STOCKLAND	102,400	381,952.00
		VICINITY CENTRES	154,902	278,049.09
豪ドル小計			822,859	3,755,863.06 (366,196,648)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	104,160	4,135,152.00
			104,160	4,135,152.00

香港ドル小計				(79,105,457)
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,243	373,256.10
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	385,583.04
		KEPPEL REIT(N)	13,712	11,312.40
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	144,556	222,616.24
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	106,000	144,160.00
シンガポールドル小計			612,067	1,136,927.78 (125,778,320)
合計				6,178,478,022 (6,178,478,022)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)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	97.7%		73.2%
	投資証券 36銘柄		2.3%	1.7%
加ドル	株式 86銘柄	99.9%		3.4%
	投資証券 1銘柄		0.1%	0.0%
ユーロ	株式 219銘柄	99.5%		9.3%
	投資証券 5銘柄		0.5%	0.0%
英ポンド	株式 82銘柄	99.3%		4.3%
	投資証券 2銘柄		0.7%	0.0%
スイスフラン	株式 45銘柄	100.0%		2.8%
スウェーデンクローナ	株式 43銘柄	100.0%		0.9%
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%		1.0%
豪ドル	株式 51銘柄	94.3%		2.0%
	投資証券 8銘柄		5.7%	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	96.0%		0.6%
	投資証券 1銘柄		4.0%	0.0%
シンガポールドル	株式 15銘柄	88.9%		0.3%
	投資証券 5銘柄		11.1%	0.0%
イスラエルシケル	株式 8銘柄	100.0%		0.1%

### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

### 日本債券インデックスマザーファンド

### 貸借対照表

(単位:円)

2022年11月 7日現在

2023年11月 6日現在

資産の部

2022年11月 7日現在

2023年11月 6日現在

流動資産		
コール・ローン	135,028,907	53,075,666
国債証券	40,125,576,710	44,231,096,480
地方債証券	3,456,279,410	2,727,118,380
特殊債券	3,529,893,000	2,500,538,000
社債券	603,587,000	1,295,094,000
未収利息	93,944,383	102,092,835
前払費用	777,937	1,936,952
流動資産合計	47,945,087,347	50,910,952,313
資産合計		
	47,945,087,347	50,910,952,313
負債の部		
流動負債		
未払解約金	20,543,058	22,903,111
未払利息	201	9
流動負債合計	20,543,259	22,903,120
負債合計		
	20,543,259	22,903,120
純資産の部		
元本等		
元本	35,316,879,855	38,488,019,140
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	12,607,664,233	12,400,030,053
元本等合計	47,924,544,088	50,888,049,193
純資産合計		
	47,924,544,088	50,888,049,193
負債純資産合計		
	47,945,087,347	50,910,952,313

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

		2022年11月 7日現在	2023年11月 6日現在
1.	期首	2021年11月 9日	2022年11月 8日
	期首元本額	34,595,028,808円	35,316,879,855円
	期首からの追加設定元本額	4,280,220,487円	4,833,830,321円
	期首からの一部解約元本額	3,558,369,440円	1,662,691,036円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス(株式20)	4,858,706,532円	5,699,306,266円
	DCインデックスバランス(株式40)	4,506,974,026円	5,467,907,582円
	DCインデックスバランス(株式60)	3,330,997,716円	4,301,495,149円
	DCインデックスバランス(株式80)	546,153,242円	771,286,086円
	インデックスファンド日本債券(DC専用)	2,213,868,321円	2,209,100,357円
	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	4,491,668,687円	4,634,497,139円
	インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	1,615,057,133円	1,729,528,043円
	Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	- 円	15,166,730円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数(均等型)	- 円	1,006,379円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数(安定成長型)	- 円	1,134,007円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	3,381,046,243円	3,086,148,563円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,483,723,424円	1,573,090,800円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,428,807,915円	1,582,207,086円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	810,580,735円	932,525,480円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	119,645,043円	140,336,480円
インデックスファンド日本債券（1年決算型）	6,156,699,546円	5,934,750,434円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	372,951,292円	408,532,559円
計	35,316,879,855円	38,488,019,140円
2. 受益権の総数	35,316,879,855口	38,488,019,140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11月 9日 至 2022年11月 7日	自 2022年11月 8日 至 2023年11月 6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11月 7日現在	2023年11月 6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11月 7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	92,048,340
地方債証券	124,760
特殊債券	1,274,000
社債券	44,000
合計	93,403,100

（2023年11月 6日現在）

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	61,537,000
地方債証券	1,592,020
特殊債券	2,736,000
社債券	1,355,000
合計	55,853,980

(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11月 7日現在		2023年11月 6日現在
1口当たり純資産額	1.3570円	1口当たり純資産額	1.3222円
(1万口当たり純資産額)	(13,570円)	(1万口当たり純資産額)	(13,222円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第449回利付国債(2年)	80,000,000	79,956,000	
	第450回利付国債(2年)	200,000,000	199,850,000	
	第451回利付国債(2年)	50,000,000	49,969,500	
	第149回利付国債(5年)	100,000,000	99,486,000	
	第150回利付国債(5年)	50,000,000	49,682,500	
	第152回利付国債(5年)	100,000,000	99,532,000	
	第153回利付国債(5年)	300,000,000	297,150,000	
	第157回利付国債(5年)	120,000,000	119,199,600	
	第158回利付国債(5年)	180,000,000	178,027,200	
	第159回利付国債(5年)	120,000,000	118,448,400	
	第160回利付国債(5年)	120,000,000	118,992,000	
	第1回利付国債(40年)	70,000,000	79,330,300	
	第2回利付国債(40年)	125,000,000	136,317,500	
	第3回利付国債(40年)	85,000,000	92,484,250	
	第4回利付国債(40年)	95,000,000	103,291,600	
	第5回利付国債(40年)	95,000,000	99,218,950	
	第6回利付国債(40年)	110,000,000	112,328,700	
	第7回利付国債(40年)	130,000,000	126,577,100	
	第8回利付国債(40年)	115,000,000	103,495,400	
	第9回利付国債(40年)	180,000,000	117,527,400	
	第10回利付国債(40年)	175,000,000	134,592,500	
第11回利付国債(40年)	140,000,000	103,362,000		
第12回利付国債(40年)	175,000,000	114,460,500		
第13回利付国債(40年)	180,000,000	116,416,800		

第14回利付国債(40年)	190,000,000	131,419,200	
第15回利付国債(40年)	210,000,000	160,238,400	
第16回利付国債(40年)	70,000,000	58,499,000	
第336回利付国債(10年)	180,000,000	181,035,000	
第337回利付国債(10年)	230,000,000	230,809,600	
第338回利付国債(10年)	390,000,000	392,047,500	
第339回利付国債(10年)	570,000,000	573,357,300	
第340回利付国債(10年)	620,000,000	623,701,400	
第341回利付国債(10年)	700,000,000	702,884,000	
第342回利付国債(10年)	630,000,000	629,477,100	
第343回利付国債(10年)	645,000,000	643,987,350	
第344回利付国債(10年)	700,000,000	698,299,000	
第345回利付国債(10年)	660,000,000	657,749,400	
第346回利付国債(10年)	660,000,000	656,911,200	
第347回利付国債(10年)	680,000,000	675,858,800	
第348回利付国債(10年)	500,000,000	496,270,000	
第349回利付国債(10年)	590,000,000	584,601,500	
第350回利付国債(10年)	540,000,000	534,081,600	
第351回利付国債(10年)	535,000,000	528,082,450	
第352回利付国債(10年)	520,000,000	512,179,200	
第353回利付国債(10年)	400,000,000	393,388,000	
第354回利付国債(10年)	325,000,000	319,039,500	
第355回利付国債(10年)	350,000,000	342,912,500	
第356回利付国債(10年)	350,000,000	342,212,500	
第357回利付国債(10年)	560,000,000	546,212,800	
第358回利付国債(10年)	590,000,000	574,022,800	
第359回利付国債(10年)	420,000,000	407,542,800	
第360回利付国債(10年)	580,000,000	561,051,400	
第361回利付国債(10年)	460,000,000	443,389,400	
第362回利付国債(10年)	400,000,000	383,996,000	
第363回利付国債(10年)	500,000,000	478,305,000	
第364回利付国債(10年)	500,000,000	476,560,000	
第365回利付国債(10年)	350,000,000	332,335,500	
第366回利付国債(10年)	400,000,000	381,780,000	
第367回利付国債(10年)	360,000,000	342,450,000	
第368回利付国債(10年)	390,000,000	369,856,500	
第369回利付国債(10年)	390,000,000	378,927,900	
第370回利付国債(10年)	420,000,000	407,248,800	
第371回利付国債(10年)	290,000,000	278,025,900	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	56,685,500	
第3回利付国債(30年)	70,000,000	77,870,800	
第5回利付国債(30年)	80,000,000	88,934,400	

第6回利付国債(30年)	50,000,000	56,509,500	
第8回利付国債(30年)	170,000,000	184,565,600	
第9回利付国債(30年)	70,000,000	73,537,800	
第11回利付国債(30年)	170,000,000	183,333,100	
第13回利付国債(30年)	180,000,000	199,470,600	
第14回利付国債(30年)	108,000,000	123,945,120	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	170,286,270	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	40,604,200	
第17回利付国債(30年)	50,000,000	57,492,500	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	125,424,200	
第19回利付国債(30年)	40,000,000	45,601,600	
第20回利付国債(30年)	40,000,000	46,513,600	
第21回利付国債(30年)	70,000,000	79,835,000	
第22回利付国債(30年)	70,000,000	81,419,100	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	63,991,400	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	79,177,840	
第25回利付国債(30年)	60,000,000	68,371,200	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	195,748,200	
第27回利付国債(30年)	89,000,000	103,618,250	
第28回利付国債(30年)	144,000,000	167,551,200	
第29回利付国債(30年)	176,000,000	202,264,480	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	166,571,580	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	134,030,400	
第32回利付国債(30年)	160,000,000	180,614,400	
第33回利付国債(30年)	175,000,000	189,197,750	
第34回利付国債(30年)	160,000,000	177,259,200	
第35回利付国債(30年)	193,000,000	207,621,680	
第36回利付国債(30年)	195,000,000	209,338,350	
第37回利付国債(30年)	211,000,000	222,754,810	
第38回利付国債(30年)	165,000,000	170,761,800	
第39回利付国債(30年)	165,000,000	173,294,550	
第40回利付国債(30年)	130,000,000	134,121,000	
第41回利付国債(30年)	160,000,000	162,064,000	
第42回利付国債(30年)	135,000,000	136,653,750	
第43回利付国債(30年)	155,000,000	156,674,000	
第44回利付国債(30年)	150,000,000	151,516,500	
第45回利付国債(30年)	120,000,000	116,814,000	
第46回利付国債(30年)	160,000,000	155,472,000	
第47回利付国債(30年)	125,000,000	123,511,250	
第48回利付国債(30年)	85,000,000	80,805,250	
第49回利付国債(30年)	140,000,000	132,820,800	
第50回利付国債(30年)	145,000,000	121,202,600	



第5 1 回利付国債(30年)	140,000,000	103,500,600	
第5 2 回利付国債(30年)	130,000,000	100,664,200	
第5 3 回利付国債(30年)	105,000,000	83,007,750	
第5 4 回利付国債(30年)	110,000,000	90,934,800	
第5 5 回利付国債(30年)	110,000,000	90,643,300	
第5 6 回利付国債(30年)	140,000,000	114,993,200	
第5 7 回利付国債(30年)	190,000,000	155,560,600	
第5 8 回利付国債(30年)	140,000,000	114,255,400	
第5 9 回利付国債(30年)	170,000,000	134,879,700	
第6 0 回利付国債(30年)	120,000,000	99,649,200	
第6 1 回利付国債(30年)	100,000,000	78,726,000	
第6 2 回利付国債(30年)	120,000,000	89,258,400	
第6 3 回利付国債(30年)	120,000,000	86,380,800	
第6 4 回利付国債(30年)	100,000,000	71,684,000	
第6 5 回利付国債(30年)	110,000,000	78,524,600	
第6 6 回利付国債(30年)	180,000,000	127,855,800	
第6 7 回利付国債(30年)	110,000,000	82,461,500	
第6 8 回利付国債(30年)	140,000,000	104,556,200	
第6 9 回利付国債(30年)	110,000,000	84,264,400	
第7 0 回利付国債(30年)	110,000,000	84,040,000	
第7 1 回利付国債(30年)	120,000,000	91,432,800	
第7 2 回利付国債(30年)	160,000,000	121,582,400	
第7 3 回利付国債(30年)	150,000,000	113,677,500	
第7 4 回利付国債(30年)	130,000,000	106,956,200	
第7 5 回利付国債(30年)	180,000,000	159,831,000	
第7 6 回利付国債(30年)	150,000,000	136,398,000	
第7 7 回利付国債(30年)	160,000,000	152,574,400	
第7 8 回利付国債(30年)	150,000,000	136,119,000	
第7 9 回利付国債(30年)	100,000,000	86,162,000	
第7 3 回利付国債(20年)	113,000,000	115,544,760	
第7 4 回利付国債(20年)	118,000,000	120,789,520	
第7 5 回利付国債(20年)	10,000,000	10,284,400	
第7 6 回利付国債(20年)	21,000,000	21,539,910	
第7 7 回利付国債(20年)	40,000,000	41,082,800	
第7 9 回利付国債(20年)	160,000,000	165,078,400	
第8 2 回利付国債(20年)	60,000,000	62,260,800	
第8 7 回利付国債(20年)	130,000,000	136,342,700	
第8 8 回利付国債(20年)	300,000,000	316,767,000	
第9 0 回利付国債(20年)	16,000,000	16,922,240	
第9 1 回利付国債(20年)	250,000,000	265,122,500	
第9 2 回利付国債(20年)	60,000,000	63,522,000	
第9 3 回利付国債(20年)	60,000,000	63,534,600	

第94回利付国債(20年)	50,000,000	53,112,500	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	87,992,560	
第96回利付国債(20年)	248,000,000	264,348,160	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	48,297,150	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	100,527,360	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	125,489,520	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	32,399,700	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	71,846,940	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	88,462,530	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	11,963,600	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	35,591,160	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	83,230,840	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,171,380	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	141,012,300	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	144,007,120	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	29,080,890	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	106,580,880	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	27,404,000	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	87,254,400	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	317,086,000	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	56,972,240	
第115回利付国債(20年)	125,000,000	137,695,000	
第116回利付国債(20年)	135,000,000	149,062,950	
第117回利付国債(20年)	343,000,000	376,617,430	
第118回利付国債(20年)	70,000,000	76,552,700	
第119回利付国債(20年)	60,000,000	64,829,400	
第120回利付国債(20年)	170,000,000	181,510,700	
第121回利付国債(20年)	22,000,000	23,941,720	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	18,388,050	
第123回利付国債(20年)	195,000,000	215,040,150	
第124回利付国債(20年)	90,000,000	98,634,600	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	55,544,000	
第126回利付国債(20年)	105,000,000	115,123,050	
第127回利付国債(20年)	50,000,000	54,469,000	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	70,844,800	
第129回利付国債(20年)	85,000,000	92,026,950	
第130回利付国債(20年)	150,000,000	162,426,000	
第131回利付国債(20年)	92,000,000	98,934,040	
第132回利付国債(20年)	135,000,000	145,146,600	
第133回利付国債(20年)	110,000,000	119,156,400	
第134回利付国債(20年)	120,000,000	130,070,400	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	32,268,300	

第136回利付国債(20年)	220,000,000	234,902,800	
第137回利付国債(20年)	200,000,000	215,202,000	
第138回利付国債(20年)	120,000,000	127,129,200	
第139回利付国債(20年)	230,000,000	245,621,600	
第140回利付国債(20年)	318,000,000	342,406,500	
第141回利付国債(20年)	235,000,000	253,078,550	
第142回利付国債(20年)	165,000,000	179,097,600	
第143回利付国債(20年)	94,000,000	100,463,440	
第144回利付国債(20年)	330,000,000	349,664,700	
第145回利付国債(20年)	315,000,000	339,705,450	
第146回利付国債(20年)	195,000,000	210,282,150	
第147回利付国債(20年)	208,000,000	222,428,960	
第148回利付国債(20年)	180,000,000	190,598,400	
第149回利付国債(20年)	185,000,000	195,661,550	
第150回利付国債(20年)	210,000,000	219,741,900	
第151回利付国債(20年)	240,000,000	245,661,600	
第152回利付国債(20年)	250,000,000	255,492,500	
第153回利付国債(20年)	270,000,000	278,283,600	
第154回利付国債(20年)	160,000,000	162,875,200	
第155回利付国債(20年)	270,000,000	268,115,400	
第156回利付国債(20年)	160,000,000	147,328,000	
第157回利付国債(20年)	150,000,000	134,004,000	
第158回利付国債(20年)	170,000,000	157,260,200	
第159回利付国債(20年)	150,000,000	139,957,500	
第160回利付国債(20年)	140,000,000	131,861,800	
第161回利付国債(20年)	120,000,000	111,117,600	
第162回利付国債(20年)	150,000,000	138,312,000	
第163回利付国債(20年)	165,000,000	151,493,100	
第164回利付国債(20年)	255,000,000	229,749,900	
第165回利付国債(20年)	170,000,000	152,452,600	
第166回利付国債(20年)	150,000,000	137,926,500	
第167回利付国債(20年)	160,000,000	142,121,600	
第168回利付国債(20年)	140,000,000	121,835,000	
第169回利付国債(20年)	160,000,000	136,224,000	
第170回利付国債(20年)	140,000,000	118,542,200	
第171回利付国債(20年)	170,000,000	143,148,500	
第172回利付国債(20年)	230,000,000	195,985,300	
第173回利付国債(20年)	190,000,000	160,914,800	
第174回利付国債(20年)	200,000,000	168,454,000	
第175回利付国債(20年)	180,000,000	153,496,800	
第176回利付国債(20年)	190,000,000	161,270,100	
第177回利付国債(20年)	200,000,000	165,876,000	

	第178回利付国債(20年)	220,000,000	185,086,000	
	第179回利付国債(20年)	190,000,000	159,079,400	
	第180回利付国債(20年)	190,000,000	167,591,400	
	第181回利付国債(20年)	190,000,000	170,067,100	
	第182回利付国債(20年)	200,000,000	184,970,000	
	第183回利付国債(20年)	190,000,000	184,571,700	
	第184回利付国債(20年)	170,000,000	156,163,700	
	第185回利付国債(20年)	130,000,000	119,050,100	
国債証券 合計		45,217,000,000	44,231,096,480	
地方債証券	第4回東京都公募公債(東京グリーンbond(5年))	100,000,000	99,674,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	102,546,000	
	第32回東京都公募公債(5年)	200,000,000	199,562,000	
	第739回東京都公募公債	100,000,000	100,201,000	
	第744回東京都公募公債	100,000,000	100,689,000	
	令和2年度第2回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,782,000	
	令和3年度第6回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,188,000	
	第214回神奈川県公募公債	100,000,000	100,658,000	
	平成27年度第10回静岡県公募公債	200,000,000	200,990,000	
	平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	102,963,000	
	平成26年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	100,397,000	
	第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,430,000	
	第142回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,546,000	
	第144回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,461,000	
	第147回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,640,000	
	第165回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,822,000	
	平成28年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	99,412,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	100,543,000	
	平成29年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	99,002,000	
	平成27年度第2回熊本県公募公債(10年)	100,000,000	100,538,000	
	第2回名古屋市定時償還公募公債(10年)	20,000,000	20,023,580	
	平成27年度第5回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	100,511,000	
	令和元年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	99,900,800	
	令和2年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	99,639,000	
地方債証券 合計		2,720,000,000	2,727,118,380	
特殊債券	第5回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	99,362,000	
	第13回新関西国際空港株式会社債(一般担保付)	200,000,000	200,728,000	
	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	198,498,000	
	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	98,996,000	
	第28回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,460,000	
	第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,458,000	

	第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,364,000	
	第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,401,000	
	第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,456,000	
	第324回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	197,696,000	
	第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,456,000	
	第69回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,395,000	
	第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,288,000	
	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,182,000	
	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	197,930,000	
	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	98,347,000	
	第363回信金中金債(5年)	100,000,000	99,758,000	
	第395回信金中金債(5年)	100,000,000	98,832,000	
	第29回国際協力機構債券	100,000,000	100,626,000	
	第37回国際協力機構債券	100,000,000	99,305,000	
	特殊債券 合計	2,500,000,000	2,500,538,000	
社債券	第25回西日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人日本高速道路保有・債務返済機構重畳の債務引受条項付)	100,000,000	100,395,000	
	第22回味の素株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,848,000	
	第25回味の素株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,524,000	
	第10回株式会社資生堂無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,749,000	
	第14回株式会社小松製作所無担保社債(社債間限定同順位特約付)(グリーンボンド)	100,000,000	99,688,000	
	第11回株式会社セブン銀行無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,299,000	
	第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,569,000	
	第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,771,000	
	第510回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	99,230,000	
	第552回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	99,999,000	
	第400回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	98,640,000	
	第447回中国電力株式会社社債(一般担保付)(トランジションボンド)	100,000,000	98,553,000	
	第31回沖縄電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	99,829,000	
	社債券 合計	1,300,000,000	1,295,094,000	
	合計	51,737,000,000	50,753,846,860	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

## 貸借対照表

	（単位：円）	
	2022年11月 7日現在	2023年11月 6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	266,835,444	1,963,583,952
コール・ローン	179,752,195	45,069,283
国債証券	149,367,586,551	157,183,727,561
派生商品評価勘定	124,670	690,022
未収入金	275,679,970	800,413,612
未収利息	1,051,286,225	1,214,002,062
前払費用	56,469,670	68,585,401
流動資産合計	151,197,734,725	161,276,071,893
<b>資産合計</b>		
151,197,734,725		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	55,382	943,122
未払金	138,770,725	1,989,822,440
未払解約金	180,846,213	112,706,558
未払利息	268	8
流動負債合計	319,672,588	2,103,472,128
<b>負債合計</b>		
319,672,588		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	57,628,255,000	57,347,654,284
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	93,249,807,137	101,824,945,481
元本等合計	150,878,062,137	159,172,599,765
<b>純資産合計</b>		
150,878,062,137		
<b>負債純資産合計</b>		
151,197,734,725		

## 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	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11月 7日現在	2023年11月 6日現在
1. 期首	2021年11月 9日	2022年11月 8日
期首元本額	61,717,731,067円	57,628,255,000円
期首からの追加設定元本額	3,307,523,614円	3,684,113,225円

	2022年11月 7日現在	2023年11月 6日現在
期首からの一部解約元本額	7,396,999,681円	3,964,713,941円
元本の内訳		
インデックスファンド海外債券ヘッジなし(DC専用)	16,907,701,488円	19,054,612,382円
DCインデックスバランス(株式20)	387,561,022円	425,904,195円
DCインデックスバランス(株式40)	516,414,415円	594,134,856円
DCインデックスバランス(株式60)	686,650,231円	843,157,789円
DCインデックスバランス(株式80)	563,858,699円	756,892,528円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	16,948,433,274円	15,235,825,730円
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	2,353,916,341円	2,317,476,763円
日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	13,124,592,945円	12,115,610,099円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	835,736,924円	891,153,176円
インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	144,328,916円	143,812,763円
財産3分法(適格機関投資家専用)	206,936,247円	316,094,680円
Niつみインデックスラップ世界10指数(均等型)	-円	493,149円
Niつみインデックスラップ世界10指数(安定成長型)	-円	1,103,924円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)奇数月分配型	-円	591,254円
世界国債インデックスファンド(適格機関投資家向け)	173,659,188円	-円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	586,753,405円	501,546,917円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	58,688,504円	58,964,858円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	82,520,263円	86,274,514円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	84,390,583円	91,631,913円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	61,970,216円	68,085,097円
インデックスファンド海外債券(ヘッジなし)1年決算型	3,604,624,434円	3,510,456,517円
海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	299,517,905円	333,831,180円
計	57,628,255,000円	57,347,654,284円
2. 受益権の総数	57,628,255,000口	57,347,654,284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11月 9日 至 2022年11月 7日	自 2022年11月 8日 至 2023年11月 6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11月 7日現在	2023年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(1)有価証券  同左

	2022年11月 7日現在	2023年11月 6日現在
	(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2022年11月 7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	455,830,341
合計	455,830,341

(2023年11月 6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	2,907,841,616
合計	2,907,841,616

(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11月 7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	353,544,021	-	353,474,733	69,288
	米ドル	227,937,705	-	227,837,830	99,875
	加ドル	7,064,674	-	7,065,240	566
	メキシコペソ	7,307,809	-	7,316,006	8,197
	ユーロ	92,566,219	-	92,583,020	16,801
	英ポンド	11,656,785	-	11,657,590	805
	デンマーククローネ	7,010,829	-	7,015,047	4,218
合計	353,544,021	-	353,474,733	69,288	

(2023年11月 6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	54,008,946	-	54,402,436	393,490



	英ポンド	54,008,946	-	54,402,436	393,490
	売建	690,098,354	-	690,744,944	646,590
	米ドル	323,442,360	-	323,150,868	291,492
	加ドル	14,668,202	-	14,672,062	3,860
	メキシコペソ	28,940,123	-	29,625,723	685,600
	ユーロ	236,256,090	-	236,303,079	46,989
	英ポンド	29,595,520	-	29,597,920	2,400
	ポーランドズロチ	48,445,238	-	48,643,025	197,787
	豪ドル	8,750,821	-	8,752,267	1,446
	合計	744,107,300	-	745,147,380	253,100

## (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11月 7日現在		2023年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	2.6181円	1口当たり純資産額	2.7756円
(1万口当たり純資産額)	(26,181円)	(1万口当たり純資産額)	(27,756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-2.25%-24/10/31	5,190,000.00	5,040,419.01	
		US TREASURY N/B-1.5%-24/10/31	2,140,000.00	2,063,024.20	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	4,650,000.00	4,511,267.25	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,400,000.00	1,354,514.00	
		US TREASURY N/B-1.5%-24/11/30	3,470,000.00	3,335,436.87	
		US TREASURY N/B-4.5%-24/11/30	2,150,000.00	2,132,471.05	
		US TREASURY N/B-1.0%-24/12/15	2,450,000.00	2,339,365.35	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	1,837,803.50	
		US TREASURY N/B-1.75%-24/12/31	1,300,000.00	1,250,284.10	
		US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,452,744.00	
		US TREASURY N/B-1.375%-25/01/31	3,510,000.00	3,353,215.32	

US TREASURY N/B-4.125%-25/01/31	1,190,000.00	1,175,520.08
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,530,000.00	4,356,582.54
US TREASURY N/B-1.5%-25/02/15	3,000,000.00	2,866,932.00
US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	1,998,037.26
US TREASURY N/B-1.125%-25/02/28	5,740,000.00	5,450,864.72
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	2,010,000.00	1,943,770.50
US TREASURY N/B-0.5%-25/03/31	3,470,000.00	3,257,188.37
US TREASURY N/B-2.625%-25/04/15	2,600,000.00	2,512,806.40
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,132,495.20
US TREASURY N/B-0.375%-25/04/30	2,150,000.00	2,008,276.30
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	3,800,000.00	3,641,688.20
US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,420,000.00	1,375,319.70
US TREASURY N/B-0.25%-25/05/31	3,820,000.00	3,549,165.82
US TREASURY N/B-2.875%-25/06/15	5,000,000.00	4,838,670.00
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	1,370,000.00	1,322,450.04
US TREASURY N/B-3.0%-25/07/15	5,000,000.00	4,843,355.00
US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	1,440,000.00	1,391,146.56
US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	3,000,000.00	2,768,670.00
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	4,730,000.00	4,498,395.55
US TREASURY N/B-2.75%-25/08/31	3,000,000.00	2,887,851.00
US TREASURY N/B-5.0%-25/08/31	5,000,000.00	5,008,200.00
US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	4,200,000.00	4,057,590.60
US TREASURY N/B-0.25%-25/09/30	1,570,000.00	1,440,228.51
US TREASURY N/B-4.25%-25/10/15	170,000.00	168,040.92
US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,351,218.40
US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	2,110,000.00	1,928,423.95
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	3,440,000.00	3,269,341.60
US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,269,829.44
US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	3,420,000.00	3,124,488.06
US TREASURY N/B-4.0%-25/12/15	210,000.00	206,579.10
US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	1,911,874.00
US TREASURY N/B-3.875%-26/01/15	1,150,000.00	1,128,437.50
US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	1,766,387.40
US TREASURY N/B-0.375%-26/01/31	3,000,000.00	2,722,968.00
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	1,845,070.20
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,310,000.00	3,087,478.63
US TREASURY N/B-4.0%-26/02/15	3,000,000.00	2,950,194.00
US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,702,456.47
US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	3,650,000.00	3,313,086.75
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	1,955,179.17
US TREASURY N/B-0.75%-26/03/31	2,400,000.00	2,187,655.20
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	1,050,000.00	993,192.90

US TREASURY N/B-0.75%-26/04/30	2,740,000.00	2,488,583.08
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	4,840,000.00	4,487,396.32
US TREASURY N/B-3.625%-26/05/15	6,750,000.00	6,577,821.00
US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	2,740,000.00	2,570,889.94
US TREASURY N/B-0.75%-26/05/31	2,800,000.00	2,535,419.60
US TREASURY N/B-4.125%-26/06/15	3,000,000.00	2,958,750.00
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	1,863,124.00
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	960,000.00	891,936.96
US TREASURY N/B-0.625%-26/07/31	3,260,000.00	2,926,867.12
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,673,904.00
US TREASURY N/B-0.75%-26/08/31	3,000,000.00	2,694,492.00
US TREASURY N/B-4.625%-26/09/15	2,600,000.00	2,598,780.60
US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,490,400.00
US TREASURY N/B-0.875%-26/09/30	2,000,000.00	1,800,234.00
US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	250,000.00	229,267.50
US TREASURY N/B-1.125%-26/10/31	3,950,000.00	3,569,500.45
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,040,000.00	2,816,748.48
US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,400,000.00	2,196,890.40
US TREASURY N/B-1.25%-26/11/30	2,210,000.00	1,999,616.84
US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	1,834,140.00
US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	4,000,000.00	3,631,328.00
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	2,680,000.00	2,490,829.52
US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,530,000.00	1,369,229.13
US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	950,000.00	832,696.85
US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	2,450,000.00	2,130,637.60
US TREASURY N/B-2.75%-27/04/30	1,430,000.00	1,345,987.50
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,277,795.62
US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	2,100,000.00	1,820,683.20
US TREASURY N/B-2.625%-27/05/31	1,750,000.00	1,637,889.75
US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	3,100,000.00	2,679,562.50
US TREASURY N/B-3.25%-27/06/30	5,000,000.00	4,779,880.00
US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	7,000,000.00	6,001,128.00
US TREASURY N/B-2.75%-27/07/31	930,000.00	872,165.16
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	2,724,123.52
US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	4,100,000.00	3,521,432.60
US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	4,090,000.00	3,483,686.13
US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	3,860,000.00	3,294,567.90
US TREASURY N/B-4.125%-27/10/31	800,000.00	787,343.20
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	1,400,000.00	1,479,843.40
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	2,766,365.30
US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	220,000.00	188,220.12
US TREASURY N/B-3.875%-27/11/30	2,320,000.00	2,261,953.60
US TREASURY N/B-0.625%-27/12/31	3,960,000.00	3,377,986.92

US TREASURY N/B-0.75%-28/01/31	2,850,000.00	2,437,083.45
US TREASURY N/B-3.5%-28/01/31	1,450,000.00	1,392,395.85
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	3,724,372.00
US TREASURY N/B-1.125%-28/02/29	3,830,000.00	3,322,823.74
US TREASURY N/B-4.0%-28/02/29	2,650,000.00	2,595,653.80
US TREASURY N/B-1.25%-28/03/31	960,000.00	835,200.00
US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	3,370,000.00	2,926,369.83
US TREASURY N/B-3.5%-28/04/30	3,000,000.00	2,877,303.00
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	2,440,000.00	2,276,061.28
US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	4,300,000.00	3,721,344.70
US TREASURY N/B-3.625%-28/05/31	1,020,000.00	983,383.02
US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	3,300,000.00	2,849,728.20
US TREASURY N/B-4.0%-28/06/30	200,000.00	195,777.20
US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	2,920,000.00	2,484,108.24
US TREASURY N/B-4.125%-28/07/31	5,950,000.00	5,853,889.65
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	3,902,635.80
US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	2,960,000.00	2,527,040.80
US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	4,000,000.00	3,425,544.00
US TREASURY N/B-1.375%-28/10/31	3,800,000.00	3,268,961.40
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,103,854.80
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	2,610,000.00	2,444,935.77
US TREASURY N/B-1.5%-28/11/30	4,930,000.00	4,258,090.30
US TREASURY N/B-1.375%-28/12/31	870,000.00	744,461.61
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,590,000.00	4,179,227.13
US TREASURY N/B-2.375%-29/03/31	4,630,000.00	4,148,730.02
US TREASURY N/B-2.875%-29/04/30	2,000,000.00	1,837,968.00
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	4,810,000.00	4,301,376.17
US TREASURY N/B-3.25%-29/06/30	4,980,000.00	4,653,964.38
US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	4,370,000.00	3,736,004.77
US TREASURY N/B-4.0%-29/10/31	1,920,000.00	1,862,173.44
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	7,190,000.00	6,156,717.91
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	3,622,541.58
US TREASURY N/B-4.0%-30/02/28	1,650,000.00	1,597,792.35
US TREASURY N/B-3.625%-30/03/31	2,550,000.00	2,415,923.55
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,159,664.38
US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	4,590,000.00	3,577,331.25
US TREASURY N/B-3.75%-30/05/31	710,000.00	676,967.96
US TREASURY N/B-4.0%-30/07/31	4,900,000.00	4,738,643.00
US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	5,090,000.00	3,934,208.61
US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	5,910,000.00	4,627,110.39
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	560,000.00	589,355.76
US TREASURY N/B-1.125%-31/02/15	4,400,000.00	3,491,637.60

US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	6,930,000.00	5,653,902.87
US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	7,130,000.00	5,603,174.67
US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	6,830,000.00	5,380,489.59
US TREASURY N/B-1.875%-32/02/15	6,240,000.00	5,089,743.36
US TREASURY N/B-2.875%-32/05/15	4,800,000.00	4,226,246.40
US TREASURY N/B-2.75%-32/08/15	5,100,000.00	4,428,630.90
US TREASURY N/B-4.125%-32/11/15	6,110,000.00	5,902,828.23
US TREASURY N/B-3.5%-33/02/15	2,610,000.00	2,398,751.82
US TREASURY N/B-3.375%-33/05/15	1,490,000.00	1,353,454.91
US TREASURY N/B-3.875%-33/08/15	2,200,000.00	2,080,201.20
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	796,280.80
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	777,831.75
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	647,858.51
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	720,000.00	702,843.12
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	689,124.80
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	1,362,715.80
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	1,370,466.14
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	711,942.75
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	663,915.96
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	1,503,573.96
US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	2,116,007.80
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,275,327.36
US TREASURY N/B-1.125%-40/08/15	3,000,000.00	1,701,561.00
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	936,814.39
US TREASURY N/B-1.375%-40/11/15	3,100,000.00	1,833,963.10
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	1,478,377.50
US TREASURY N/B-1.875%-41/02/15	4,200,000.00	2,709,655.20
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	817,425.90
US TREASURY N/B-2.25%-41/05/15	4,900,000.00	3,360,420.00
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	829,200.00
US TREASURY N/B-1.75%-41/08/15	3,190,000.00	1,984,776.53
US TREASURY N/B-2.0%-41/11/15	3,000,000.00	1,945,428.00
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	392,011.50
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	585,843.20
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	1,458,006.00
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	1,765,000.00	1,363,669.00
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	1,516,358.35
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	1,950,000.00	1,622,688.60
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	1,769,722.13
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	1,080,000.00	895,006.80
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,000,000.00	1,589,842.00
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	2,150,000.00	1,637,022.90
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	2,100,000.00	1,560,726.30

		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	2,320,000.00	1,569,714.32	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	1,400,000.00	1,036,163.80	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	1,390,000.00	1,002,889.17	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	1,190,000.00	876,113.70	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	1,500,000.00	1,001,367.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	1,500,000.00	998,319.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	1,650,000.00	1,039,757.40	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	540,000.00	385,319.16	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,000,000.00	1,458,124.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	1,530,000.00	1,113,671.70	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	1,384,218.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,740,000.00	1,202,637.54	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	1,992,138.50	
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	1,779,655.20	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	2,965,452.10	
		US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	2,290,052.55	
		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	2,385,603.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	2,116,521.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,950,000.00	1,816,899.10	
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	1,963,292.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	2,138,914.50	
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	2,450,000.00	1,144,894.80	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,920,000.00	1,411,463.76	
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	3,000,000.00	1,557,186.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	4,750,000.00	2,638,658.25	
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	4,100,000.00	2,578,912.30	
		US TREASURY N/B-2.0%-51/08/15	2,000,000.00	1,143,670.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/11/15	1,400,000.00	773,225.60	
		US TREASURY N/B-2.25%-52/02/15	2,000,000.00	1,217,030.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-52/05/15	600,000.00	421,968.60	
		US TREASURY N/B-3.0%-52/08/15	1,100,000.00	795,264.80	
		US TREASURY N/B-4.0%-52/11/15	1,500,000.00	1,317,772.50	
		US TREASURY N/B-3.625%-53/02/15	2,900,000.00	2,375,279.80	
		US TREASURY N/B-3.625%-53/05/15	2,150,000.00	1,761,823.95	
		US TREASURY N/B-4.125%-53/08/15	1,500,000.00	1,347,655.50	
		米ドル小計	585,175,000.00	505,021,564.89 (75,586,577,617)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-24/11/01	600,000.00	589,272.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-25/02/01	550,000.00	543,708.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	710,000.00	679,832.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-25/04/01	760,000.00	727,912.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-25/05/01	530,000.00	523,714.20	

		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	950,000.00	918,023.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-25/08/01	510,000.00	501,692.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-25/09/01	1,755,000.00	1,636,291.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-25/11/01	450,000.00	451,035.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	995,000.00	908,474.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-26/04/01	700,000.00	680,456.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	770,000.00	721,143.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-26/09/01	990,000.00	909,206.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	520,000.00	476,273.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	750,000.00	679,492.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-27/09/01	620,000.00	594,852.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-28/03/01	580,000.00	572,204.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	897,000.00	832,362.18	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-28/09/01	630,000.00	615,421.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	410,000.00	451,684.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	364,000.00	337,919.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	1,998,000.00	1,709,948.34	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-30/12/01	1,405,000.00	1,123,845.45	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	1,966,000.00	1,675,208.94	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/12/01	1,820,000.00	1,535,861.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-32/06/01	1,070,000.00	932,590.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-32/12/01	890,000.00	804,293.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	710,000.00	822,826.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-33/06/01	500,000.00	460,220.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-33/12/01	100,000.00	95,959.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	340,000.00	383,118.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	600,000.00	622,752.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	730,000.00	713,969.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	650,000.00	559,208.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	2,123,000.00	1,528,453.85	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-53/12/01	1,171,000.00	780,963.32	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-55/12/01	200,000.00	167,986.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	276,421.90	
			31,649,000.00	28,544,598.88	
				(3,126,775,361)	
加ドル小計					
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 24/12/05	11,700,000.00	11,568,375.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-25/03/06	6,400,000.00	5,950,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	24,250,000.00	21,923,515.62	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.0%-26/09/03	2,500,000.00	2,298,437.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	13,350,000.00	11,656,218.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	21,600,000.00	19,993,500.00	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	14,120,000.00	13,347,812.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	21,900,000.00	19,511,531.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-33/05/26	10,800,000.00	9,277,875.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	5,300,000.00	4,587,812.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-35/05/24	600,000.00	523,312.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	4,400,000.00	4,481,125.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	11,970,000.00	10,750,556.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	13,200,000.00	10,877,625.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	13,570,000.00	11,356,393.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-53/07/31	8,150,000.00	6,761,953.12	
メキシコペソ小計			183,810,000.00	164,866,043.74	(1,412,934,968)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	270,000.00	99,865.44	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,135,000.00	1,092,806.37	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	585,000.00	604,637.86	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	852,000.00	810,109.71	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	830,000.00	770,830.96	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	545,000.00	486,764.57	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	970,000.00	1,074,799.77	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	900,000.00	819,971.10	
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	950,000.00	851,161.05	
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	770,000.00	636,884.71	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	855,000.00	733,761.85	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-31/10/22	750,000.00	585,723.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	565,000.00	599,197.19	
		BELGIUM KINGDOM-0.35%-32/06/22	725,000.00	570,230.62	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	525,000.00	442,899.45	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-33/06/22	373,000.00	364,474.33	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	543,000.00	526,185.46	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	974,000.00	1,117,424.42	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	340,000.00	263,604.04	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	485,000.00	390,761.59	
		BELGIUM KINGDOM-2.75%-39/04/22	160,000.00	143,281.92	
		BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	405,000.00	241,282.39	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,112,000.00	1,189,473.04	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	585,000.00	582,027.03	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	658,000.00	434,567.54	
		BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	650,000.00	420,321.20	
		BELGIUM KINGDOM-1.4%-53/06/22	485,000.00	278,118.40	
		BELGIUM KINGDOM-3.3%-54/06/22	370,000.00	330,961.30	



BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	412,000.00	292,023.12
BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	446,000.00	300,648.15
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-71/10/31	345,000.00	146,312.77
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%-24/10/31	1,420,000.00	1,408,696.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-25/01/31	1,350,000.00	1,294,969.95
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%-25/04/30	1,350,000.00	1,315,620.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	1,490,000.00	1,522,806.82
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%-25/10/31	1,455,000.00	1,425,754.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-26/01/31	1,455,000.00	1,354,660.29
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-26/04/30	1,055,000.00	1,023,463.94
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.8%-26/05/31	85,000.00	84,054.29
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	1,360,000.00	1,452,711.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%-26/10/31	1,640,000.00	1,552,884.84
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-27/01/31	755,000.00	681,519.62
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%-27/04/30	1,275,000.00	1,204,261.72
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%-27/07/30	1,315,000.00	1,205,201.44
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-27/10/31	1,400,000.00	1,309,639.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-28/01/31	1,125,000.00	984,281.62
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/04/30	1,270,000.00	1,175,707.58
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/07/30	1,275,000.00	1,175,103.75
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-28/10/31	1,095,000.00	1,190,078.85
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	1,545,000.00	1,747,294.57
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-29/04/30	1,275,000.00	1,160,865.82
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%-29/07/30	515,000.00	448,849.79
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%-29/10/31	1,280,000.00	1,095,384.32
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-30/04/30	1,400,000.00	1,172,165.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-30/07/30	1,180,000.00	1,081,761.46

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%-30/10/31	1,330,000.00	1,156,210.23	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%-31/04/30	1,325,000.00	1,038,325.65	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-31/10/31	1,175,000.00	935,114.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.7%-32/04/30	1,270,000.00	1,011,828.05	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	1,390,000.00	1,620,493.97	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.55%-32/10/31	1,045,000.00	964,323.91	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-33/04/30	1,082,000.00	1,040,166.62	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%-33/07/30	1,165,000.00	1,043,918.05	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.55%-33/10/31	630,000.00	622,729.17	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%-35/07/30	1,195,000.00	976,083.17	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	1,190,000.00	1,224,313.65	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.85%-37/07/30	670,000.00	450,753.22	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.9%-39/07/30	340,000.00	331,778.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	1,045,000.00	1,141,206.88	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%-40/10/31	1,000,000.00	645,664.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	1,265,000.00	1,354,806.14	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-42/07/30	390,000.00	231,351.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-43/07/30	300,000.00	269,024.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	830,000.00	938,583.92	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	980,000.00	789,102.86	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	985,000.00	749,314.12	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-50/10/31	1,170,000.00	564,767.19	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.9%-52/10/31	560,000.00	336,112.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	848,000.00	689,752.17	
BUNDESobligation-0.0%-25/04/11	1,300,000.00	1,243,013.20	
BUNDESobligation-0.0%-25/10/10	1,650,000.00	1,559,218.65	
BUNDESobligation-0.0%-26/04/10	1,600,000.00	1,496,267.20	

BUNDESobligation-0.0%-27/04/16	1,150,000.00	1,051,856.70
BUNDESobligation-1.3%-27/10/15	1,130,000.00	1,076,725.02
BUNDESobligation-2.2%-28/04/13	750,000.00	738,655.50
BUNDESobligation-2.4%-28/10/19	120,000.00	119,159.64
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	1,990,000.00	1,921,693.25
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15	2,070,000.00	1,998,106.83
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	1,820,000.00	1,726,573.94
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-26/08/15	2,010,000.00	1,865,448.84
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	2,295,000.00	2,125,158.52
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	910,000.00	1,029,630.42
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15	1,770,000.00	1,639,519.14
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-27/11/15	1,565,000.00	1,413,417.23
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	650,000.00	727,664.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-28/02/15	1,690,000.00	1,552,018.26
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	970,000.00	1,063,226.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-28/08/15	1,670,000.00	1,502,084.84
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-28/11/15	1,180,000.00	1,041,988.38
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-29/02/15	1,875,000.00	1,669,207.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-29/08/15	1,830,000.00	1,587,025.41
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.1%-29/11/15	620,000.00	605,274.38
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	660,000.00	799,260.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/02/15	1,490,000.00	1,276,357.84
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/08/15	1,800,000.00	1,522,530.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/08/15	740,000.00	626,572.06
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	1,110,000.00	1,322,679.33
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/02/15	1,920,000.00	1,602,059.52
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/08/15	1,565,000.00	1,288,422.24
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/08/15	400,000.00	329,436.80

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 32/02/15	1,623,000.00	1,316,913.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.7%- 32/08/15	1,680,000.00	1,565,264.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.3%- 33/02/15	1,450,000.00	1,413,330.95	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.3%- 33/02/15	170,000.00	165,848.26	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.6%- 33/08/15	500,000.00	497,827.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,375,000.00	1,633,054.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 35/05/15	1,200,000.00	876,223.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 36/05/15	1,000,000.00	707,013.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	1,790,000.00	2,018,642.07	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 38/05/15	50,000.00	38,951.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,235,000.00	1,443,482.82	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,255,000.00	1,558,919.58	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	955,000.00	998,509.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,635,000.00	1,528,066.09	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,827,000.00	1,702,336.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	2,040,000.00	1,454,734.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	1,630,000.00	766,769.93	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	640,000.00	302,529.28	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 52/08/15	750,000.00	333,249.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%- 53/08/15	1,040,000.00	810,200.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%- 53/08/15	500,000.00	390,132.50	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.2%-24/12/12	240,000.00	236,896.80	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.5%-25/03/13	680,000.00	673,014.36	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.8%-25/06/12	910,000.00	904,895.81	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-3.1%-25/12/12	200,000.00	200,539.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 72/03/01	220,000.00	117,063.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 24/11/15	1,260,000.00	1,231,902.00	
	1,080,000.00	1,066,983.84	

BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 24/12/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 24/12/15	870,000.00	835,740.27	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 25/02/01	1,485,000.00	1,426,312.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	1,540,000.00	1,565,827.34	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 25/05/15	855,000.00	828,007.65	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	1,300,000.00	1,258,010.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 25/07/01	1,000,000.00	971,345.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.6%- 25/09/29	85,000.00	84,905.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 25/11/15	1,100,000.00	1,076,939.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	1,085,000.00	1,051,200.08	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 26/01/15	810,000.00	808,509.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 26/02/01	850,000.00	793,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,330,000.00	1,355,695.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 26/04/01	1,020,000.00	936,247.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%- 26/04/15	950,000.00	954,149.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	1,330,000.00	1,265,569.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%- 26/07/15	950,000.00	913,758.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 26/08/01	870,000.00	788,882.94	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	720,000.00	792,729.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,080,000.00	1,006,610.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%- 27/01/15	1,180,000.00	1,082,596.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.1%- 27/04/01	410,000.00	377,054.86	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	1,160,000.00	1,104,407.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	995,000.00	939,603.37	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 27/09/15	775,000.00	699,899.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	1,560,000.00	1,721,280.60	

BUONI POLIENNALI DEL TES-2.65%- 27/12/01	950,000.00	912,498.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	1,650,000.00	1,540,080.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%- 28/03/15	1,230,000.00	1,059,276.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 28/07/15	1,130,000.00	972,985.37
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%- 28/08/01	110,000.00	109,966.23
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,330,000.00	1,386,257.67
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 28/12/01	1,030,000.00	983,050.54
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 29/02/15	735,000.00	616,687.05
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 29/06/15	305,000.00	288,078.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 29/08/01	2,025,000.00	1,932,627.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	1,750,000.00	1,873,056.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 29/12/15	535,000.00	531,182.77
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,620,000.00	1,579,176.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 30/04/01	1,075,000.00	915,943.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.7%- 30/06/15	170,000.00	166,608.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 30/08/01	1,087,000.00	890,662.79
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 30/12/01	1,287,000.00	1,096,221.55
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 31/04/01	1,295,000.00	1,032,855.74
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	1,515,000.00	1,701,811.62
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%- 31/08/01	1,120,000.00	860,348.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 31/10/30	290,000.00	286,978.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 31/12/01	1,010,000.00	789,010.99
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,550,000.00	1,276,060.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 32/06/01	1,200,000.00	920,133.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 32/12/01	630,000.00	546,493.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,475,000.00	1,635,016.85

BUONI POLIENNALI DEL TES-4.4%- 33/05/01	765,000.00	768,203.05
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	1,365,000.00	1,159,040.61
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.35%- 33/11/01	700,000.00	696,903.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.2%- 34/03/01	240,000.00	234,790.56
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	1,580,000.00	1,646,473.76
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	980,000.00	875,561.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 35/04/30	400,000.00	381,051.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 36/03/01	900,000.00	636,041.70
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	965,000.00	744,947.19
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	1,825,000.00	1,712,142.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 37/03/01	400,000.00	255,032.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 38/03/01	200,000.00	169,262.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	855,000.00	694,196.73
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,250,000.00	1,278,587.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%- 40/03/01	810,000.00	656,361.63
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,070,000.00	1,092,484.98
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%- 41/03/01	830,000.00	541,533.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.45%- 43/09/01	500,000.00	472,051.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	1,065,000.00	1,047,736.35
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 45/04/30	440,000.00	248,967.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	820,000.00	643,643.42
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	970,000.00	688,342.07
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	1,015,000.00	818,168.15
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 49/09/01	650,000.00	554,990.15
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 50/09/01	870,000.00	566,239.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%- 51/09/01	850,000.00	460,701.70

BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-52/09/01	280,000.00	165,422.04
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-53/10/01	475,000.00	441,754.27
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	500,000.00	320,397.50
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	332,000.00	335,881.08
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	280,000.00	268,701.72
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	335,000.00	315,718.07
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-26/09/15	180,000.00	165,376.08
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-27/04/15	170,000.00	161,200.29
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	400,000.00	364,885.60
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	376,983.94
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	240,219.81
FINNISH GOVERNMENT-2.875%-29/04/15	105,000.00	104,398.98
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	375,000.00	325,668.75
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-30/09/15	172,000.00	139,957.60
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	365,000.00	309,301.00
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-31/09/15	200,000.00	158,815.60
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-32/09/15	230,000.00	200,691.10
FINNISH GOVERNMENT-3.0%-33/09/15	110,000.00	107,861.60
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	325,000.00	264,550.00
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	278,000.00	186,335.06
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-38/04/15	210,000.00	192,193.05
FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15	263,000.00	155,700.20
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	277,000.00	244,735.31
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-43/04/15	235,000.00	136,154.77
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	174,359.12
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-52/04/15	250,000.00	103,062.50
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	515,000.00	171,982.70
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	2,383,000.00	2,340,620.72
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/02/25	375,000.00	359,242.12
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/03/25	2,865,000.00	2,737,988.82
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	2,610,000.00	2,502,916.92
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	1,820,000.00	1,918,280.00
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	2,070,000.00	1,985,119.65
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-26/02/25	2,440,000.00	2,277,679.00
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	2,470,000.00	2,497,538.03
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,450,000.00	2,301,588.80
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-26/09/24	400,000.00	394,484.00
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,620,000.00	2,415,621.66
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-27/02/25	2,005,000.00	1,822,144.00
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	1,775,000.00	1,660,832.00
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,020,000.00	3,001,251.84



FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/02/25	1,275,000.00	1,164,766.05
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/05/25	3,765,000.00	3,421,579.29
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/11/25	3,080,000.00	2,770,952.80
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-29/02/25	140,000.00	138,600.56
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	2,105,000.00	2,370,985.69
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-29/05/25	3,060,000.00	2,683,442.52
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-29/11/25	2,580,000.00	2,164,532.28
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	3,065,000.00	2,981,331.63
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-30/11/25	3,049,000.00	2,474,565.35
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-31/05/25	3,040,000.00	2,733,060.32
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-31/11/25	2,605,000.00	2,041,343.12
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-32/05/25	2,068,000.00	1,591,011.66
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	2,085,000.00	2,504,310.18
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-32/11/25	2,075,000.00	1,889,661.00
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-33/05/25	935,000.00	920,368.18
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-34/05/25	2,475,000.00	2,032,108.65
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	1,605,000.00	1,817,396.07
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-36/05/25	2,555,000.00	1,993,615.40
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-38/05/25	190,000.00	140,883.29
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	1,590,000.00	1,677,621.72
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-39/06/25	1,890,000.00	1,492,905.33
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	2,780,000.00	3,101,459.74
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-43/05/25	135,000.00	112,982.17
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-44/06/25	1,050,000.00	574,536.90
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	1,580,000.00	1,480,957.70
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-48/05/25	1,580,000.00	1,150,028.28
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-50/05/25	1,960,000.00	1,234,068.92
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-52/05/25	1,500,000.00	725,400.00
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-53/05/25	1,320,000.00	622,164.84
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-54/05/25	540,000.00	462,862.08
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	1,300,000.00	1,352,211.90
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	1,070,000.00	1,118,095.43
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-66/05/25	945,000.00	568,773.76
IRISH TREASURY -5.4%-25/03/13	580,000.00	596,427.92
IRISH TREASURY -1.0%-26/05/15	595,000.00	567,394.97
IRISH TREASURY -0.2%-27/05/15	327,000.00	297,920.21
IRISH TREASURY -0.9%-28/05/15	455,000.00	417,646.32
IRISH TREASURY -1.1%-29/05/15	525,000.00	477,078.00
IRISH TREASURY -2.4%-30/05/15	476,000.00	459,656.06
IRISH TREASURY -0.2%-30/10/18	282,000.00	233,067.07
IRISH TREASURY -1.35%-31/03/18	335,000.00	298,847.80
IRISH TREASURY -0.0%-31/10/18	485,000.00	382,897.80

IRISH TREASURY-0.35%-32/10/18	205,000.00	161,979.11
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	285,000.00	243,075.93
IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	250,000.00	181,983.25
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	390,000.00	318,135.09
IRISH TREASURY-0.55%-41/04/22	185,000.00	114,670.40
IRISH TREASURY-3.0%-43/10/18	170,000.00	158,301.45
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	541,000.00	409,860.51
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	479,000.00	307,091.20
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	940,000.00	896,427.24
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-26/01/15	455,000.00	426,601.17
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,100,000.00	1,032,839.50
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	828,000.00	757,624.14
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	870,000.00	808,425.75
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	655,000.00	723,444.88
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	961,000.00	876,333.97
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	620,000.00	537,518.30
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	645,000.00	560,170.89
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-30/01/15	365,000.00	358,141.28
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-30/07/15	670,000.00	556,474.53
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-31/07/15	710,000.00	571,831.87
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-32/07/15	700,000.00	571,994.50
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	855,000.00	826,393.41
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/07/15	370,000.00	355,025.36
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,025,000.00	1,119,024.27
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-38/01/15	395,000.00	253,381.83
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	848,000.00	563,691.88
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	957,000.00	1,029,466.91
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-44/01/15	170,000.00	171,502.12
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,004,000.00	934,525.20
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	907,000.00	385,583.84
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-54/01/15	365,000.00	283,007.49
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.7%-71/04/20	200,000.00	77,515.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	173,000.00	90,517.92
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	383,000.00	248,195.87
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.85%-99/99/99	192,000.00	75,600.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-25/04/20	475,000.00	453,191.80
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	710,000.00	685,109.53
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	550,000.00	572,060.50
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.0%-26/07/15	170,000.00	165,669.42
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	773,000.00	725,012.16
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	630,384.26
REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	487,000.00	542,172.23
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	660,000.00	602,242.08

		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-28/10/20	255,000.00	220,365.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	800,000.00	702,821.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-29/05/23	150,000.00	149,524.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	680,000.00	562,457.92	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-31/02/20	745,000.00	594,279.05	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.9%-32/02/20	610,000.00	509,204.82	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-33/02/20	650,000.00	631,555.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	455,000.00	418,716.02	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-36/10/20	270,000.00	180,802.53	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	840,000.00	898,471.56	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	345,000.00	191,606.79	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	394,000.00	370,807.97	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	503,000.00	338,899.26	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.85%-49/05/23	200,000.00	142,838.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	455,000.00	235,951.17	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-53/10/20	106,000.00	97,530.49	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	245,000.00	256,284.45	
ユーロ小計			353,287,000.00	319,905,278.44	(51,338,399,084)
英債券	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	760,000.00	336,718.00	
		UK TREASURY-1.125%-73/10/22	513,000.00	177,944.31	
		UK TREASURY-0.25%-25/01/31	1,590,000.00	1,505,642.55	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	805,000.00	807,891.56	
		UK TREASURY-0.625%-25/06/07	813,000.00	764,889.91	
		UK TREASURY-3.5%-25/10/22	1,200,000.00	1,174,024.80	
		UK TREASURY-0.125%-26/01/30	710,000.00	648,044.69	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	820,000.00	762,140.80	
		UK TREASURY-0.375%-26/10/22	1,260,000.00	1,124,149.32	
		UK TREASURY-4.125%-27/01/29	1,495,000.00	1,483,780.02	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	840,000.00	756,798.00	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	850,000.00	851,754.40	
		UK TREASURY-0.125%-28/01/31	745,000.00	629,918.36	
		UK TREASURY-4.5%-28/06/07	505,000.00	509,916.68	
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	720,000.00	641,059.20	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	710,000.00	769,316.95	
		UK TREASURY-0.5%-29/01/31	1,055,000.00	873,392.30	
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	856,000.00	711,122.00	
		UK TREASURY-0.375%-30/10/22	920,000.00	712,585.08	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	945,000.00	980,080.29	
		UK TREASURY-0.25%-31/07/31	1,445,000.00	1,072,580.15	
		UK TREASURY-1.0%-32/01/31	1,645,000.00	1,278,855.90	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,210,000.00	1,215,176.38	

		UK TREASURY-3.25%-33/01/31	1,450,000.00	1,335,477.54	
		UK TREASURY-0.875%-33/07/31	1,340,000.00	976,136.40	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	849,000.00	857,286.24	
		UK TREASURY-0.625%-35/07/31	1,097,000.00	717,446.77	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	970,000.00	949,843.40	
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,350,000.00	962,736.30	
		UK TREASURY-3.75%-38/01/29	355,000.00	322,957.70	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,060,000.00	1,076,599.60	
		UK TREASURY-1.125%-39/01/31	300,000.00	185,598.60	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	850,000.00	811,487.35	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	875,000.00	829,370.50	
		UK TREASURY-1.25%-41/10/22	1,360,000.00	795,355.20	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,090,000.00	1,056,613.30	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,175,000.00	943,407.50	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,160,000.00	961,698.00	
		UK TREASURY-0.875%-46/01/31	435,000.00	204,719.70	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	720,000.00	665,534.88	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,140,000.00	614,004.00	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	675,000.00	378,540.00	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	895,000.00	823,464.44	
		UK TREASURY-0.625%-50/10/22	660,000.00	249,175.74	
		UK TREASURY-1.25%-51/07/31	600,000.00	278,904.00	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	872,000.00	734,747.20	
		UK TREASURY-1.5%-53/07/31	580,000.00	282,233.80	
		UK TREASURY-3.75%-53/10/22	690,000.00	578,102.70	
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	925,000.00	462,074.50	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	962,000.00	886,280.98	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	546,347.25	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	751,000.00	662,081.60	
		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	1,050,000.00	293,800.50	
		UK TREASURY-4.0%-63/10/22	470,000.00	412,848.00	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	830,000.00	657,794.92	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	765,000.00	730,761.66	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	742,000.00	453,658.80	
英債券小計			52,530,000.00	42,484,870.72	(7,862,675,024)
スウェーデン デンク ローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,000,000.00	3,944,860.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	4,400,000.00	4,143,453.60	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,550,000.00	3,235,761.10	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	3,780,000.00	3,355,880.22	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	2,700,000.00	2,211,054.30	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,800,000.00	1,719,703.80	

		SWEDISH GOVERNMENT-1.75%-33/11/11	1,480,000.00	1,338,146.44
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	2,645,000.00	2,806,662.40
スウェーデンクローナ小計			24,355,000.00	22,755,521.86 (312,660,870)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	2,990,000.00	2,899,600.34
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,400,000.00	2,276,472.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,400,000.00	2,247,840.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,040,000.00	1,895,004.96
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	2,050,000.00	1,838,891.00
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	2,950,000.00	2,537,660.80
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.25%-31/09/17	2,040,000.00	1,696,698.60
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.125%-32/05/18	2,130,000.00	1,877,177.52
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-33/08/15	1,850,000.00	1,731,692.50
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.5%-42/10/06	1,100,000.00	1,093,334.00
ノルウェークローネ小計			21,950,000.00	20,094,371.72 (272,278,736)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-0.0%-24/11/15	1,980,000.00	1,914,042.24
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	3,170,000.00	3,091,577.37
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	4,080,000.00	3,737,577.84
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	3,130,000.00	2,747,075.80
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-31/11/15	1,350,000.00	1,082,057.40
		KINGDOM OF DENMARK-2.25%-33/11/15	700,000.00	659,827.00
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	7,760,000.00	9,183,960.00
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	1,300,000.00	618,607.60
デンマーククローネ小計			23,470,000.00	23,034,725.25 (495,246,592)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	1,440,000.00	1,353,283.20
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,270,000.00	2,200,901.20
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-25/10/25	120,000.00	108,872.40
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,590,000.00	2,427,607.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,950,000.00	1,696,500.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	1,310,000.00	1,255,687.40
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,140,000.00	1,961,245.80
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,160,000.00	1,968,019.20
		POLAND GOVERNMENT BOND-7.5%-28/07/25	1,720,000.00	1,888,611.60
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	855,000.00	879,004.98
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	2,665,000.00	2,348,984.30
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	2,025,000.00	1,572,615.00
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-32/04/25	1,870,000.00	1,416,992.50
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.0%-33/10/25	1,070,000.00	1,114,094.70
ポーランドズロチ小計			24,185,000.00	22,192,419.28 (799,186,745)

豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-24/11/21	1,321,000.00	1,264,750.49	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	1,060,000.00	1,042,687.02	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	950,000.00	874,934.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	1,000,000.00	999,063.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,210,000.00	1,087,723.45	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,080,000.00	1,095,872.76	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	980,000.00	923,702.92	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	700,000.00	640,149.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	720,000.00	667,572.48	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,030,000.00	972,485.83	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	890,000.00	810,162.55	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,120,000.00	993,622.56	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	1,010,000.00	793,221.68	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,283,000.00	1,029,385.54	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,485,000.00	1,125,756.22	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,580,000.00	1,203,188.96	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	1,295,000.00	1,016,362.62	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,190,000.00	1,171,971.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-33/11/21	1,120,000.00	967,363.04	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-34/05/21	960,000.00	882,334.08	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.5%-34/12/21	740,000.00	660,498.84	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	530,000.00	434,798.75	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	550,000.00	490,283.75	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	582,000.00	474,955.06	
AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	790,000.00	582,204.72			
AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	720,000.00	516,670.56			
AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	1,020,000.00	520,833.42			
AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-54/06/21	260,000.00	248,517.62			
豪ドル小計			27,176,000.00	23,491,073.52	(2,290,379,668)
ニュー ジーラン ドル	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-25/04/15	590,000.00	568,519.87	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.5%-26/05/15	215,000.00	191,805.37	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-27/04/15	700,000.00	687,748.60	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.25%-28/05/15	370,000.00	298,813.48	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.0%-29/04/20	680,000.00	613,083.24	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.5%-31/05/15	350,000.00	270,456.20	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.0%-32/05/15	190,000.00	148,471.89	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.5%-33/04/14	430,000.00	375,054.17	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.25%-34/05/15	220,000.00	201,952.96	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-37/04/15	380,000.00	284,735.90	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.75%-41/05/15	225,000.00	132,005.47	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-51/05/15	500,000.00	313,012.50	

ニュージーランドドル小計			4,850,000.00	4,085,659.65 (366,279,387)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-72/08/01	240,000.00	244,920.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	480,000.00	470,736.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-25/11/01	314,000.00	295,902.61
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	470,000.00	454,631.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-26/11/01	255,000.00	239,572.50
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	533,000.00	535,931.50
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-27/09/01	110,000.00	108,680.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	347,000.00	338,498.50
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-28/08/01	60,000.00	59,264.70
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	415,000.00	408,318.50
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	490,000.00	480,200.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-31/07/01	300,000.00	268,050.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-32/08/01	170,000.00	162,452.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	335,000.00	338,907.77
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	451,000.00	406,351.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	220,000.00	199,183.60
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	352,000.00	333,629.12
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	382,000.00	359,844.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	367,000.00	287,361.00
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-51/10/01	222,000.00	175,742.97
シンガポールドル小計			6,513,000.00	6,168,176.77 (682,385,396)
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	770,000.00	775,293.75
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,380,000.00	1,392,420.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	830,000.00	836,706.40
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	1,170,000.00	1,178,622.90
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,200,000.00	1,206,306.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.519%-28/04/20	240,000.00	237,480.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.504%-29/04/30	200,000.00	205,562.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,320,000.00	1,316,231.40
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	985,000.00	898,487.45
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	739,200.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,100,000.00	1,077,587.50
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	960,000.00	972,321.60
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,320,000.00	1,403,450.40
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	1,080,000.00	1,168,560.00
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	1,490,000.00	1,392,896.70
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.696%-42/10/15	750,000.00	788,212.50
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	660,000.00	707,834.16
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	620,000.00	641,801.68

		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	510,000.00	546,034.05	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	1,460,000.00	1,374,590.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.457%-53/03/31	580,000.00	581,064.30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	650,000.00	660,212.80	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	942,257.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,510,000.00	1,504,911.30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	910,000.00	936,264.42	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,044,194.94	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	1,180,000.00	1,158,889.80	
		マレーシアリングット小計	25,560,000.00	25,687,393.55 (821,012,766)	
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-2.26%-25/02/24	4,000,000.00	3,996,675.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.99%-25/04/09	22,000,000.00	21,884,082.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.24%-25/05/25	19,800,000.00	19,770,799.95	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-25/08/25	20,000,000.00	19,941,747.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	32,000,000.00	32,484,065.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.46%-26/02/15	8,000,000.00	8,012,640.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	17,000,000.00	17,292,162.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.3%-26/05/15	16,000,000.00	15,997,216.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-26/06/06	11,000,000.00	11,286,258.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	16,000,000.00	16,123,832.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-26/08/15	12,000,000.00	11,925,870.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-26/12/05	23,000,000.00	23,537,659.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	24,000,000.00	24,324,972.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	5,000,000.00	5,002,602.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.28%-27/12/03	19,500,000.00	20,180,726.47	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.64%-28/01/15	10,000,000.00	10,059,990.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-28/04/15	11,000,000.00	11,051,496.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	13,000,000.00	13,294,438.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.4%-28/07/15	4,000,000.00	3,979,552.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	22,000,000.00	22,390,674.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-29/03/24	3,000,000.00	3,032,433.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-29/05/23	14,000,000.00	14,588,749.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-29/09/25	24,000,000.00	23,992,740.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-30/03/25	15,000,000.00	15,151,432.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	21,000,000.00	21,032,781.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-30/06/25	11,000,000.00	10,980,783.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	11,000,000.00	11,537,845.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	10,000,000.00	10,283,795.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	10,000,000.00	10,050,530.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.76%-32/05/15	9,000,000.00	9,050,922.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-32/08/15	9,000,000.00	8,997,880.50	



		CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-32/09/01	10,000,000.00	9,927,590.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-32/11/15	6,000,000.00	6,063,846.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-33/02/25	11,000,000.00	11,201,289.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/05/25	12,000,000.00	11,995,884.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	13,000,000.00	14,810,555.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	7,000,000.00	7,857,129.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.53%-51/10/18	10,000,000.00	10,888,720.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.32%-52/04/15	10,000,000.00	10,537,505.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-52/10/25	8,000,000.00	8,132,088.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-53/04/15	9,000,000.00	9,383,436.45	
中国元小計			542,300,000.00	552,035,394.17 (11,350,454,943)	
イスラエル シュケル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-0.4%-24/10/31	800,000.00	772,857.05	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-25/04/30	1,360,000.00	1,291,780.25	
		ISRAEL FIXED BOND-1.75%-25/08/31	1,190,000.00	1,142,473.43	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-26/02/27	630,000.00	580,886.23	
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	950,000.00	1,008,073.60	
		ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,270,000.00	1,187,140.14	
		ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,160,000.00	1,065,717.94	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-29/02/28	300,000.00	294,403.36	
		ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	1,515,000.00	1,246,101.78	
		ISRAEL FIXED BOND-1.3%-32/04/30	530,000.00	415,283.26	
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	1,050,000.00	713,770.59	
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,160,000.00	1,251,614.66	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,300,000.00	1,064,928.35	
		ISRAEL FIXED BOND-2.8%-52/11/29	300,000.00	192,470.86	
イスラエルシュケル小計			13,515,000.00	12,227,501.50 (466,480,404)	
合計				157,183,727,561 (157,183,727,561)	

(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 216銘柄	100.0%	48.1%
加ドル	国債証券 38銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 358銘柄	100.0%	32.7%
英ポンド	国債証券 57銘柄	100.0%	5.0%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%

ポーランドズロチ	国債証券	14銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券	28銘柄	100.0%	1.5%
ニュージーランドドル	国債証券	12銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券	20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券	27銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券	41銘柄	100.0%	7.2%
イスラエルシェケル	国債証券	14銘柄	100.0%	0.3%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2023年11月30日現在です。

## 【DCインデックスバランス（株式40）】

## 【純資産額計算書】

資産総額	16,712,578,964円
負債総額	14,480,313円
純資産総額（ - ）	16,698,098,651円
発行済口数	7,041,668,680口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3713円

（参考）

## 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	53,493,614,003円
負債総額	67,611,199円
純資産総額（ - ）	53,426,002,804円
発行済口数	21,980,392,829口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4306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	325,536,522,314円
負債総額	100,903,140円
純資産総額（ - ）	325,435,619,174円
発行済口数	61,375,523,649口
1口当たり純資産額（ / ）	5.3024円

## 日本債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	52,477,170,229円
負債総額	289,352,036円
純資産総額（ - ）	52,187,818,193円
発行済口数	38,878,998,894口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3423円

## 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	160,318,342,953円
------	------------------

負債総額	423,983,817円
純資産総額（ - ）	159,894,359,136円
発行済口数	56,874,389,981口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8114円

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

- (1) 名義書換  
該当事項はありません。
- (2) 受益者に対する特典  
該当事項はありません。
- (3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。  
受益権の譲渡
- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとし、
  - ・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、
  - ・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、
  - ・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11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11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11月末現在）

- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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11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	839	275,105
株式投資信託	786	236,623
単位型	306	9,533
追加型	480	227,089
公社債投資信託	53	38,482
単位型	40	994
追加型	13	37,488

### 3【委託会社等の経理状況】

- 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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。  
また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第65期中間会計期間(2023年4月1日から2023年9月30日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

### (1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第63期 (2022年3月31日)		第64期 (2023年3月31日)	
<b>資産の部</b>				
<b>流動資産</b>				
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
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物	1	244	1	245
器具備品	1	153	1	122
有形固定資産合計		397		367
<b>無形固定資産</b>				
ソフトウェア		335		390
無形固定資産合計		335		390
<b>投資その他の資産</b>				
投資有価証券		23,969		23,274
関係会社株式		22,366		22,366
長期差入保証金		652		375
繰延税金資産		3,678		448
投資その他の資産合計		50,667		46,465
固定資産合計		51,399		47,224
資産合計		128,328		119,099

(単位：百万円)

	第63期 (2022年3月31日)		第64期 (2023年3月31日)	
<b>負債の部</b>				
<b>流動負債</b>				
預り金		651		433
未払金		9,693		7,557

未払収益分配金		7		7
未払償還金		71		71
未払手数料		8,783		6,586
その他未払金		831		892
未払費用	3	5,572	3	4,227
未払法人税等		2,354		-
未払消費税等	4	3,669		-
賞与引当金		3,958		2,563
役員賞与引当金		5		218
訴訟損失引当金		7,847		-
その他		1,330		647
流動負債合計		35,083		15,648
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		第64期	
	(自	2021年4月1日	(自	2022年4月1日
	至	2022年3月31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		-	3	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						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	61,956	61,956	2,067	82,472
当期変動額							
剰余金の配当				5,191	5,191		5,191
当期純利益				12,136	12,136		12,136
自己株式の取得							
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	6,944	6,944	-	6,944
当期末残高	17,363	5,220	5,220	68,901	68,901	2,067	89,417

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	1,461	115	1,577	84,049
当期変動額				
剰余金の配当				5,191
当期純利益				12,136
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	889	847	41	41
当期変動額合計	889	847	41	6,985
当期末残高	2,350	731	1,618	91,035

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	利益剰余金合計		
				繰越利益剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	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 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>    その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定)</p> <p>    市場価格のない株式等 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年 4月 1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <p>    建物                                    3年～15年</p> <p>    器具備品                              3年～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p>

	<p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 収益の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。</p>
	<p>(1) 投資信託委託業務 当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」）に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドのAUMに固定料率を乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問業務 当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドのAUMに投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。</p> <p>(3) 成功報酬 当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。</p>
5 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
6 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

## (会計方針の変更)

<p 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)</p> <p>「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>
--

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、金額の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。

## (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)
1 有形固定資産の減価償却累計額	1 有形固定資産の減価償却累計額
建物 1,390百万円	建物 1,437百万円
器具備品 823百万円	器具備品 879百万円
2 信託資産	2 信託資産
流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。	流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。
3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりで あります。	3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりで あります。
(流動資産)	(流動資産)
未収収益 233百万円	未収収益 263百万円
(流動負債)	(流動負債)
未払費用 2,314百万円	未払費用 1,778百万円
4 消費税等の取扱い	4 消費税等の取扱い
仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 「未払消費税等」として表示しております。	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。
5 保証債務	5 保証債務
ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ ピーティーワイ・リミテッド(旧社名「日興AMエ クイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・ リミテッド」)が発行する買戻し条件付株式の買戻 請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マ ネジメント・リミテッドは最大5百万豪ドルを提供 する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタ ル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供 義務を保証しております。	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。

## (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)
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。	1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、 次のとおりであります。
受取配当金 5,194百万円	受取配当金 9,241百万円

<p>2 法人税等還付税額 過年度の取引に関する法人税等の還付金相当額を計上しています。</p>	<p>3 訴訟損失引当金戻入額 原告との和解が成立したことから、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、バリュエーション・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)			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
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ードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針」5「ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

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

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

##### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

###### 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、預金の預入れやデリバティブ取引を行う金融機関の選定に関しては、相手方の財政状態及び経営成績、又は必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関して、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、バリュエーション・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 資産計	6,238	18,045	-	24,283
デリバティブ取引(*1) 株式関連(*2) 通貨関連(*3) デリバティブ取引計	246 - -	- 352 352	- - -	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	4,708	-	293	293
米ドル				
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	投資有価証券			
	売建				
	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			280
	米ドル		6,132	-	0
	豪ドル		105	-	34
	香港ドル		699	-	1
	人民元		5,822	-	10
	ユーロ		234	-	
合計			12,994	-	328

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

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

(退職給付関係)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

退職給付引当金	1,395
貸借対照表に計上された負債の額	1,395

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	143
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用	150

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項	
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎 割引率	0.3%

3 確定拠出制度  
当社の確定拠出制度への要拠出額は、244百万円でありました。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要  
当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2 確定給付制度

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

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表	
退職給付債務	1,366
未積立退職給付債務	1,366
未認識数理計算上の差異	58
貸借対照表に計上された負債の額	1,424

退職給付引当金	1,424
貸借対照表に計上された負債の額	1,424

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	133
利息費用	4
数理計算上の差異の費用処理額	1
確定給付制度に係る退職給付費用	136

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項	
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎 割引率	0.6%

3 確定拠出制度  
当社の確定拠出制度への要拠出額は、247百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

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

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定前(株)		

期首	1,772,000	2,607,000
付与	0	0
失効	956,000	1,071,000
権利確定	0	0
権利未確定残	816,000	1,536,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

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

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

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

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2016年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の取締役・従業員 16名	当社及び関係会社の取締役・従業員 31名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式 4,437,000株	普通株式 4,409,000株
付与日	2016年7月15日	2017年4月27日
権利確定条件	2018年7月15日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2019年4月27日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2018年7月15日から2026年7月31日まで	2019年4月27日から2027年4月30日まで

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

（注） 株式数に換算して記載しております。

(2) ス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tockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額  
当事業年度末における本源的価値の合計額 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的主要原因別の内訳 (単位：百万円)	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生的主要原因別の内訳 (単位：百万円)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 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 (調整)	法定実効税率
30.6%	30.6%
交際費等永久に損金に算入されない項目	交際費等永久に損金に算入されない項目
0.1%	1.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	受取配当金等永久に益金に算入されない項目
10.9%	12.0%
評価性引当金の減少	その他
10.3%	0.8%
その他	税効果会計適用後の法人税等の負担率
0.1%	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)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	232,369 (SGD千)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	資金の貸付(米国ドル貸建)(注1)	-	関係会社短期貸付金	2,019 (USD) 16,500千)
							貸付金利息(米国ドル貸建)(注1)	44 (USD) 397千)	未収収益	10 (USD) 86千)
							資金の返済(円貸建)(注1)	577	関係会社短期貸付金	-
							貸付金利息(円貸建)(注1)	3	未収収益	-
							資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	2,788 (SGD) 33,000千)	関係会社短期貸付金	2,985 (SGD) 33,000千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	23 (SGD) 266千)	未収収益	23 (SGD) 266千)
							減資(注2)	9,149 (SGD) 110,000千)	-	-
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注3)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	配当の受取	3,788 (USD) 34,000千)	-	-

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2021年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場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年間のリボルピング・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年間のリボルピング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定してありました（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(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2022年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	34,828百万円
負債合計	5,655百万円
純資産合計	29,173百万円
営業収益	15,864百万円
税引前当期純利益	4,191百万円
当期純利益	3,159百万円

(セグメント情報等)

## セグメント情報

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

## 関連情報

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

## 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

## 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

## 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

## 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

## (収益認識関係)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

## 2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「(重要な会計方針) 4 収益の計上基準」に記載のとおりです。

## 3 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「(重要な会計方針) 4 収益の計上基準」に記載のとおりです。

3 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益(百万円)	12,136	17,826
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(百万円)	12,136	17,826
普通株式の期中平均株式数(千株)	194,152	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2016年度ストックオプション(1) 88,000株、2016年度ストックオプション(2) 816,000株、2017年度ストックオプション(1) 1,536,000株	2016年度ストックオプション(2) 217,000株、2017年度ストックオプション(1) 752,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

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

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第65期中間会計期間  
(2023年9月30日)

資産の部		
流動資産		
現金・預金		31,751
金銭の信託		2,500
有価証券		78
未収委託者報酬		16,602
未収収益		940
その他	2	3,797
流動資産合計		55,670
固定資産		
有形固定資産	1	330
無形固定資産		389
投資その他の資産		
投資有価証券		24,116
関係会社株式		37,647
長期差入保証金		338
繰延税金資産		240
投資その他の資産合計		62,343
固定資産合計		63,063
資産合計		118,734

(単位：百万円)

第65期中間会計期間  
(2023年9月30日)

負債の部		
流動負債		
未払金		8,446
未払費用		3,085
未払法人税等		1,334
未払消費税等	3	575
賞与引当金		1,383
役員賞与引当金		162
その他		1,230
流動負債合計		16,218
固定負債		
退職給付引当金		1,458
賞与引当金		397
役員賞与引当金		40
その他		170
固定負債合計		2,067
負債合計		18,286
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220

利益剰余金	
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	77,549
利益剰余金合計	77,549
自己株式	2,067
株主資本合計	98,066
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	3,457
繰延ヘッジ損益	1,075
評価・換算差額等合計	2,381
純資産合計	100,447
負債純資産合計	118,734

## (2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第65期中間会計期間  
(自 2023年4月1日  
至 2023年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		37,779
その他営業収益		1,652
営業収益合計		39,431
営業費用及び一般管理費	1	35,014
営業利益		4,416
営業外収益	2	1,245
営業外費用	3	1,458
経常利益		4,203
特別利益	4	501
特別損失	5	99
税引前中間純利益		4,605
法人税等	6	1,270
中間純利益		3,335

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第65期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30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	79,307	79,307	2,067	99,823
当中間期変動額							
剰余金の配当				5,092	5,092		5,092
中間純利益				3,335	3,335		3,335
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)							
当中間期変動額合計	-	-	-	1,757	1,757	-	1,757

当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	77,549	77,549	2,067	98,066
---------	--------	-------	-------	--------	--------	-------	--------

	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	2,056	488	1,567	101,391
当中間期変動額				
剰余金の配当				5,092
中間純利益				3,335
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)	1,400	587	813	813
当中間期変動額合計	1,400	587	813	943
当中間期末残高	3,457	1,075	2,381	100,447

注記事項  
(重要な会計方針)

項目	第65期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 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) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以降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。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p>



4 収益の計上基準	<p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行業務の内容及び当該履行業務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。</p>
5 ヘッジ会計の方法	<p>(1) 投資信託委託業務 当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」）に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドのAUMに固定料率を乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問業務 当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドのAUMに投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。</p> <p>(3) 成功報酬 当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。</p> <p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引細則等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
6 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 資産に係る控除対象外消費税等の会計処理 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は当中間会計期間の費用として処理しております。</p> <p>(2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。</p>

## (中間貸借対照表関係)

第65期中間会計期間 (2023年9月30日)
1 有形固定資産の減価償却累計額 2,354百万円

- 2 信託資産  
流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
- 3 消費税等の取扱い  
仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
- 4 保証債務  
ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド（旧社名「日興AMエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」）が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大480百万円（5百万豪ドル）を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。

## （中間損益計算書関係）

第65期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	46百万円
無形固定資産	50百万円
2 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	16百万円
受取配当金	1,205百万円
3 営業外費用のうち主要なもの	
支払利息	255百万円
為替差損	184百万円
デリバティブ費用	1,017百万円
4 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券売却益	501百万円
5 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券売却損	97百万円
6 中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。	

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第65期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

## 3 新株予約権等に関する事項

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

2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	217,000	-	96,000	121,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	752,000	-	406,000	346,000	-
合計		969,000	-	502,000	467,000	-

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

2 2016年度ストックオプション(2)121,000株及び2017年度ストックオプション(1)346,000株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

#### 4 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年5月26日 取締役会	普通株式	5,092	26.23	2023年3月31日	2023年6月27日

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

##### (リース取引関係)

第65期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	911百万円
1年超	3,049百万円
合計	3,961百万円

##### (金融商品関係)

第65期中間会計期間(2023年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

##### (1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託 有価証券 其他有価証券 投資信託	-	2,500	-	2,500
資産計	6,821	17,357	-	24,178
デリバティブ取引(1、2)				
株式関連	242	-	-	242
通貨関連	-	685	-	685
デリバティブ取引計	242	685	-	442

(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242百万円は、中間貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。また通貨関連のデリバティブ取引のうち685百万円は、流動負債のその他に含まれております。

## (2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、未収収益、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

## 金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

## 有価証券

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

## デリバティブ取引

## 株式関連

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

## 通貨関連

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

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

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
非上場株式	16
子会社株式	19,011
関連会社株式	18,635

## (有価証券関係)

第65期中間会計期間(2023年9月30日)

## 1 子会社株式及び関連会社株式

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

## 2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	22,320	17,117	5,202
	小計	22,320	17,117	5,202
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	1,858	2,078	220
	小計	1,858	2,078	220
合計		24,178	19,195	4,982

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

2 非上場株式(中間貸借対照表計上額16百万円)については、市場価格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。

## (デリバティブ取引関係)

第65期中間会計期間(2023年9月30日)

## 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 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)
株価指数先物取引				

市場取引	売建	13,289	-	242	242
	合計	13,289	-	242	242

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

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引 通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等(百万円)	契約額等のうち1年超(百万円)	時価(百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		6,055	-	528
	豪ドル		124	-	2
	ユーロ		344	-	7
	香港ドル		527	-	53
	人民元		2,876	-	93
	合計		9,928	-	685

### (持分法損益等)

第65期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	5,339百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	16,494百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,148百万円

### (収益認識関係)

第65期中間会計期間(2023年9月30日)

#### 1 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

#### 2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「重要な会計方針 4 . 収益の計上基準」に記載の通りです。

#### 3 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

### (ストックオプション等関係)

第65期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

### (セグメント情報等)

#### [セグメント情報]

第65期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載していません。

#### [関連情報]

第65期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30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、記載していません。

#### 2 地域ごとの情報

##### (1) 営業収益

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

ます。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無い場合、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無い場合、記載していません。

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65期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第65期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第65期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第65期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
1株当たり純資産額	517円36銭
1株当たり中間純利益金額	17円17銭

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第65期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
中間純利益(百万円)	3,335
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式に係る中間純利益(百万円)	3,335
普通株式の期中平均株式数(千株)	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2016年度ストックオプション(2)121,000株、 2017年度ストックオプション(1)346,000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65期中間会計期間 (2023年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	100,447
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額(百万円)	100,447
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数(千株)	194,152

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

## 5【その他】

- (1) 定款の変更  
委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項  
委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2023年3月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	50,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2023年3月末現在)	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
損保ジャパン D C 証券株式会社	3,000百万円	
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
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。
住友生命保険相互会社	639,000百万円 (基金及び基金償却積立金の合計額)	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
日本生命保険相互会社	1,450,000百万円 (基金及び基金償却積立金の合計額)	
富国生命保険相互会社	128,000百万円 (基金及び基金償却積立金の合計額)	
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
信金中央金庫	690,998百万円 (出資の総額)	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

- (1) 受託会社  
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。
- (2) 販売会社  
日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行ないます。

### 3【資本関係】

- (1) 受託会社  
該当事項はありません。
- (2) 販売会社  
該当事項はありません。

### 第3【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
2023年 2月 7日	有価証券届出書
2023年 2月 7日	有価証券報告書
2023年 8月 7日	有価証券届出書
2023年 8月 7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

2024年1月24日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

PwC Japan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DCインデックスバランス（株式40）の2022年11月8日から2023年11月6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、DCインデックスバランス（株式40）の2023年11月6日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立

案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注)1.上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2.XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2023年12月5日

日興アセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

## 有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 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

### 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第65期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 中間監査意見の根拠

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

### 中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

### 中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注)1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。