

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年6月21日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 ステファニー・ドゥルーズ
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	グローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

グローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）（以下「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

（５）【申込手数料】

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

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

（６）【申込単位】

販売会社の照会先にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2024年6月22日から2024年12月24日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

（９）【払込期日】

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

（10）【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

（11）【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

主として、日本を含む世界各国の株式、不動産投信（REIT）および債券などを実質的な投資対象とする投資信託証券に投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

資産複合 資産配分固定型 (その他資産(投資信託証券(株式、不動産投信、その他資産(株価指数先物取引、国債先物取引))))

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

「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。

ファンド・オブ・ファンズ

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

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1

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

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

2

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

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

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

3

年1回、決算を行ないます。

■毎年9月21日(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

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

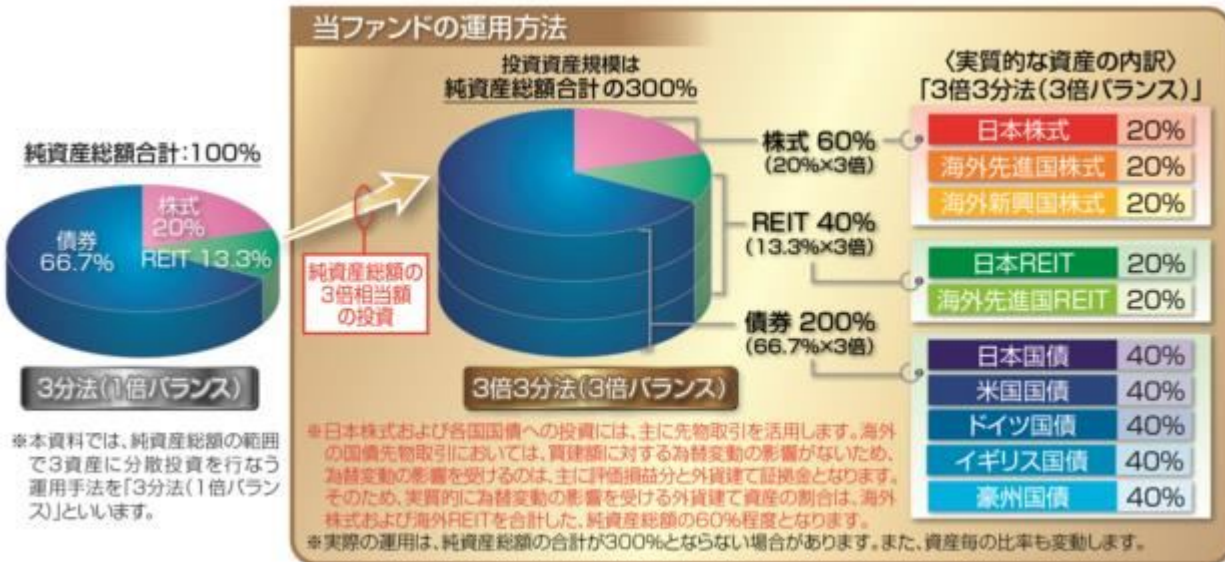
世界の株式、REIT、債券の3つの資産に対し、純資産総額の3倍相当額の投資を行なう運用手法を「3倍3分法」としています。

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

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

投資対象資産と実質的な資産の内訳について

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



※上記はイメージ図です。

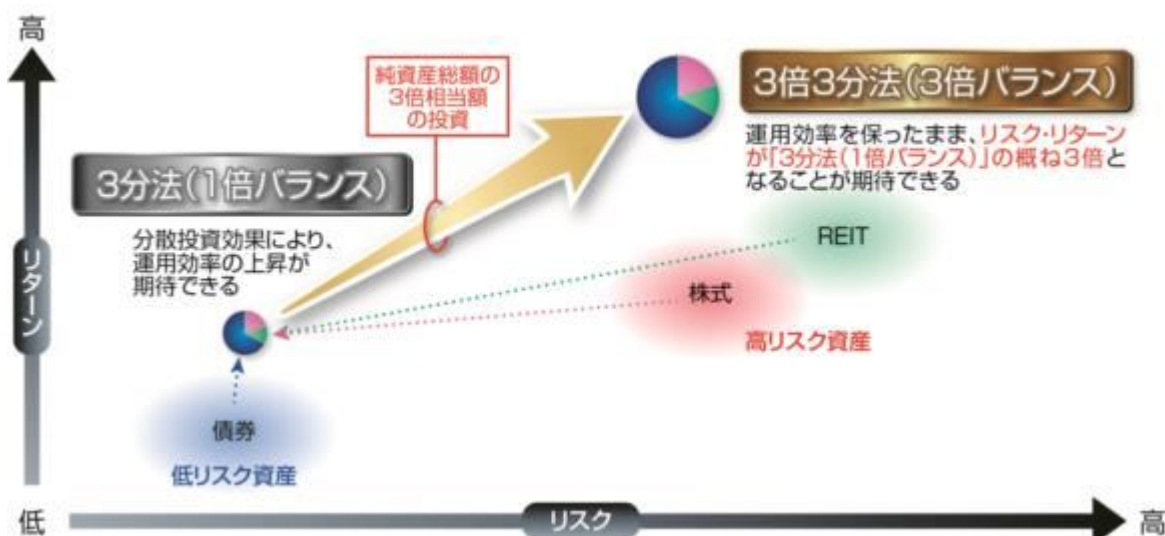
※上記の「3分法(1倍バランス)」の資産配分比率は、「3倍3分法(3倍バランス)」の実質的な資産配分比率の1/3(端数は四捨五入)として計算したものであり、実在するポートフォリオではありません。

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

「3倍3分法(3倍バランス)」のリスク・リターンイメージ

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

<各資産のリスク・リターンのイメージ>



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

※実際の累積のパフォーマンスが3倍になる訳ではありません。

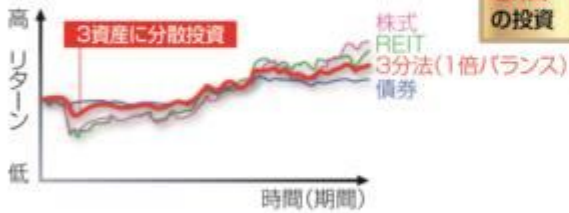
当ファンドの値動きのイメージ

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

「3分法(1倍バランス)」の値動きのイメージ



値動きの異なる資産を組み合わせることで、
リスク(値動きのブレ)が抑制され、
リターン(安定化)が期待される



純資産総額の
3倍
相当額
の投資

「3倍3分法(3倍バランス)」に期待される運用成果



先物取引を活用することで、「3分法(1倍バランス)」に比べて、
リスク(値動きのブレ)が大きくなる一方、
リターン(向上)が期待される



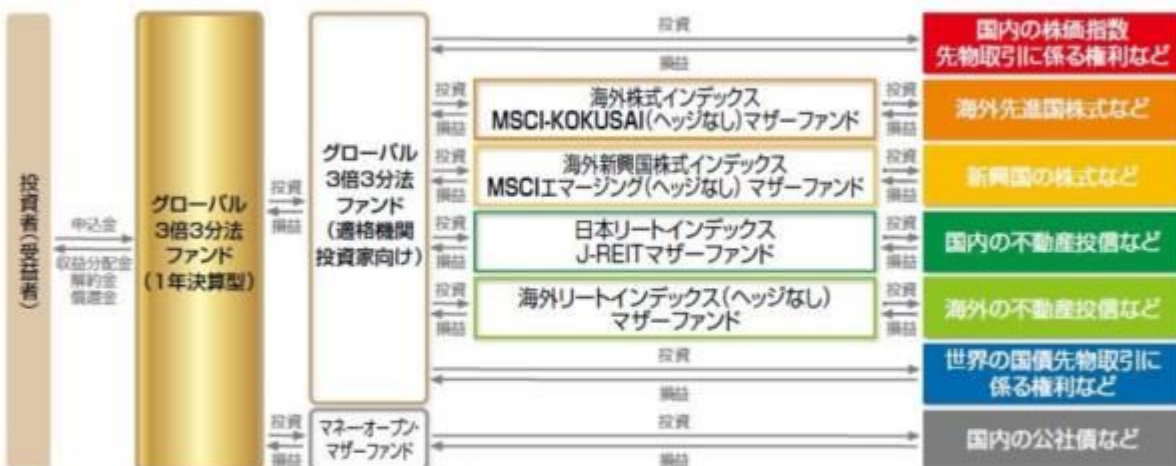
※市況動向および設定・解約による資金動向、収益分配などから、日々
の値動きが、「3分法(1倍バランス)」の3倍になるとは限りません。
※中長期で見ると、複利の効果により、「3分法(1倍バランス)」のパー
フォーマンスとのかい離がプラスにもマイナスにも大きくなる傾向があり
ます。そのため、累積のパフォーマンスが3倍になる訳ではありません。

※当ファンドのリスクについては、後述の「投資リスク」をご覧ください。

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

ファンドの仕組み

■当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



※投資先投資信託証券は適宜見直しを行いません。

(主な投資制限)

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

(分配方針)

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

信託金限度額

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

(2) 【ファンドの沿革】

2018年10月 4日

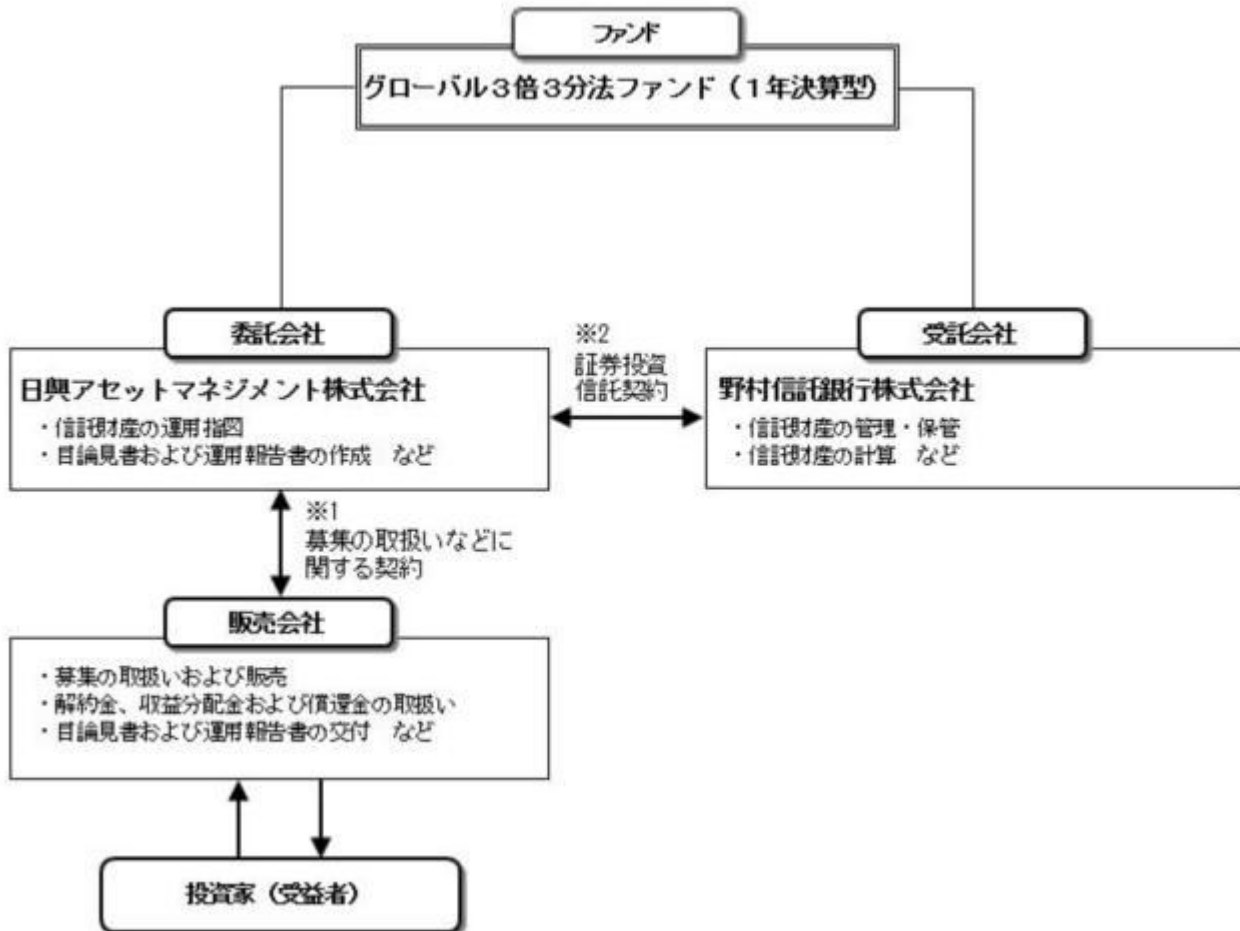
・ ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2020年12月24日

・ 信託期間を無期限に変更

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

<ファンド・オブ・ファンズの仕組み>

当ファンドは、投資信託証券に投資するファンド・オブ・ファンズです。



※投資先投資信託証券は適宜見直しを行いません。

委託会社の概況（2024年3月末現在）

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

名称	住所	所有株数	所有比率
----	----	------	------

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- ・主として、日本を含む世界各国の株式、不動産投信および債券等を実質的な投資対象とする別に定める投資信託証券の一部、またはすべてに投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
- ・投資信託証券の合計組入率は、高位を保つことを原則とします。各投資信託証券への投資比率は、原則として、市況環境および投資対象ファンドの収益性等を勘案して決定します。なお、資金動向等によっては、各投資信託証券への投資比率を引き下げることがあります。
- ・別に定める投資信託証券については、収益機会の追求やリスクの分散などを目的として、適宜見直しを行ないます。この際、定性評価や定量評価等を勘案のうえ、新たに投資信託証券を指定したり、既に指定されていた投資信託証券を外したりする場合があります。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

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

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

投資対象とする投資信託証券の概要

<グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）>

運用の基本方針	
基本方針	インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	以下に掲げる各マザーファンドの受益証券のほか、株価指数先物取引に係る権利および国債先物取引に係る権利等を主要投資対象とします。 証券投資信託 海外株式インデックスMSCI-KOKUSA1（ヘッジなし）マザーファンド 証券投資信託 海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド 証券投資信託 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド 証券投資信託 日本リートインデックスJ-REITマザーファンド
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、上に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行なうとともに、株価指数先物取引に係る権利および国債先物取引に係る権利に投資を行なうことで、実質的に日本を含む世界各国の株式、不動産投信および債券に投資し、インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行ないます。 ・各投資対象資産の組入比率は、原則として、市況環境および投資対象資産のリスク水準等を勘案して決定します。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券（マザーファンドおよび上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。

ファンドに係る費用

信託報酬	純資産総額に対して年率0.088%（税抜0.08%）
その他の報酬	<ul style="list-style-type: none"> 有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額 投資対象とするマザーファンドにおいて有価証券の貸付を行なった場合は、その品貸料に0.55（税抜0.5）を乗じて得た額（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限り、他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）
申込手数料	ファンドで買い付ける場合はありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<ul style="list-style-type: none"> 運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、主要投資対象である各マザーファンドの運用において利用する指数の標章使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。 組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税などについては、その都度、信託財産から支払われます。 <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>

その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2018年10月5日設定）
決算日	毎月21日（休業日の場合は翌営業日）

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

運用の基本方針

基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAI インデックス*（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカウンターファンド等を含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAI インデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引や外国為替予約取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入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（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。

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

運用の基本方針

基本方針	主として金融商品取引所に上場されている新興国の株式に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス*（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	新興国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンド等を含みます。）を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、新興国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンド等を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。 ・投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引や外国為替予約取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
------	--------

申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2006年5月17日設定）
決算日	毎年5月16日（休業日の場合は翌営業日）

* MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が発表している、世界の新興国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。
同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

（ご参考）＜海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞

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

ファンドに係る費用

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

その他

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

* S & P先進国REIT指数（除く日本）は、スタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズ・エル・エル・シー（S & P社）が発表している、日本を除く世界の主要国の不動産投信市場の合成パフォーマンスを表す指数です。
同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はS & P社に帰属します。また、S & P社は

同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

（ご参考）＜日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド＞

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

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

東証R E I T指数の指数値および東証R E I T指数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、利用など東証R E I T指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証R E I T指数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、東証R E I T指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、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。

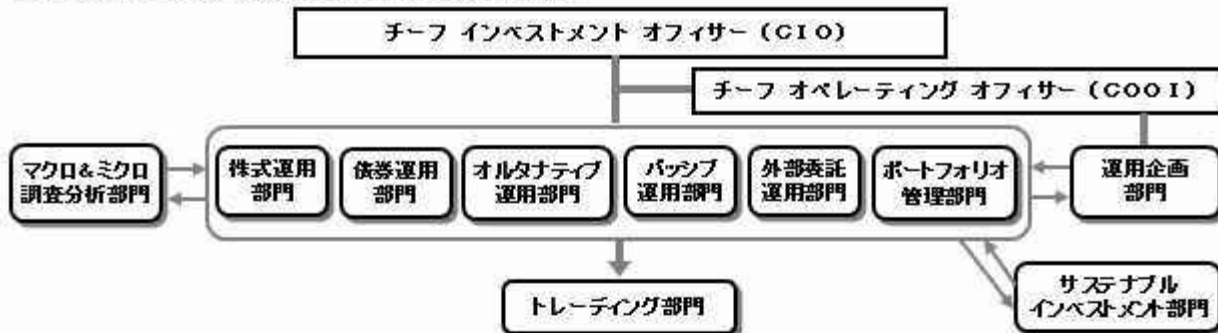
＜マネー・オープン・マザーファンド＞

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

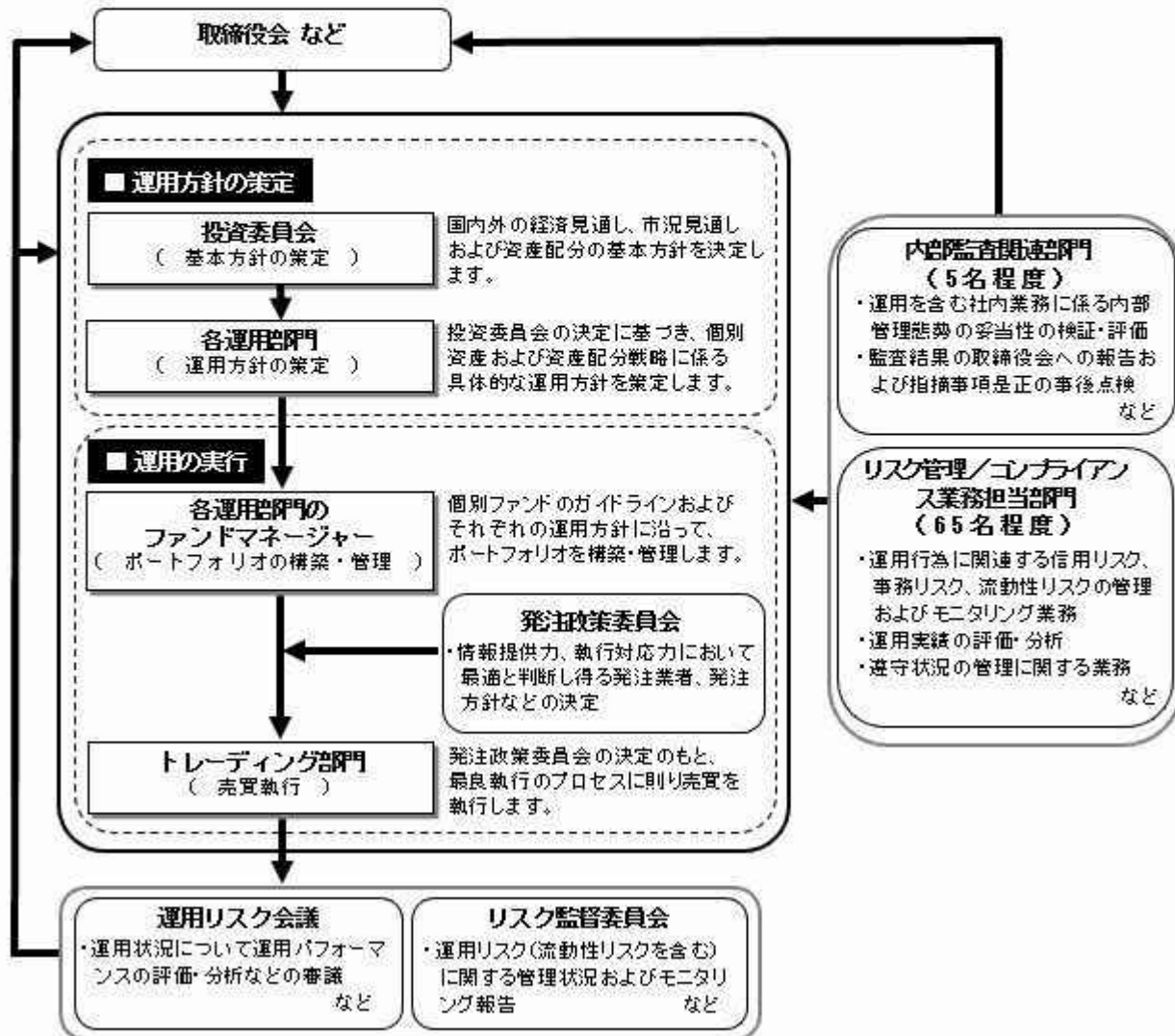
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 株式(新株引受権証券、新株予約権証券および新株引受権付社債券を含みます。)への投資は行ないません。 ・ 外貨建資産への投資は行ないません。 ・ デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限(2003年3月28日設定)
決算日	毎年1月15日(休業日の場合は翌営業日)

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

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

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



上記体制は2024年3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

- 1) 分配対象額の範囲
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
 - 2) 分配対象額についての分配方針
分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
 - 3) 留保益の運用方針
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行いません。
- 収益分配金の支払い
- <分配金再投資コース>
原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。
- <分配金受取りコース>
毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）から収益分配金を支払います。支払いは販売会社において行なわれます。

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

- 1) 投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- 2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
- 3) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産に属する外貨建資産の時価総額と投資信託証券またはマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- 6) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとし、資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範

- 圈内
- ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の範囲内
- 二) 解約に伴な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弁済される日からその翌営業日までとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一のものに対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

流動性リスク

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

信用リスク

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

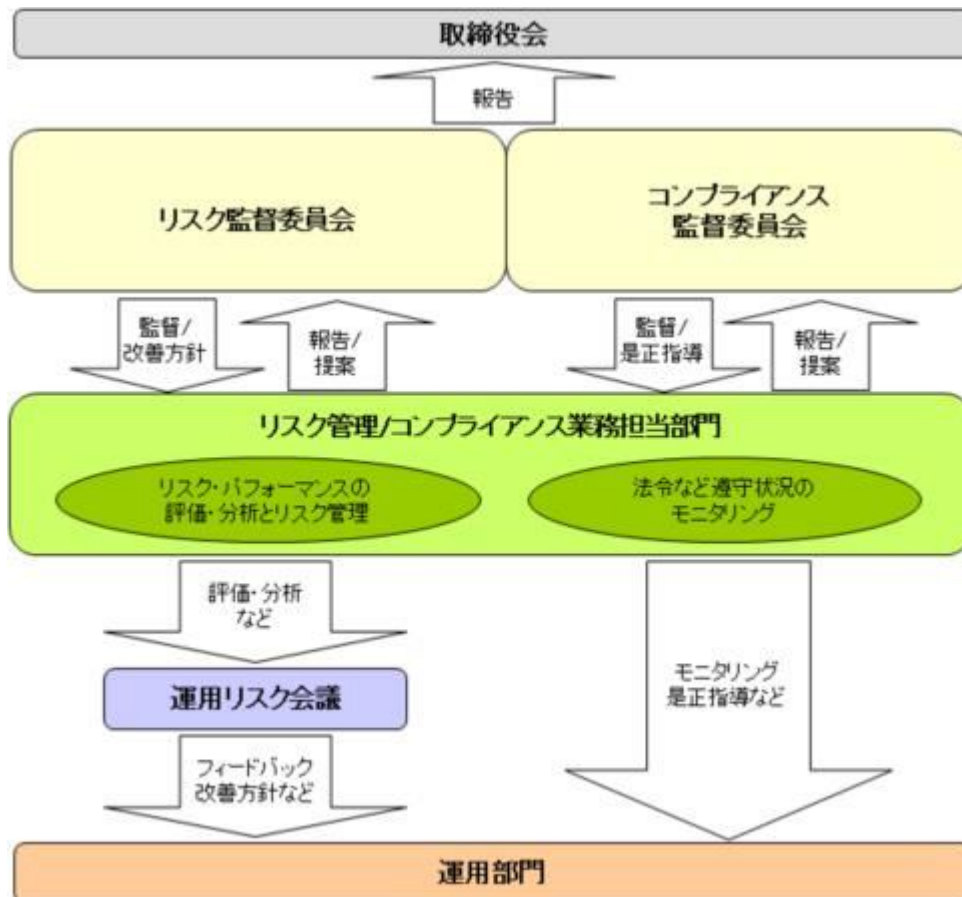
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。
為替変動リスク
- ・外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
- ・一般に新興国の通貨は、先進国の通貨に比べて為替変動が大きくなる場合があります。
カントリー・リスク
- ・投資対象国における非常事態など（金融危機、財政上の理由による国自体のデフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）を含む市況動向や資金動向などによっては、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあり、投資方針に従った運用ができない場合があります。
- ・一般に新興国は、情報の開示などが先進国に比べて充分でない、あるいは正確な情報の入手が遅延する場合があります。
- ・ファンドの投資対象資産が上場または取引されている諸国の税制は各国によって異なります。また、それらの諸国における税制が一方的に変更されたり、新たな税制が適用されたりすることもあります。以上のような要因は、ファンドの信託財産の価値に影響を与える可能性があります。
デリバティブリスク
金融契約に基づくデリバティブとよばれる金融派生商品を用いることがあり、その価値は基礎となる原資産価値などに依存し、またそれらによって変動します。デリバティブの価値は、種類によっては、基礎となる原資産の価値以上に変動することがあります。
レバレッジリスク
株価指数先物取引および国債先物取引などを積極的に用いてレバレッジ取引を行いません。したがって、株式や債券の影響を大きく受けません。

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

< その他の留意事項 >

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項
証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・換金の取り扱いを停止することもあります。
- ・投資対象とする投資信託証券に関する事項
諸事情により、投資対象とする投資信託証券にかかる投資や換金ができない場合があります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができなくなる場合があります。また、一時的にファンドの取得・換金ができなくなることもあります。
ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。
- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

(2) リスク管理体制



全社リスク管理

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

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2024年3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	4.7%	10.7%	17.9%	8.4%	-0.8%	4.3%	5.9%
最大値	37.6%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	15.3%	21.5%
最小値	-31.8%	-11.4%	-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2019年4月から2024年3月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。ただし、当ファンドは直近1年間の騰落率が5年分ないため、設定日以降算出できる値を使用しています。

<各資産クラスの指数>

日本株……TOPIX(東証株価指数)配当込み

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(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

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2019年4月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

LLCに帰属します。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

- ・販売会社における申込手数料率は3.3%（税抜3%）が上限となっております。
 - ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
 - ・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
 - ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- 申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料
ありません。
信託財産留保額
ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬率（年率）＜純資産総額に対し＞	
当ファンド	0.396%（税抜0.36%）
投資対象とする投資信託証券	0.088%（税抜0.08%）程度*
実質的負担	0.484%（税抜0.44%）程度

・当ファンドの信託報酬は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.396%（税抜0.36%）の率を乗じて得た額とします。

・投資対象とする投資信託証券の組入れに係る信託報酬率（年率）0.088%（税抜0.08%）程度*がかかり、受益者が実質的に負担する信託報酬率（年率）は0.484%（税抜0.44%）程度となります。

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

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

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

信託報酬の配分

当ファンドの信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.36%	0.14%	0.20%	0.02%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

(4)【その他の手数料等】

以下の諸費用およびそれに付随する消費税等相当額について、委託会社は、その支払いをファンドのために行ない、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。（以下「実費方式」といいます。）なお、からまでに該当する業務を委託する場合は、その委託費用を含みます。また、実際に支払う金額の支弁を受ける代わりに、その金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、見積額に基づいて見積率を算出し、かかる見積率を信託財産の純資産総額に乗じて得た額をかかるとみなして、

信託財産から支弁を受けることができます。（以下「見積方式」といいます。）ただし、委託会社は、信託財産の規模などを考慮して、信託の設定時または期中に、かかる諸費用の見積率を見直し、年率0.1%を上限として、これを変更することができます。委託会社は、実費方式または見積方式のいずれを用いるかについて、信託期間を通じて随時、見直すことができます。これら諸費用は、委託会社が定めた時期に、信託財産から支払います。

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

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

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

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

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

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

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

格付の取得に要する費用。

ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。

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

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

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

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

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料。

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

「グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）」

- ・運用報告書などの作成および交付に係る費用、計理等の業務に係る費用（業務委託する場合の委託費用を含みます。）、監査費用、主要投資対象である各マザーファンドの運用において利用する指数の標章使用料などについては、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。
 - ・組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税などについては、その都度、信託財産から支払われます。
- 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

「マネー・オープン・マザーファンド」

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

（5）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

- ・公募株式投資信託は税法上、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。

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

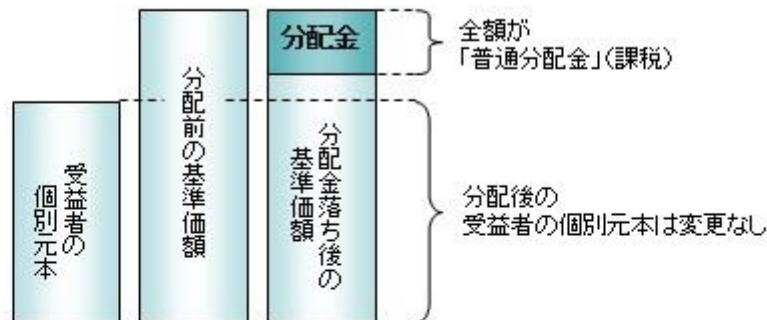
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

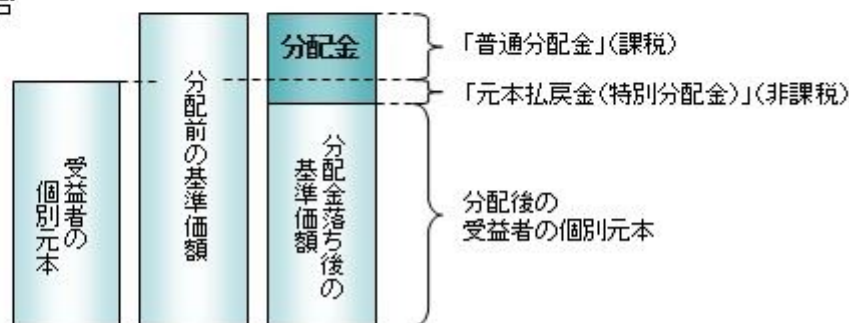
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<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6月21日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

(参考情報)ファンドの総経費率

対象期間:2022年9月22日～2023年9月21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
0.61%	0.39%	0.22%

※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。

※その他費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みます。

※投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

※ファンド(実質的な保有も含みます)がREIT(不動産投資信託)等に投資している場合、それらの保有にかかる費用は上記には含まれておりません。

※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】

【グローバル3倍3分法ファンド(1年決算型)】

以下の運用状況は2024年3月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	171,946,547,822	99.43
親投資信託受益証券	日本	156,138,098	0.09
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		824,292,047	0.48
合計(純資産総額)		172,926,977,967	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資信託受益証券	グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	116,329,441,731	1.2745	148,261,873,486	1.4781	171,946,547,822	99.43
日本	親投資信託受益証券	マナー・オープン・マザーファンド	153,800,333	1.0153	156,153,479	1.0152	156,138,098	0.09

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.43
親投資信託受益証券	0.09
合計	99.52

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2019年 9月24日)	181,245	181,245	1.2436	1.2436
第2計算期間末 (2020年 9月23日)	355,637	355,637	1.2205	1.2205
第3計算期間末 (2021年 9月21日)	214,680	214,680	1.5638	1.5638
第4計算期間末 (2022年 9月21日)	153,892	153,892	1.2252	1.2252
第5計算期間末 (2023年 9月21日)	163,277	163,277	1.2360	1.2360
2023年 3月末日	157,636		1.1941	
4月末日	159,752		1.2077	
5月末日	159,493		1.2067	
6月末日	166,680		1.2585	
7月末日	167,250		1.2585	
8月末日	166,385		1.2524	
9月末日	154,029		1.1657	
10月末日	146,181		1.1051	
11月末日	164,182		1.2542	
12月末日	172,610		1.3558	
2024年 1月末日	166,747		1.3336	
2月末日	165,435		1.3424	
3月末日	172,926		1.4290	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2018年10月 4日～2019年 9月24日	0.0000
第2期	2019年 9月25日～2020年 9月23日	0.0000
第3期	2020年 9月24日～2021年 9月21日	0.0000
第4期	2021年 9月22日～2022年 9月21日	0.0000
第5期	2022年 9月22日～2023年 9月21日	0.0000
当中間期	2023年 9月22日～2024年 3月21日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2018年10月 4日～2019年 9月24日	24.36
第2期	2019年 9月25日～2020年 9月23日	1.86
第3期	2020年 9月24日～2021年 9月21日	28.13
第4期	2021年 9月22日～2022年 9月21日	21.65
第5期	2022年 9月22日～2023年 9月21日	0.88
当中間期	2023年 9月22日～2024年 3月21日	13.41

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

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
---	----	---------	---------

第1期	2018年10月 4日～2019年 9月24日	149,835,081,121	4,090,945,074
第2期	2019年 9月25日～2020年 9月23日	265,601,504,023	119,947,170,483
第3期	2020年 9月24日～2021年 9月21日	27,271,595,688	181,389,655,088
第4期	2021年 9月22日～2022年 9月21日	21,374,040,998	33,046,143,927
第5期	2022年 9月22日～2023年 9月21日	24,387,803,435	17,890,740,462
当中間期	2023年 9月22日～2024年 3月21日	11,284,146,183	21,449,057,537

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考)

グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）

以下の運用状況は2024年 3月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	203,002,750,206	78.76
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		54,739,211,372	21.24
合計（純資産総額）		257,741,961,578	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	51,549,700,000	20.00
債券先物取引	買建	日本	100,220,960,000	38.88
	買建	アメリカ	99,530,557,979	38.62
	買建	ドイツ	100,525,715,690	39.00
	買建	イギリス	101,190,239,406	39.26
	買建	オーストラリア	101,045,802,085	39.20

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-K OKUSAI（ヘッジなし）マザー ファンド	8,281,596,132	6.1984	51,332,645,464	6.2553	51,803,868,284	20.10
日本	親投資信託受益証券	海外リートインデックス（ヘッジな し）マザーファンド	15,349,636,391	3.2635	50,093,538,362	3.3396	51,261,645,691	19.89
日本	親投資信託受益証券	海外新興国株式インデックスMSC IEマージング（ヘッジなし）マ ザーファンド	18,734,603,444	2.6852	50,306,157,167	2.7108	50,785,763,015	19.70
日本	親投資信託受益証券	日本リートインデックスJ-REI Tマザーファンド	19,487,539,932	2.5260	49,225,525,868	2.5222	49,151,473,216	19.07

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	78.76
合計	78.76

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	日本	大阪取引所	東証株価指数先物 2024年06月	買建	1,861	日本円	51,707,885,000	51,707,885,000	51,549,700,000	51,549,700,000	20.00
債券先物取引	日本	大阪取引所	東証長期国債標準先物 2024年06月	買建	688	日本円	100,042,080,000	100,042,080,000	100,220,960,000	100,220,960,000	38.88
	アメリカ	シカゴ商品取引所	TNOTE10Y2406	買建	5,933	米ドル	655,225,687.5	99,207,721,344	657,357,889.04	99,530,557,979	38.62
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUND10Y 2406	買建	4,617	ユーロ	609,028,470	99,417,807,442	615,815,460	100,525,715,690	39.00
	オーストラリア	シドニー先物取引所	AUSTR10Y2406	買建	8,790	豪ドル	1,017,622,695	100,347,773,953	1,024,701,369.9	101,045,802,085	39.20
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	GILT10Y 2406	買建	5,295	英ポンド	524,522,700	100,299,230,694	529,182,300	101,190,239,406	39.26

(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2024年 3月29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	277,677,557,797	70.28
	カナダ	12,918,555,323	3.27
	ドイツ	9,318,433,461	2.36
	イタリア	2,133,994,264	0.54
	フランス	11,860,547,599	3.00
	オランダ	7,972,105,128	2.02
	スペイン	2,751,614,595	0.70
	ベルギー	808,154,361	0.20
	オーストリア	191,352,899	0.05
	ルクセンブルク	187,603,909	0.05
	フィンランド	1,031,439,939	0.26
	アイルランド	7,568,815,225	1.92
	ポルトガル	152,975,147	0.04
	イギリス	14,238,562,761	3.60
	スイス	11,471,778,191	2.90
	スウェーデン	3,290,925,577	0.83
ノルウェー	613,532,004	0.16	
デンマーク	3,945,330,249	1.00	

	ケイマン	431,627,645	0.11
	オーストラリア	7,136,279,373	1.81
	バミューダ	438,457,875	0.11
	ニュージーランド	270,478,273	0.07
	香港	1,571,763,737	0.40
	シンガポール	1,123,538,451	0.28
	イスラエル	794,744,163	0.20
	ジャージー	958,665,105	0.24
	アラブ首長国連邦	0	0.00
	マン島	37,906,237	0.01
	小計	380,896,739,288	96.40
投資証券	アメリカ	6,497,040,596	1.64
	カナダ	14,554,531	0.00
	フランス	138,720,209	0.04
	ベルギー	33,388,424	0.01
	イギリス	111,337,349	0.03
	オーストラリア	485,474,966	0.12
	香港	67,786,390	0.02
	シンガポール	128,319,508	0.03
	小計	7,476,621,973	1.89
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		6,754,764,579	1.71
合計（純資産総額）		395,128,125,840	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	6,229,139,883	1.58
	買建	ドイツ	1,118,863,284	0.28

(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		6,660,572,340	1.69
	売建		74,978,418	0.02

(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	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	297,214	51,938.80	15,436,939,855	63,701.21	18,932,892,974	4.79
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	618,144	25,989.52	16,065,269,869	25,963.78	16,049,359,028	4.06
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	103,970	64,688.34	6,725,646,793	136,808.01	14,223,929,798	3.60

アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	391,570	18,690.15	7,318,504,409	27,311.33	10,694,299,759	2.71
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	93,470	46,114.64	4,310,335,592	73,521.66	6,872,070,289	1.74
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	249,240	19,102.42	4,761,088,737	22,852.31	5,695,710,068	1.44
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	217,860	19,245.57	4,192,839,936	23,053.68	5,022,476,163	1.27
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	33,969	89,427.01	3,037,746,292	117,790.92	4,001,239,884	1.01
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	18,695	131,954.05	2,466,881,005	200,680.32	3,751,718,734	0.95
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	121,450	21,409.06	2,600,130,435	30,327.42	3,683,265,523	0.93
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	55,095	51,340.94	2,828,629,588	63,670.93	3,507,950,065	0.89
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	120,535	32,187.46	3,879,715,959	26,616.36	3,208,203,423	0.81
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	167,431	16,410.71	2,747,662,283	17,599.89	2,946,768,589	0.75
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	38,900	80,231.50	3,121,005,378	74,902.52	2,913,708,300	0.74
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	66,522	36,020.43	2,396,151,643	42,255.50	2,810,920,557	0.71
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	137,440	15,218.38	2,091,614,382	19,282.84	2,650,234,079	0.67
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	35,225	58,774.69	2,070,338,640	72,914.51	2,568,413,745	0.65
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	16,992	93,047.04	1,581,055,406	145,642.72	2,474,761,234	0.63
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	41,945	42,925.87	1,800,525,742	58,080.87	2,436,202,344	0.62
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	98,929	22,823.83	2,257,939,278	24,566.27	2,430,316,772	0.62
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	101,081	22,986.25	2,323,473,804	23,951.54	2,421,046,413	0.61
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	106,393	15,774.70	1,678,318,317	19,978.54	2,125,577,817	0.54
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	18,634	84,258.38	1,570,070,704	110,927.50	2,067,023,190	0.52
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	74,266	22,116.85	1,642,530,666	27,571.76	2,047,644,402	0.52
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	68,124	15,007.13	1,022,346,334	27,327.99	1,861,692,052	0.47
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	40,646	30,220.39	1,228,337,972	45,601.66	1,853,525,227	0.47

スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	112,580	16,537.49	1,861,790,925	16,078.33	1,810,099,517	0.46
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	75,091	23,553.33	1,768,643,824	23,883.41	1,793,429,396	0.45
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	298,479	3,905.44	1,165,693,165	5,741.46	1,713,707,388	0.43
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	18,540	62,931.68	1,166,753,413	91,955.83	1,704,861,186	0.43

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	4.61
		素材	3.79
		資本財	7.03
		商業・専門サービス	1.58
		運輸	1.73
		自動車・自動車部品	1.61
		耐久消費財・アパレル	1.48
		消費者サービス	2.01
		メディア・娯楽	6.26
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.87
		生活必需品流通・小売り	1.70
		食品・飲料・タバコ	3.21
		家庭用品・パーソナル用品	1.56
		ヘルスケア機器・サービス	4.23
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.83
		銀行	5.47
		金融サービス	6.70
		保険	3.06
		ソフトウェア・サービス	10.01
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.53
電気通信サービス	1.10		
公益事業	2.45		
半導体・半導体製造装置	8.26		
不動産管理・開発	0.30		
投資証券			1.89
合計			98.29

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 EMINI2406	買建	155	米ドル	40,597,262.5	6,146,831,514	41,140,875	6,229,139,883	1.58
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2406	買建	155	ユーロ	6,789,500	1,108,317,980	6,854,100	1,118,863,284	0.28

(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	37,850,000.00	5,621,233,000	5,694,153,810	1.44
	ユーロ	買建	5,950,000.00	959,519,194	966,418,530	0.24
	スウェーデンクローナ	売建	1,450,000.00	20,649,885	20,508,510	0.01
	デンマーククローネ	売建	1,080,000.00	23,713,560	23,621,004	0.01
	豪ドル	売建	313,000.00	30,890,783	30,848,904	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外新興国株式インデックスMSCIEマージング（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2024年 3月29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	262,070,270	0.22
	メキシコ	3,026,657,290	2.53
	ブラジル	6,028,162,073	5.04
	チリ	550,607,697	0.46
	コロンビア	129,130,047	0.11
	ペルー	387,713,339	0.32
	オランダ	64,160,988	0.05
	ルクセンブルク	121,014,988	0.10
	ギリシャ	606,956,166	0.51
	イギリス	147,256,734	0.12
	トルコ	787,693,180	0.66
	チェコ	159,981,449	0.13
	キプロス	0	0.00
	ハンガリー	290,540,527	0.24
	ポーランド	1,028,242,241	0.86
	ロシア	5,104,405	0.00
	ケイマン	11,159,925,677	9.32
	バミューダ	241,100,136	0.20
	香港	1,547,645,478	1.29
	シンガポール	25,073,343	0.02
	マレーシア	1,563,107,888	1.31
タイ	1,737,517,736	1.45	
フィリピン	733,616,375	0.61	
インドネシア	2,172,645,998	1.81	
韓国	14,760,461,260	12.33	
台湾	19,758,540,690	16.51	
中国	16,334,623,430	13.65	

	インド	20,568,071,933	17.18
	カタール	941,253,376	0.79
	エジプト	70,521,751	0.06
	南アフリカ	2,958,541,843	2.47
	アラブ首長国連邦	1,389,145,081	1.16
	クウェート	956,645,997	0.80
	サウジアラビア	4,878,408,220	4.08
	小計	115,392,137,606	96.40
社債券	インド	0	0.00
投資証券	メキシコ	123,741,903	0.10
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		4,190,398,477	3.50
合計（純資産総額）		119,706,277,986	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	4,367,799,975	3.65

(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		249,680,970	0.21
	売建		41,049,574	0.03

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,614,355	2,367.86	6,190,451,766	3,635.44	9,504,350,349	7.94
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	508,450	7,313.27	3,718,436,777	9,090.00	4,621,810,500	3.86
中国	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	703,050	6,542.91	4,599,996,672	5,875.49	4,130,764,651	3.45
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	1,729,200	1,631.75	2,821,622,772	1,358.63	2,349,351,642	1.96
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	322,912	4,221.71	1,363,242,786	5,438.21	1,756,063,590	1.47
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	58,250	10,032.58	584,398,120	20,047.50	1,167,766,875	0.98
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費財・サービス流通・小売り	63,570	11,089.10	704,934,492	17,601.41	1,118,921,793	0.93
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	548,887	1,734.73	952,171,370	2,000.73	1,098,179,627	0.92
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	537,585	2,594.90	1,394,984,209	1,872.11	1,006,419,330	0.84
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,327,212	484.42	642,938,929	735.12	975,668,381	0.82

インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	350,708	2,321.42	814,142,074	2,741.43	961,441,959	0.80
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	10,158,920	103.37	1,050,162,817	91.28	927,354,980	0.77
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	162,432	3,193.83	518,780,543	5,483.90	890,760,845	0.74
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	297,743	3,024.26	900,454,543	2,649.65	788,916,824	0.66
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	208,482	3,016.77	628,943,390	3,349.76	698,364,873	0.58
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	97,039	6,009.69	583,174,624	7,093.62	688,358,665	0.58
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	85,570	6,140.35	525,429,752	7,560.00	646,909,200	0.54
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	204,375	2,678.74	547,469,055	3,148.55	643,485,315	0.54
ブラジル	株式	VALE SA	素材	348,106	2,083.16	725,160,623	1,834.90	638,741,974	0.53
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	5,899,900	84.72	499,883,460	96.72	570,638,328	0.48
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	19,880	26,095.97	518,787,984	26,826.82	533,317,271	0.45
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	236,795	1,474.21	349,087,497	2,248.33	532,395,197	0.44
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA - H	銀行	6,986,575	82.69	577,742,093	76.19	532,374,220	0.44
中国	株式	BANK OF CHINA LTD - H	銀行	8,482,000	62.88	533,380,277	62.46	529,855,272	0.44
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	一般消費財・サービス流通・小売り	251,473	2,673.17	672,230,169	2,086.78	524,770,336	0.44
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	464,960	774.02	359,888,837	1,126.94	523,984,682	0.44
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	312,375	1,440.00	449,820,485	1,644.64	513,746,919	0.43
インド	株式	LARSEN & TOUBRO LTD	資本財	71,030	4,137.69	293,900,264	6,887.93	489,250,165	0.41
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	464,715	814.74	378,623,360	1,044.89	485,579,904	0.41
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	239,160	2,357.43	563,803,384	1,986.21	475,023,897	0.40

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	5.15
		素材	6.94
		資本財	4.73
		商業・専門サービス	0.04
		運輸	1.97
		自動車・自動車部品	3.72
		耐久消費財・アパレル	1.16
		消費者サービス	2.38
		メディア・娯楽	5.65
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.79
		生活必需品流通・小売り	1.33
		食品・飲料・タバコ	3.34

	家庭用品・パーソナル用品	0.74
	ヘルスケア機器・サービス	1.00
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.35
	銀行	16.51
	金融サービス	2.72
	保険	2.43
	ソフトウェア・サービス	2.42
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	9.03
	電気通信サービス	2.68
	公益事業	2.67
	半導体・半導体製造装置	11.29
	不動産管理・開発	1.34
社債券		
投資証券		0.10
合計		96.50

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	ニューヨーク証券取引所	MINMSCIE2406	買建	550	米ドル	29,040,010	4,396,947,914	28,847,500	4,367,799,975	3.65

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	1,650,000.00	249,656,000	249,680,970	0.21
	香港ドル	売建	595,000.00	11,496,744	11,501,350	0.01
	マレーシアリンギット	売建	421,000.00	13,477,515	13,441,224	0.01
	アラブディルハム	売建	390,000.00	16,069,326	16,107,000	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2024年 3月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	44,904,659,040	76.52
	カナダ	866,766,227	1.48
	ドイツ	24,429,013	0.04
	イタリア	4,279,229	0.01
	フランス	1,028,248,691	1.75
	オランダ	102,478,771	0.17

	スペイン	245,166,370	0.42
	ベルギー	608,111,397	1.04
	アイルランド	21,806,218	0.04
	イギリス	2,774,498,166	4.73
	オーストラリア	4,480,304,910	7.63
	ニュージーランド	77,477,368	0.13
	香港	549,414,435	0.94
	シンガポール	1,857,644,011	3.17
	韓国	114,165,509	0.19
	イスラエル	72,126,667	0.12
	ガーンジー	167,355,497	0.29
	小計	57,898,931,519	98.66
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		787,246,569	1.34
合計（純資産総額）		58,686,178,088	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	259,673	18,487.16	4,800,616,558	19,716.61	5,119,871,320	8.72
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	26,390	117,622.85	3,104,067,236	124,963.21	3,297,779,252	5.62
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	155,643	12,406.53	1,930,990,389	14,147.75	2,201,998,315	3.75
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	91,689	16,876.15	1,547,358,106	23,694.15	2,172,493,002	3.70
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	44,490	42,951.98	1,910,933,982	43,917.98	1,953,911,135	3.33
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	233,958	9,016.65	2,109,517,914	8,191.28	1,916,415,720	3.27
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	85,162	16,270.51	1,385,629,905	21,809.09	1,857,306,268	3.16
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	485,860	1,952.47	948,630,961	3,334.00	1,619,859,232	2.76
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	59,402	21,585.00	1,282,192,741	22,257.27	1,322,126,353	2.25
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	290,760	4,886.00	1,420,653,564	4,510.50	1,311,474,114	2.23
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	39,950	28,757.30	1,148,854,187	28,095.63	1,122,420,802	1.91
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	82,086	8,637.94	709,053,983	12,144.59	996,901,315	1.70
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	97,242	10,027.88	975,131,525	9,555.48	929,194,482	1.58
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	161,749	5,155.51	833,898,668	5,391.71	872,103,717	1.49
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	44,262	18,394.32	814,169,534	19,518.26	863,917,361	1.47
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	113,169	7,016.33	794,032,113	6,592.39	746,054,342	1.27
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	35,013	20,217.77	707,885,037	19,468.29	681,643,511	1.16
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	18,070	35,366.34	639,069,905	37,066.68	669,794,946	1.14
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	32,821	23,132.41	759,229,150	19,922.52	653,877,285	1.11
イギリス	投資証券	SEGO PLC	376,228	1,462.36	550,182,546	1,728.24	650,214,671	1.11
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	198,346	2,633.01	522,248,965	3,131.15	621,052,823	1.06
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	199,386	3,154.91	629,045,624	2,838.93	566,044,392	0.96
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	186,857	2,901.01	542,075,072	2,969.15	554,806,480	0.95
アメリカ	投資証券	MP CAREY INC	61,547	10,403.38	640,296,897	8,545.58	525,954,837	0.90
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	75,136	7,553.84	567,565,691	6,975.45	524,108,065	0.89

アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	52,514	10,248.94	538,212,987	9,750.80	512,053,721	0.87
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	89,471	5,285.72	472,918,931	5,568.85	498,251,455	0.85
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,465,934	254.41	372,953,839	334.28	490,043,998	0.84
アメリカ	投資証券	UDR INC	85,209	6,490.94	553,087,077	5,664.24	482,644,916	0.82
香港	投資証券	LINK REIT	720,180	896.21	645,436,551	650.79	468,686,662	0.80

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.66
合計	98.66

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

日本リートインデックスJ - REITマザーファンド

以下の運用状況は2024年 3月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	60,997,618,900	98.76
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		767,085,384	1.24
合計(純資産総額)		61,764,704,284	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	6,928	569,953	3,948,634,391	598,000	4,142,944,000	6.71
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	6,101	544,790.44	3,323,766,526	538,000	3,282,338,000	5.31
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	19,206	161,903.49	3,109,518,492	150,300	2,886,661,800	4.67
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	10,346	293,871.56	3,040,395,206	269,000	2,783,074,000	4.51
日本	投資証券	KDX不動産投資法人 投資証券	17,091	161,743.53	2,764,358,823	158,700	2,712,341,700	4.39
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	28,468	97,400.77	2,772,805,190	94,700	2,695,919,600	4.36
日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	19,950	144,333.51	2,879,453,524	125,600	2,505,720,000	4.06
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	8,952	284,912.67	2,550,538,278	258,800	2,316,777,600	3.75
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	13,285	147,595.46	1,960,805,690	153,200	2,035,262,000	3.30
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	28,756	57,079.44	1,641,376,477	68,000	1,955,408,000	3.17
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,827	355,172.35	2,069,589,316	334,000	1,946,218,000	3.15

日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	11,834	179,380.96	2,122,794,288	164,400	1,945,509,600	3.15
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	19,881	72,331.02	1,438,013,207	79,700	1,584,515,700	2.57
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	10,818	150,283.41	1,625,765,957	135,600	1,466,920,800	2.38
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	17,847	79,828.22	1,424,694,314	80,500	1,436,683,500	2.33
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	4,062	351,924.85	1,429,518,765	332,000	1,348,584,000	2.18
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	2,051	657,550.05	1,348,635,157	645,000	1,322,895,000	2.14
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	3,116	405,391.7	1,263,200,558	408,500	1,272,886,000	2.06
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	7,592	159,605.66	1,211,726,179	154,100	1,169,927,200	1.89
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,470	506,896.71	1,252,034,887	451,000	1,113,970,000	1.80
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	3,791	315,523.23	1,196,148,579	274,100	1,039,113,100	1.68
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	7,285	153,914.61	1,121,267,936	139,300	1,014,800,500	1.64
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,204	484,313.6	1,067,427,184	454,500	1,001,718,000	1.62
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	6,984	149,657.77	1,045,209,882	136,900	956,109,600	1.55
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,920	346,410.06	1,011,517,386	325,500	950,460,000	1.54
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	8,746	112,966.39	988,004,097	105,400	921,828,400	1.49
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,557	155,645.74	864,923,406	153,900	855,222,300	1.38
日本	投資証券	森トラスリート投資法人 投資証券	11,448	71,132.8	814,328,402	72,200	826,545,600	1.34
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	2,051	417,489.2	856,270,352	383,000	785,533,000	1.27
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人 投資証券	6,021	131,025.62	788,905,283	122,700	738,776,700	1.20

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.76
合計	98.76

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

マネー・オープン・マザーファンド

以下の運用状況は2024年 3月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		294,791,132	100.00
合計(純資産総額)		294,791,132	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

該当事項はありません。

ロ. 種類別の投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

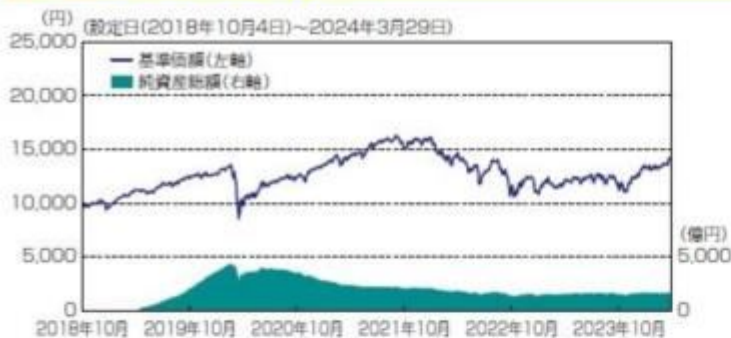
該当事項はありません。

参考情報

運用実績

2024年3月29日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 14,290円

純資産総額…………… 1,729.26億円

※基準価額は、運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2019年9月	2020年9月	2021年9月	2022年9月	2023年9月	設定来累計
0円	0円	0円	0円	0円	0円

主要な資産の状況

<資産構成比>

資産	比率	資産の内訳	比率
株式	59.5%	日本株式(先物)	19.9%
		海外先進国株式	20.0%
		海外新興国株式	19.6%
不動産投資(REIT)	38.7%	日本REIT	19.0%
		海外先進国REIT	19.8%
債券	193.9%	日本国債(先物)	38.7%
		米国国債(先物)	38.4%
		ドイツ国債(先物)	38.8%
		イギリス国債(先物)	39.0%
		豪州国債(先物)	39.0%
合計	292.1%	合計	292.1%
現金その他	21.7%	現金その他	21.7%

<通貨別構成比>

通貨名	比率
日本円	34.1%
アメリカドル	33.0%
ユーロ	4.2%
イギリスポンド	3.9%
香港ドル	3.8%
その他	21.0%

※比率は当ファンド純資産総額比で、先物取引による繰玉は含みません。

※比率は当ファンドの純資産総額比です。

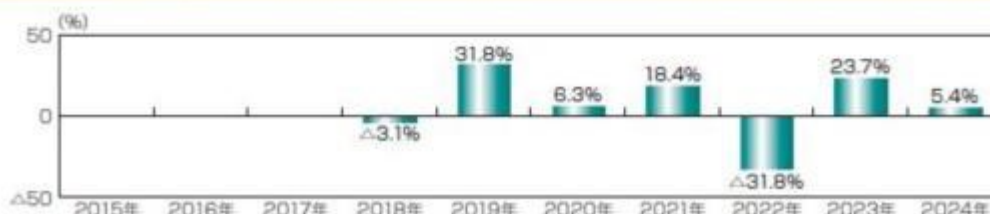
※先物取引にかかる証拠金は「現金その他」に含まれます。

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

日本株式(先物) : 国内の株価指数先物取引に係る権利など
 海外先進国株式 : 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド
 海外新興国株式 : 海外新興国株式インデックスMSCI マーキング(ヘッジなし)マザーファンド
 日本REIT : 日本リートインデックスJ-REITマザーファンド
 海外先進国REIT : 海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド
 世界国債(先物)* : 世界の国債先物取引に係る権利など

*日本、米国、ドイツ、イギリス、豪州の国債(先物)を指します。

年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2018年は、設定時から2018年末までの騰落率です。

※2024年は、2024年3月末までの騰落率です。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

- (1) 申込方法
販売会社所定の方法でお申し込みください。
- (2) コースの選択
収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース＞と＜分配金受取りコース＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。
＜分配金再投資コース＞
収益分配金を自動的に再投資するコースです。なお、販売会社によっては、収益分配金を定期的に受け取るための「定期引出契約」を結ぶことができます場合があります。
＜分配金受取りコース＞
収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。
- (3) 申込みの受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (4) 取扱時間
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
2024年11月5日以降は、原則として、午後3時30分までに、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する予定です。販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (5) 取得申込不可日
販売会社の営業日であっても、取得申込日が下記のいずれかに該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
 - ・ニューヨーク証券取引所の休業日
 - ・英国証券取引所の休業日
 - ・ニューヨークの銀行休業日
 - ・ロンドンの銀行休業日
- (6) 申込金額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。
- (7) 申込単位
販売会社の照会先にお問い合わせください。
- (8) 申込代金の支払い
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
- (9) 受付の中止および取消
委託会社は、投資対象とする投資信託証券への投資ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少など、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。
金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。
- (10) 償還乗換
 - ・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができる場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
 - ・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。
- (11) 乗換優遇
受益者は、信託期間終了日の1年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができます。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

2【換金（解約）手続等】

< 解約請求による換金 >

- (1) 解約の受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
2024年11月5日以降は、原則として、午後3時30分までに、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する予定です。販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (3) 解約請求不可日
販売会社の営業日であっても、解約請求日が下記のいずれかに該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
 - ・ニューヨーク証券取引所の休業日
 - ・英国証券取引所の休業日
 - ・ニューヨークの銀行休業日
 - ・ロンドンの銀行休業日
- (4) 解約制限

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

(5) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 手取額

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

(7) 解約単位

1口単位

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

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して7営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

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

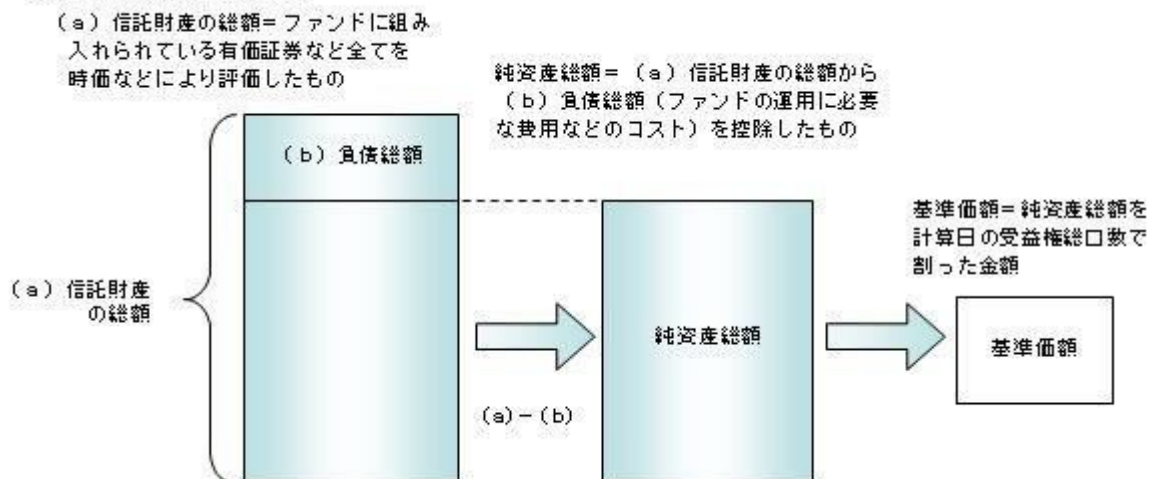
3【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします（2018年10月4日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年9月22日から翌年9月21日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。

イ) 受益者の解約により純資産総額が10億円を下回るようになった場合

ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ) やむを得ない事情が発生したとき

2) この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）

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

イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合

ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）

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

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

償還金について

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

・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

信託約款の変更など

1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（以下「併合」といいます。）を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

2) この変更事項のうち、その内容が重大なものまたは併合（受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。）については、書面決議を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）

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

書面決議

1) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の2週間前までに知っている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

2) 受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。

3) 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

4) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行ないません。

5) 当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。

6) 当ファンドは、受益者からの換金請求に対して、投資信託契約の一部を解約することにより応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、書面決議において反対した受益者からの買取請求は受け付けません。

<書面決議の主な流れ>

**公告**

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

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

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

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

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

- (1) 収益分配金・償還金受領権
 - ・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。
 - ・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から5年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行な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5期計算期間（2022年9月22日から2023年9月21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】

【グローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 2022年 9月21日現在	第5期 2023年 9月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,139,738,515	1,991,707,143
投資信託受益証券	152,323,345,432	162,127,025,854
親投資信託受益証券	163,584,923	163,520,500
流動資産合計	154,626,668,870	164,282,253,497
資産合計	154,626,668,870	164,282,253,497
負債の部		
流動負債		
未払解約金	381,514,918	669,546,454
未払受託者報酬	18,799,936	17,900,275
未払委託者報酬	319,600,009	304,305,652
未払利息	2,910	1,834
その他未払費用	13,999,549	12,690,704
流動負債合計	733,917,322	1,004,444,919
負債合計	733,917,322	1,004,444,919
純資産の部		
元本等		
元本	125,608,307,258	132,105,370,231
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	28,284,444,290	31,172,438,347
（分配準備積立金）	32,621,328,677	28,459,464,889
元本等合計	153,892,751,548	163,277,808,578
純資産合計	153,892,751,548	163,277,808,578
負債純資産合計	154,626,668,870	164,282,253,497

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自 至	2021年 9月22日 2022年 9月21日	自 至	2022年 9月22日 2023年 9月21日
営業収益				
有価証券売買等損益		42,887,131,523		2,363,484,437
営業収益合計		42,887,131,523		2,363,484,437
営業費用				
支払利息		289,474		929,308
受託者報酬		41,185,675		34,406,823
委託者報酬		700,158,591		584,918,087
その他費用		18,476,646		15,995,220
営業費用合計		760,110,386		636,249,438
営業利益又は営業損失（ ）		43,647,241,909		1,727,234,999
経常利益又は経常損失（ ）		43,647,241,909		1,727,234,999
当期純利益又は当期純損失（ ）		43,647,241,909		1,727,234,999
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（ ）		3,114,037,751		233,055,098
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		77,400,125,674		28,284,444,290
剰余金増加額又は欠損金減少額		9,931,096,499		4,886,266,443
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		9,931,096,499		4,886,266,443
剰余金減少額又は欠損金増加額		18,513,573,725		3,958,562,483
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		18,513,573,725		3,958,562,483
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		28,284,444,290		31,172,438,347

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第4期 2022年 9月21日現在	第5期 2023年 9月21日現在
1. 期首元本額	137,280,410,187円	125,608,307,258円
期中追加設定元本額	21,374,040,998円	24,387,803,435円
期中一部解約元本額	33,046,143,927円	17,890,740,462円
2. 受益権の総数	125,608,307,258口	132,105,370,231口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2021年 9月22日 至 2022年 9月21日		第5期 自 2022年 9月22日 至 2023年 9月21日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	0円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整金	13,296,432,088円	C 信託約款に定める収益調整金	19,833,285,422円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	32,621,328,677円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	28,459,464,889円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	45,917,760,765円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)	48,292,750,311円
F 分配対象収益(1万口当たり)	3,655円	F 分配対象収益(1万口当たり)	3,655円
G 分配金額	0円	G 分配金額	0円
H 分配金額(1万口当たり)	0円	H 分配金額(1万口当たり)	0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第4期 自 2021年 9月22日 至 2022年 9月21日	第5期 自 2022年 9月22日 至 2023年 9月21日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第4期 2022年 9月21日現在	第5期 2023年 9月21日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
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4期(2022年9月21日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	41,795,966,056
親投資信託受益証券	16,107
合計	41,795,982,163

第5期(2023年9月21日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	2,363,548,860
親投資信託受益証券	64,423
合計	2,363,484,437

(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4期 2022年9月21日現在		第5期 2023年9月21日現在	
1口当たり純資産額	1.2252円	1口当たり純資産額	1.2360円
(1万口当たり純資産額)	(12,252円)	(1万口当たり純資産額)	(12,360円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	127,208,337,273	162,127,025,854	
投資信託受益証券	合計	127,208,337,273	162,127,025,854	
親投資信託受益証券	マネー・オープン・マザーファンド	161,056,339	163,520,500	
親投資信託受益証券	合計	161,056,339	163,520,500	
	合計	127,369,393,612	162,290,546,354	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

また、当ファンドは、「マネー・オープン・マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

(参考)

グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）

貸借対照表

(単位：円)

	2022年 9月21日現在	2023年 9月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	20,180,690,449	28,822,589,599
親投資信託受益証券	191,520,790,434	196,005,902,301
派生商品評価勘定	-	2,393,885,323
未収入金	6,107,894,268	-
差入委託証拠金	31,360,605,393	22,420,352,401
流動資産合計	249,169,980,544	249,642,729,624
資産合計	249,169,980,544	249,642,729,624
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,311,825,809	3,532,489,412
前受金	359,337,000	561,412,100
未払金	6,719,400	-
未払解約金	1,104,539,099	990,938,631
未払受託者報酬	4,525,898	4,585,883
未払委託者報酬	13,577,727	13,757,683
未払利息	27,451	26,540
その他未払費用	59,919,935	40,126,109
流動負債合計	13,860,472,319	5,143,336,358
負債合計	13,860,472,319	5,143,336,358
純資産の部		
元本等		
元本	187,095,112,660	191,843,730,360
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	48,214,395,565	52,655,662,906
（分配準備積立金）	77,892,586,458	82,185,580,423
元本等合計	235,309,508,225	244,499,393,266
純資産合計	235,309,508,225	244,499,393,266
負債純資産合計	249,169,980,544	249,642,729,624

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 (2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2022年 9月21日現在	2023年 9月21日現在
1. 期首	2021年 9月22日	2022年 9月22日
期首元本額	207,828,189,020円	187,095,112,660円
期首からの追加設定元本額	4,169,792,469円	9,328,932,566円
期首からの一部解約元本額	24,902,868,829円	4,580,314,866円
2. 受益権の総数	187,095,112,660口	191,843,730,360口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2021年 9月22日 至 2022年 9月21日	自 2022年 9月22日 至 2023年 9月21日
--	--------------------------------	--------------------------------

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

金融商品の時価等に関する事項

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

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	5,829,762,978
合計	5,829,762,978

(2023年 9月21日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	5,042,120,194
合計	5,042,120,194

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2022年 9月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	49,365,843,000	-	49,223,760,000	142,083,000
	合計	49,365,843,000	-	49,223,760,000	142,083,000

(2023年 9月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	49,800,947,900	-	50,142,860,000	341,912,100
	合計	49,800,947,900	-	50,142,860,000	341,912,100

(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。

(債券関連)

(2022年 9月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	494,804,372,635	-	482,637,120,776	12,167,251,859
	合計	494,804,372,635	-	482,637,120,776	12,167,251,859

(2023年 9月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	494,034,262,493	-	492,556,032,104	1,478,230,389
	合計	494,034,262,493	-	492,556,032,104	1,478,230,389

(注) 1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
また契約額等及び時価の邦貨換算は、本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2022年 9月21日現在	2023年 9月21日現在
1口当たり純資産額	1.2577円	1.2745円
(1万口当たり純資産額)	(12,577円)	(12,745円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
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	9,509,562,605	49,199,624,049	
	日本リートインデックスJ - REITマザーファンド	18,845,618,130	48,274,935,401	
	海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド	16,560,623,741	49,249,638,943	
	海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし) マザーファンド	20,069,108,938	49,281,703,908	
合計		64,984,913,414	196,005,902,301	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

「グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)」は、「海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI (ヘッジなし) マザーファンド」「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし) マザーファンド」「海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド」「日本リートインデックスJ - REITマザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

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

貸借対照表

(単位:円)

	2022年 9月21日現在	2023年 9月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	785,377,435	1,483,073,228
コール・ローン	2,666,393,573	2,890,184,113
株式	245,881,606,322	305,150,776,278
投資証券	6,127,766,749	6,308,964,812
派生商品評価勘定	43,269,431	87,684,309
未収入金	17,909,430	24,350,925
未収配当金	387,994,139	400,666,095
差入委託証拠金	654,130,888	602,968,536
流動資産合計	256,564,447,967	316,948,668,296
資産合計		
256,564,447,967		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	111,064,256	57,887,155
未払金	-	1,332,127,146
未払解約金	2,238,913,250	139,683,190
未払利息	3,627	2,661
流動負債合計	2,349,981,133	1,529,700,152
負債合計		
2,349,981,133		
純資産の部		
元本等		
元本	59,219,776,408	60,966,207,275
剰余金		
剰余金又は欠損金()	194,994,690,426	254,452,760,869
元本等合計	254,214,466,834	315,418,968,144
純資産合計		
254,214,466,834		
負債純資産合計		
256,564,447,967		
316,948,668,296		

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) 金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。 (2) 金融商品取引所等の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 9月21日現在	2023年 9月21日現在
1.	期首	2021年 9月22日	2022年 9月22日
	期首元本額	63,130,131,603円	59,219,776,408円
	期首からの追加設定元本額	9,236,924,091円	11,402,771,949円
	期首からの一部解約元本額	13,147,279,286円	9,656,341,082円
	元本の内訳		
	インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	28,997,787,689円	32,686,702,605円
	DCインデックスバランス（株式20）	115,662,350円	112,314,771円
	DCインデックスバランス（株式40）	309,959,238円	315,060,926円
	DCインデックスバランス（株式60）	621,597,197円	667,795,996円
	DCインデックスバランス（株式80）	671,195,864円	795,587,222円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	1,451,811,553円	1,278,242,460円
	日興五大陸株式ファンド	3,672,260,311円	3,473,735,342円
	インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）	14,402,554円	12,531,422円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	89,961,945円	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）	5,897,044,747円	5,847,060,347円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	11,171,147,481円	9,509,562,605円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	- 円	7,031,464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	160,043,879円
	Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）	- 円	275,281,577円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	- 円	492,698円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	- 円	136,530円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	3,002,254円	- 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	2,543,483円	- 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	2,733,134円	- 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	2,604,996円	- 円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,851,295,893円	1,370,140,328円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	17,945,851円	15,805,283円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	50,225,952円	45,934,379円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	77,455,664円	73,703,056円

	2022年 9月21日現在	2023年 9月21日現在
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	75,228,743円	74,285,293円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,123,909,509円	4,169,614,642円
計	59,219,776,408円	60,966,207,275円
2. 受益権の総数	59,219,776,408口	60,966,207,275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 9月22日 至 2022年 9月21日	自 2022年 9月22日 至 2023年 9月21日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

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

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	44,920,958,222
投資証券	1,275,323,603
合計	46,196,281,825

（2023年 9月21日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	35,156,380,609

投資証券	19,832,453
合計	35,176,213,062

(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 9月21日現在)

(単位：円)

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

(2023年 9月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,986,988,850	-	3,937,416,310	49,572,540
合計		3,986,988,850	-	3,937,416,310	49,572,540

(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 9月21日現在)

(単位：円)

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

(2023年 9月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,179,726,786	-	3,259,096,480	79,369,694
	米ドル	2,680,099,830	-	2,757,046,960	76,947,130
	ユーロ	499,626,956	-	502,049,520	2,422,564
	合計	3,179,726,786	-	3,259,096,480	79,369,694

(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 9月21日現在		2023年 9月21日現在	
1口当たり純資産額	4.2927円	1口当たり純資産額	5.1737円
(1万口当たり純資産額)	(42,927円)	(1万口当たり純資産額)	(51,737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	41.28	526,320.00	
	BAKER HUGHES CO	40,615	35.80	1,454,017.00	
	CHENIERE ENERGY INC	9,500	161.47	1,533,965.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	3,750	83.81	314,287.50	
	CHEVRON CORP	72,391	166.69	12,066,855.79	
	CONOCOPHILLIPS	48,126	121.17	5,831,427.42	
	COTERRA ENERGY INC	32,460	26.92	873,823.20	
	DEVON ENERGY CORPORATION	25,260	47.88	1,209,448.80	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	6,540	152.89	999,900.60	
	EOG RESOURCES INC	23,472	125.50	2,945,736.00	
	EQT CORP	12,660	40.00	506,400.00	
	EXXON MOBIL CORP	161,521	116.40	18,801,044.40	
	HALLIBURTON CO	37,607	41.29	1,552,793.03	
	HESS CORP	10,870	156.28	1,698,763.60	

HF SINCLAIR CORP	5,940	58.52	347,608.80
KINDER MORGAN INC	81,490	16.86	1,373,921.40
MARATHON OIL CORP	28,380	26.15	742,137.00
MARATHON PETROLEUM CORP	17,692	152.67	2,701,037.64
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	28,351	64.25	1,821,551.75
ONEOK INC	16,840	67.01	1,128,448.40
OVINTIV INC	9,400	46.08	433,152.00
PHILLIPS 66	18,855	120.07	2,263,919.85
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,130	228.77	2,088,670.10
SCHLUMBERGER LTD	56,921	59.79	3,403,306.59
TARGA RESOURCES CORP	8,180	85.43	698,817.40
TEXAS PACIFIC LAND CORP	245	1,869.23	457,961.35
VALERO ENERGY CORP	14,682	142.97	2,099,085.54
WILLIAMS COS INC	47,324	34.29	1,622,739.96
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,115	294.82	2,687,284.30
ALBEMARLE CORP	4,750	174.44	828,590.00
AMCOR PLC	65,600	9.26	607,456.00
AVERY DENNISON CORP	3,040	183.67	558,356.80
BALL CORP	12,500	51.96	649,500.00
CELANESE CORP	4,090	127.99	523,479.10
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,820	83.65	654,143.00
CLEVELAND-CLIFFS INC	21,150	14.43	305,194.50
CORTEVA INC	28,172	51.77	1,458,464.44
CROWN HOLDINGS INC	4,565	90.37	412,539.05
DOW INC	28,025	52.46	1,470,191.50
DUPONT DE NEMOURS INC	19,162	74.00	1,417,988.00
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,815	78.42	377,592.30
ECOLAB INC	10,200	177.53	1,810,806.00
FMC CORP	4,840	70.98	343,543.20
FREEPORT-MCMORAN INC	56,338	38.69	2,179,717.22
INTERNATIONAL PAPER CO	13,670	33.72	460,952.40
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,675	70.00	747,250.00
LINDE PLC	19,590	378.82	7,421,083.80
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,570	97.03	1,025,607.10
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,720	420.91	1,144,875.20
MOSAIC CO/THE	13,580	37.05	503,139.00
NEWMONT CORP	31,872	40.95	1,305,158.40
NUCOR CORP	9,959	155.39	1,547,529.01
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	150.12	537,429.60
PPG INDUSTRIES INC	9,394	130.80	1,228,735.20
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	2,210	265.33	586,379.30
RPM INTERNATIONAL INC	4,960	94.88	470,604.80
SEALED AIR CORP	5,746	33.14	190,422.44

SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,626	259.81	2,500,931.06
STEEL DYNAMICS INC	6,010	100.25	602,502.50
VULCAN MATERIALS CO	5,563	209.55	1,165,726.65
WESTLAKE CORP	1,360	124.18	168,884.80
WESTROCK CO	9,989	35.53	354,909.17
3M CO	21,546	98.99	2,132,838.54
AECOM	4,930	83.57	412,000.10
AERCAP HOLDINGS NV	6,970	63.07	439,597.90
ALLEGION PLC	3,340	104.25	348,195.00
AMETEK INC	9,033	151.41	1,367,686.53
AXON ENTERPRISE INC	2,540	203.35	516,509.00
BOEING CO/THE	22,962	202.37	4,646,819.94
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	5,240	127.16	666,318.40
CARLISLE COS INC	2,250	266.22	598,995.00
CARRIER GLOBAL CORP	33,088	53.83	1,781,127.04
CATERPILLAR INC	20,576	278.61	5,732,679.36
CUMMINS INC	5,535	232.80	1,288,548.00
DEERE & CO	11,095	402.33	4,463,851.35
DOVER CORP	5,350	143.50	767,725.00
EATON CORP PLC	15,996	214.65	3,433,541.40
EMERSON ELECTRIC CO	22,490	98.01	2,204,244.90
FASTENAL CO	22,796	54.28	1,237,366.88
FERGUSON PLC	8,440	152.37	1,286,002.80
FORTIVE CORP	14,854	75.05	1,114,792.70
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	5,050	64.19	324,159.50
GENERAC HOLDINGS INC	2,440	110.22	268,936.80
GENERAL DYNAMICS CORP	9,397	225.55	2,119,493.35
GENERAL ELECTRIC CO	43,327	114.85	4,976,105.95
GRACO INC	6,310	74.75	471,672.50
HEICO CORP	1,800	165.74	298,332.00
HEICO CORP-CLASS A	3,120	132.19	412,432.80
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	26,766	194.44	5,204,381.04
HOWMET AEROSPACE INC	17,943	46.54	835,067.22
HUBBELL INC	2,320	310.49	720,336.80
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,530	205.58	314,537.40
IDEX CORP	2,880	209.94	604,627.20
ILLINOIS TOOL WORKS	12,175	236.20	2,875,735.00
INGERSOLL-RAND INC	16,398	65.02	1,066,197.96
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,570	46.67	306,621.90
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	27,484	56.51	1,553,120.84
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,750	174.65	1,353,537.50
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,385	373.53	517,339.05
LOCKHEED MARTIN CORP	9,156	426.95	3,909,154.20

MASCO CORP	9,849	54.57	537,459.93
NORDSON CORP	2,345	227.78	534,144.10
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,784	440.18	2,546,001.12
OTIS WORLDWIDE CORP	17,124	81.70	1,399,030.80
OWENS CORNING	3,550	135.88	482,374.00
PACCAR INC	20,706	85.25	1,765,186.50
PARKER HANNIFIN CORP	5,265	390.46	2,055,771.90
PENTAIR PLC	6,918	66.12	457,418.16
QUANTA SERVICES INC	5,710	195.25	1,114,877.50
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,618	285.17	1,316,915.06
RTX CORP	58,756	74.43	4,373,209.08
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,420	37.24	239,080.80
SMITH (A.O.) CORP	5,020	66.35	333,077.00
SNAP-ON INC	1,975	255.73	505,066.75
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,806	86.11	499,954.66
TEXTRON INC	7,956	79.37	631,467.72
TORO CO	3,890	79.85	310,616.50
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,066	201.24	1,824,441.84
TRANSDIGM GROUP INC	2,180	854.35	1,862,483.00
UNITED RENTALS INC	2,805	448.03	1,256,724.15
WABTEC CORP	7,130	107.14	763,908.20
WATSCO INC	1,240	356.57	442,146.80
WW GRAINGER INC	1,847	684.99	1,265,176.53
XYLEM INC	9,468	93.57	885,920.76
AUTOMATIC DATA PROCESSING	16,521	243.86	4,028,893.66
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,070	111.58	565,710.60
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,400	184.49	811,756.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,280	68.28	360,518.40
CINTAS CORP	3,592	514.53	1,848,191.76
CLARIVATE PLC	14,250	7.33	104,452.50
COPART INC	35,140	44.02	1,546,862.80
EQUIFAX INC	5,024	194.35	976,414.40
JACOBS SOLUTIONS INC	4,880	133.17	649,869.60
LEIDOS HOLDINGS INC	4,960	93.85	465,496.00
PAYCHEX INC	13,072	115.65	1,511,776.80
PAYCOM SOFTWARE INC	1,945	268.48	522,193.60
PAYLOCITY HOLDING CORP	1,730	185.20	320,396.00
REPUBLIC SERVICES INC	8,920	149.30	1,331,756.00
ROBERT HALF INC	4,415	74.33	328,166.95
ROLLINS INC	8,265	38.68	319,690.20
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	54.72	463,478.40
TRANSUNION	7,940	76.70	608,998.00
VERISK ANALYTICS INC	5,810	246.33	1,431,177.30

WASTE CONNECTIONS INC	10,606	141.73	1,503,188.38
WASTE MANAGEMENT INC	16,514	160.05	2,643,065.70
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,930	87.58	431,769.40
CSX CORP	81,669	31.31	2,557,056.39
DELTA AIR LINES INC	5,705	38.88	221,810.40
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,467	114.84	742,670.28
FEDEX CORP	9,448	250.52	2,366,912.96
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	77,000	3.46	266,420.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,140	193.68	608,155.20
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,140	52.78	324,069.20
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,915	205.29	1,830,160.35
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,955	407.88	1,613,165.40
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	28.52	156,004.40
U-HAUL HOLDING CO	3,375	54.85	185,118.75
UBER TECHNOLOGIES INC	72,550	46.55	3,377,202.50
UNION PACIFIC CORP	24,426	212.98	5,202,249.48
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	29,147	157.64	4,594,733.08
APTIV PLC	11,080	101.85	1,128,498.00
BORGWARNER INC	9,120	41.18	375,561.60
FORD MOTOR COMPANY	159,205	12.36	1,967,773.80
GENERAL MOTORS CORP	52,765	33.20	1,751,798.00
LEAR CORP	2,290	135.84	311,073.60
LUCID GROUP INC	36,360	5.45	198,162.00
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	27,210	22.40	609,504.00
TESLA INC	114,285	262.59	30,010,098.15
DECKERS OUTDOOR CORP	990	523.68	518,443.20
DR HORTON INC	12,896	113.20	1,459,827.20
GARMIN LTD	5,865	106.78	626,264.70
HASBRO INC	5,188	66.66	345,832.08
LENNAR CORP-CL A	10,040	116.53	1,169,961.20
LULULEMON ATHLETICA INC	4,710	391.88	1,845,754.80
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,878	91.54	171,912.12
NIKE INC -CL B	49,228	94.04	4,629,401.12
NVR INC	148	6,132.13	907,555.24
PULTE GROUP INC	8,850	76.45	676,582.50
VF CORP	12,170	17.87	217,477.90
WHIRLPOOL CORP	2,079	136.35	283,471.65
AIRBNB INC-CLASS A	16,340	138.01	2,255,083.40
ARAMARK	8,880	37.84	336,019.20
BOOKING HOLDINGS INC	1,498	3,068.91	4,597,227.18
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,970	50.17	399,854.90
CARNIVAL CORP	38,787	14.65	568,229.55
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,065	1,920.48	2,045,311.20

DARDEN RESTAURANTS INC	4,853	149.46	725,329.38
DOMINO'S PIZZA INC	1,375	384.84	529,155.00
DOORDASH INC - A	10,020	78.95	791,079.00
DRAFTKINGS INC-CL A	15,800	30.08	475,264.00
EXPEDIA GROUP INC	6,032	104.29	629,077.28
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,650	152.74	1,626,681.00
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,680	105.86	177,844.80
LAS VEGAS SANDS CORP	14,390	47.91	689,424.90
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,673	199.86	2,133,105.78
MCDONALD'S CORP	29,251	277.20	8,108,377.20
MGM RESORTS INTERNATIONAL	12,900	38.77	500,133.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,358	96.21	900,333.18
STARBUCKS CORP	46,124	95.16	4,389,159.84
VAIL RESORTS INC	1,520	252.48	383,769.60
WYNN RESORTS LTD	4,180	93.69	391,624.20
YUM! BRANDS INC	11,394	127.05	1,447,607.70
ACTIVISION BLIZZARD INC	31,260	92.56	2,893,425.60
ALPHABET INC-CL A	238,020	133.74	31,832,794.80
ALPHABET INC-CL C	211,550	134.59	28,472,514.50
CHARTER COMMUNICATION-A	3,926	448.17	1,759,515.42
COMCAST CORP-CLASS A	166,584	45.50	7,579,572.00
ELECTRONIC ARTS INC	10,834	120.45	1,304,955.30
FOX CORP - CLASS A	13,084	31.15	407,566.60
FOX CORP- CLASS B	5,466	28.73	157,038.18
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,096	29.82	450,162.72
LIBERTY BROADBAND-C	4,850	93.09	451,486.50
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	7,780	66.11	514,335.80
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW C	5,726	22.97	131,526.22
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,420	81.50	523,230.00
MATCH GROUP INC	10,912	41.58	453,720.96
META PLATFORMS INC-CLASS A	88,560	299.67	26,538,775.20
NETFLIX INC	17,800	386.30	6,876,140.00
NEWS CORP - CLASS A	14,750	19.67	290,132.50
OMNICOM GROUP	7,477	74.85	559,653.45
PARAMOUNT GLOBAL	22,823	13.24	302,176.52
PINTEREST INC- CLASS A	22,100	27.02	597,142.00
ROBLOX CORP -CLASS A	19,130	26.25	502,162.50
ROKU INC	4,700	71.49	336,003.00
SEA LTD-ADR	14,470	37.53	543,059.10
SIRIUS XM HOLDINGS INC	30,280	4.12	124,753.60
SNAP INC - A	45,300	9.03	409,059.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,240	140.72	1,018,812.80
THE WALT DISNEY CO.	73,422	82.56	6,061,720.32

TRADE DESK INC/THE -CLASS A	17,500	78.29	1,370,075.00
WARNER BROS DISCOVERY INC	94,890	11.50	1,091,235.00
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	9,840	15.96	157,046.40
AMAZON.COM INC	369,750	135.29	50,023,477.50
AUTOZONE INC	722	2,583.36	1,865,185.92
BATH & BODY WORKS INC	9,270	34.99	324,357.30
BEST BUY CO INC	7,814	70.75	552,840.50
BURLINGTON STORES INC	2,585	142.71	368,905.35
CARMAX INC	5,949	81.42	484,367.58
CHEWY INC - CLASS A	4,860	18.41	89,472.60
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,270	111.88	253,967.60
EBAY INC	21,897	43.69	956,679.93
ETSY INC	4,800	64.69	310,512.00
GENUINE PARTS CO	5,751	149.26	858,394.26
GLOBAL-E ONLINE LTD	3,050	37.72	115,046.00
HOME DEPOT INC	40,105	310.86	12,467,040.30
LKQ CORP	10,260	50.38	516,898.80
LOWE'S COS INC	23,492	214.91	5,048,665.72
MERCADOLIBRE INC	1,790	1,326.34	2,374,148.60
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,420	945.83	2,288,908.60
POOL CORP	1,540	347.62	535,334.80
ROSS STORES INC	13,762	114.95	1,581,941.90
TJX COMPANIES INC	45,856	90.66	4,157,304.96
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,530	207.55	940,201.50
ULTA BEAUTY INC	2,100	411.31	863,751.00
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	10,260	23.38	239,878.80
COSTCO WHOLESALE CORP	17,664	563.83	9,959,493.12
DOLLAR GENERAL CORP	8,725	115.66	1,009,133.50
DOLLAR TREE INC	8,986	111.30	1,000,141.80
KROGER CO	26,880	46.18	1,241,318.40
SYSCO CORP	19,996	70.59	1,411,517.64
TARGET CORP	17,980	120.41	2,164,971.80
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	30,782	21.84	672,278.88
WALMART INC	59,162	163.91	9,697,243.42
ALTRIA GROUP INC	71,048	43.04	3,057,905.92
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,143	79.38	1,757,711.34
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,770	63.15	806,425.50
BUNGE LTD	5,847	112.59	658,313.73
CAMPBELL SOUP CO	7,885	42.68	336,531.80
COCA-COLA CO/THE	164,852	58.44	9,633,950.88
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	7,710	64.13	494,442.30
CONAGRA BRANDS INC	20,640	28.92	596,908.80
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,560	261.90	1,718,064.00

DARLING INGREDIENTS INC	5,880	55.43	325,928.40
GENERAL MILLS INC	23,059	65.87	1,518,896.33
HERSHEY CO/THE	5,945	211.33	1,256,356.85
HORMEL FOODS CORP	11,500	38.79	446,085.00
JM SMUCKER CO/THE	4,100	128.26	525,866.00
KELLOGG CO	11,098	60.75	674,203.50
KEURIG DR PEPPER INC	39,700	33.77	1,340,669.00
KRAFT HEINZ CO/THE	32,911	34.02	1,119,632.22
LAMB WESTON HOLDING INC	6,150	98.13	603,499.50
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,420	78.56	818,595.20
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,570	64.77	490,308.90
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	54,225	71.64	3,884,679.00
MONSTER BEVERAGE CORP	31,880	55.76	1,777,628.80
PEPSICO INC	55,211	178.38	9,848,538.18
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	62,368	97.71	6,093,977.28
TYSON FOODS INC-CL A	10,906	53.32	581,507.92
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,310	95.11	980,584.10
CLOROX COMPANY	5,266	136.46	718,598.36
COLGATE-PALMOLIVE CO	30,440	73.76	2,245,254.40
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,200	150.84	1,387,728.00
KENVUE INC	60,000	20.89	1,253,400.00
KIMBERLY-CLARK CORP	13,663	124.93	1,706,918.59
PROCTER & GAMBLE CO	94,409	153.47	14,488,949.23
ABBOTT LABORATORIES	69,536	100.28	6,973,070.08
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,060	309.50	947,070.00
BAXTER INTERNATIONAL INC	19,439	38.47	747,818.33
BECTON DICKINSON AND CO	11,387	267.13	3,041,809.31
BOSTON SCIENTIFIC CORP	57,708	54.10	3,122,002.80
CARDINAL HEALTH INC	10,305	89.37	920,957.85
CENCORA INC	7,014	182.78	1,282,018.92
CENTENE CORP	22,367	68.08	1,522,745.36
CIGNA GROUP/THE	11,760	287.33	3,379,000.80
COOPER COS INC/THE	2,025	336.62	681,655.50
CVS HEALTH CORP	51,648	71.41	3,688,183.68
DAVITA INC	2,108	103.33	217,819.64
DENTSPLY SIRONA INC	8,222	35.19	289,332.18
DEXCOM INC	15,500	92.63	1,435,765.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	24,120	71.95	1,735,434.00
ELEVANCE HEALTH INC	9,436	445.83	4,206,851.88
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	16,705	65.01	1,085,992.05
HCA HEALTHCARE INC	8,190	254.21	2,081,979.90
HENRY SCHEIN INC	5,280	74.47	393,201.60
HOLOGIC INC	9,858	71.45	704,354.10

HUMANA INC	5,055	484.77	2,450,512.35
IDEXX LABORATORIES INC	3,360	455.35	1,529,976.00
INSULET CORP	2,745	164.74	452,211.30
INTUITIVE SURGICAL INC	14,035	291.96	4,097,658.60
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,415	205.20	700,758.00
MCKESSON CORP	5,439	439.86	2,392,398.54
MEDTRONIC PLC	53,528	81.48	4,361,461.44
MOLINA HEALTHCARE INC	2,655	333.51	885,469.05
QUEST DIAGNOSTICS	4,386	125.01	548,293.86
RESMED INC	5,830	141.12	822,729.60
STERIS PLC	4,240	225.27	955,144.80
STRYKER CORP	13,693	288.97	3,956,866.21
TELEFLEX INC	1,820	208.74	379,906.80
UNITEDHEALTH GROUP INC	37,185	492.13	18,299,854.05
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,920	129.05	247,776.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	5,790	209.49	1,212,947.10
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,412	120.31	1,012,047.72
ABBVIE INC	70,306	153.61	10,799,704.66
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,750	112.47	1,433,992.50
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,040	175.52	884,620.80
AMGEN INC	21,231	271.46	5,763,367.26
AVANTOR INC	27,110	22.04	597,504.40
BIO-RAD LABORATORIES-A	950	364.42	346,199.00
BIO-TECHNE CORP	6,730	70.87	476,955.10
BIOGEN INC	5,643	260.53	1,470,170.79
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,380	88.38	740,624.40
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	83,555	58.78	4,911,362.90
CATALENT INC	6,520	48.25	314,590.00
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,910	208.63	398,483.30
DANAHER CORP	28,029	254.46	7,132,259.34
ELI LILLY & CO	32,269	569.64	18,381,713.16
EXACT SCIENCES CORP	7,370	72.95	537,641.50
GILEAD SCIENCES INC	49,954	75.82	3,787,512.28
HORIZON THERAPEUTICS PLC	8,780	115.60	1,014,968.00
ILLUMINA INC	6,275	138.35	868,146.25
INCYTE CORP	7,670	60.37	463,037.90
IQVIA HOLDINGS INC	7,438	205.42	1,527,913.96
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,450	133.73	327,638.50
JOHNSON & JOHNSON	96,501	162.91	15,720,977.91
MERCK & CO. INC.	101,193	107.31	10,859,020.83
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	890	1,131.11	1,006,687.90
MODERNA INC	12,875	103.53	1,332,948.75
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,630	114.38	415,199.40

PFIZER INC	226,080	33.62	7,600,809.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,310	831.62	3,584,282.20
REPLIGEN CORP	2,250	168.58	379,305.00
REVVITY INC	4,910	110.41	542,113.10
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	14,330	27.45	393,358.50
SEAGEN INC	5,620	206.99	1,163,283.80
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43,590	10.70	466,413.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	15,414	504.89	7,782,374.46
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,900	223.93	425,467.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10,330	352.31	3,639,362.30
VIATRIS INC	45,819	9.88	452,691.72
WATERS CORP	2,331	274.11	638,950.41
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,960	384.34	1,137,646.40
ZOETIS INC	18,525	181.48	3,361,917.00
BANK OF AMERICA CORP	287,899	28.55	8,219,516.45
CITIGROUP INC	78,467	42.30	3,319,154.10
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,310	27.52	531,411.20
FIFTH THIRD BANCORP	26,459	26.81	709,365.79
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	450	1,377.39	619,825.50
FIRST HORIZON CORP	19,800	11.23	222,354.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,720	10.50	564,060.00
JPMORGAN CHASE & CO	116,880	148.30	17,333,304.00
KEYCORP	36,108	11.04	398,632.32
M & T BANK CORP	6,913	126.62	875,324.06
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	16,200	123.95	2,007,990.00
REGIONS FINANCIAL CORP	35,844	17.81	638,381.64
TRUIST FINANCIAL CORP	53,220	28.37	1,509,851.40
US BANCORP	59,781	34.41	2,057,064.21
WEBSTER FINANCIAL CORP	6,370	40.58	258,494.60
WELLS FARGO & CO	148,260	42.87	6,355,906.20
ALLY FINANCIAL INC	12,240	27.61	337,946.40
AMERICAN EXPRESS CO	25,314	157.23	3,980,120.22
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,225	344.99	1,457,582.75
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,800	92.02	1,453,916.00
ARES MANAGEMENT CORP-A	7,150	106.26	759,759.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	30,612	43.70	1,337,744.40
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	51,825	366.82	19,010,446.50
BLACKROCK INC	6,025	683.48	4,117,967.00
BLACKSTONE INC	28,460	114.22	3,250,701.20
BLOCK INC	21,450	47.57	1,020,376.50
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15,435	100.56	1,552,143.60
CARLYLE GROUP INC/THE	7,650	31.97	244,570.50
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,940	155.13	611,212.20

CME GROUP INC	14,510	205.91	2,987,754.10
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	6,900	76.67	529,023.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,750	88.66	953,095.00
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,420	29.06	419,045.20
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,590	423.77	673,794.30
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	24,198	58.14	1,406,871.72
FISERV INC	24,884	119.69	2,978,365.96
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,880	275.18	792,518.40
FRANKLIN RESOURCES INC	11,755	25.91	304,572.05
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	59.48	148,700.00
GLOBAL PAYMENTS INC	10,989	122.69	1,348,240.41
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,378	336.70	4,504,372.60
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	22,740	115.35	2,623,059.00
INVESCO LTD	13,527	15.05	203,581.35
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,200	152.88	489,216.00
KKR & CO INC -A	24,780	63.63	1,576,751.40
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,185	246.68	785,675.80
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,545	223.27	344,952.15
MASTERCARD INC - A	33,865	410.52	13,902,259.80
MOODY'S CORP	6,502	335.85	2,183,696.70
MORGAN STANLEY	50,403	87.14	4,392,117.42
MSCI INC	3,175	535.04	1,698,752.00
NASDAQ INC	11,725	50.57	592,933.25
NORTHERN TRUST CORP	7,690	69.87	537,300.30
PAYPAL HOLDINGS INC	42,267	60.86	2,572,369.62
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,470	106.51	902,139.70
ROBINHOOD MARKETS INC - A	17,810	10.22	182,018.20
S&P GLOBAL INC	13,185	386.24	5,092,574.40
SCHWAB (CHARLES) CORP	60,543	56.67	3,430,971.81
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,375	61.27	268,056.25
STATE STREET CORP	12,947	69.69	902,276.43
SYNCHRONY FINANCIAL	19,010	32.16	611,361.60
T ROWE PRICE GROUP INC	8,675	108.68	942,799.00
TOAST INC-CLASS A	12,760	19.12	243,971.20
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,200	84.22	353,724.00
VISA INC-CLASS A SHARES	64,762	241.86	15,663,337.32
AFLAC INC	23,424	77.15	1,807,161.60
ALLSTATE CORP	10,513	114.15	1,200,058.95
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,660	114.41	304,330.60
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	30,345	62.32	1,891,100.40
AON PLC	8,077	342.02	2,762,495.54
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,535	81.32	1,181,986.20
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,610	235.19	2,024,985.90

ASSURANT INC	1,960	141.70	277,732.00
BROWN & BROWN INC	9,090	73.84	671,205.60
CHUBB LTD	16,685	213.76	3,566,585.60
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,880	109.52	643,977.60
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	940	292.61	275,053.40
EVEREST GROUP LTD	1,469	391.99	575,833.31
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	11,071	42.21	467,306.91
GLOBE LIFE INC	3,586	110.89	397,651.54
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,382	73.95	915,648.90
LOEWS CORP	7,145	64.97	464,210.65
MARKEL GROUP INC	530	1,542.14	817,334.20
MARSH & MCLENNAN COS	19,918	197.47	3,933,207.46
METLIFE INC	26,335	66.09	1,740,480.15
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,520	77.03	733,325.60
PROGRESSIVE CORP	23,340	142.69	3,330,384.60
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,962	98.93	1,480,190.66
TRAVELERS COS INC/THE	8,889	168.94	1,501,707.66
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,198	214.78	901,646.44
WR BERKLEY CORP	8,091	65.65	531,174.15
ACCENTURE PLC-CL A	25,308	316.80	8,017,574.40
ADOBE INC	18,194	535.78	9,747,981.32
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,030	108.49	654,194.70
ANSYS INC	3,515	310.21	1,090,388.15
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,300	205.46	267,098.00
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	6,020	200.82	1,208,936.40
AUTODESK INC	8,720	207.73	1,811,405.60
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,530	48.94	368,518.20
BILL HOLDINGS INC	3,910	103.67	405,349.70
CADENCE DESIGN SYS INC	10,570	234.20	2,475,494.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,840	137.46	527,846.40
CLOUDFLARE INC-CLASS A	10,740	60.01	644,507.40
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	20,318	69.51	1,412,304.18
CONFLUENT INC-CLASS A	6,870	30.95	212,626.50
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	8,990	163.89	1,473,371.10
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,650	172.94	285,351.00
DATADOG INC-CLASS A	9,910	92.05	912,215.50
DOCUSIGN INC	8,320	43.42	361,254.40
DROPBOX INC-CLASS A	11,660	26.68	311,088.80
DYNATRACE INC	9,850	46.25	455,562.50
EPAM SYSTEMS INC	2,280	267.00	608,760.00
FAIR ISAAC CORP	970	903.87	876,753.90
FORTINET INC	26,965	60.15	1,621,944.75
GARTNER INC	3,050	357.22	1,089,521.00

GEN DIGITAL INC	24,365	19.15	466,589.75
GODADDY INC-CLASS A	6,020	74.49	448,429.80
HUBSPOT INC	1,885	505.02	951,962.70
INTL BUSINESS MACHINES CORP	36,342	149.83	5,445,121.86
INTUIT INC	11,241	523.59	5,885,675.19
MANHATTAN ASSOCIATES INC	2,350	202.73	476,415.50
MICROSOFT CORP	282,814	320.77	90,718,246.78
MONDAY.COM LTD	980	158.44	155,271.20
MONGODB INC	2,820	351.66	991,681.20
OKTA INC	6,340	83.53	529,580.20
ORACLE CORP	65,133	112.87	7,351,561.71
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	72,800	14.74	1,073,072.00
PALO ALTO NETWORKS INC	12,205	235.30	2,871,836.50
PTC INC	4,160	142.89	594,422.40
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,200	504.15	2,117,430.00
SALESFORCE INC	39,026	213.03	8,313,708.78
SERVICENOW INC	8,125	570.55	4,635,718.75
SNOWFLAKE INC-CLASS A	10,490	158.63	1,664,028.70
SPLUNK INC	6,120	119.59	731,890.80
SYNOPSYS INC	6,082	453.28	2,756,848.96
TWILIO INC - A	7,225	60.23	435,161.75
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,830	392.53	718,329.90
UIPATH INC - CLASS A	17,970	16.80	301,896.00
UNITY SOFTWARE INC	9,650	33.32	321,538.00
VERISIGN INC	3,690	200.75	740,767.50
VMWARE INC-CLASS A	9,517	165.71	1,577,062.07
WIX.COM LTD	2,280	94.05	214,434.00
WORKDAY INC-CLASS A	7,990	237.80	1,900,022.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	9,630	68.80	662,544.00
ZSCALER INC	3,630	154.23	559,854.90
AMPHENOL CORP-CL A	23,350	84.81	1,980,313.50
APPLE INC	629,794	175.49	110,522,549.06
ARISTA NETWORKS INC	10,420	182.75	1,904,255.00
ARROW ELECTRONICS INC	2,520	127.90	322,308.00
CDW CORP/DE	5,895	209.00	1,232,055.00
CISCO SYSTEMS INC	162,490	55.50	9,018,195.00
COGNEX CORP	6,480	43.21	280,000.80
CORNING INC	33,518	31.62	1,059,839.16
DELL TECHNOLOGIES -C	11,022	68.94	759,856.68
F5 INC	2,385	160.72	383,317.20
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	50,105	17.10	856,795.50
HP INC	34,495	27.06	933,434.70
JABIL INC	4,990	107.33	535,576.70

JUNIPER NETWORKS INC	13,453	28.22	379,643.66
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,160	132.54	948,986.40
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,610	285.74	1,888,741.40
NETAPP INC	8,246	76.08	627,355.68
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,794	65.63	511,520.22
SUPER MICRO COMPUTER INC	1,790	243.07	435,095.30
TE CONNECTIVITY LTD	12,995	125.44	1,630,092.80
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,020	419.14	846,662.80
TRIMBLE INC	9,520	52.27	497,610.40
WESTERN DIGITAL CORP	11,688	45.65	533,557.20
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,075	235.83	489,347.25
AT&T INC	287,257	15.55	4,466,846.35
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	10,361	19.88	205,976.68
T-MOBILE US INC	21,939	142.07	3,116,873.73
VERIZON COMMUNICATIONS INC	168,177	33.60	5,650,747.20
AES CORP	27,958	16.79	469,414.82
ALLIANT ENERGY CORP	12,150	51.99	631,678.50
AMEREN CORPORATION	10,152	80.44	816,626.88
AMERICAN ELECTRIC POWER	20,348	80.45	1,636,996.60
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,705	137.20	1,057,126.00
ATMOS ENERGY CORP	5,310	114.16	606,189.60
CENTERPOINT ENERGY INC	23,972	28.82	690,873.04
CMS ENERGY CORP	11,090	56.84	630,355.60
CONSOLIDATED EDISON INC	14,236	91.50	1,302,594.00
CONSTELLATION ENERGY	13,168	110.13	1,450,191.84
DOMINION ENERGY INC	33,331	47.97	1,598,888.07
DTE ENERGY COMPANY	8,318	106.68	887,364.24
DUKE ENERGY CORP	30,796	94.37	2,906,218.52
EDISON INTERNATIONAL	16,329	69.75	1,138,947.75
ENTERGY CORP	7,967	98.21	782,439.07
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,210	37.02	414,994.20
EVERGY INC	8,720	54.35	473,932.00
EVERSOURCE ENERGY	14,310	63.96	915,267.60
EXELON CORP	39,706	40.83	1,621,195.98
FIRSTENERGY CORP	23,295	36.56	851,665.20
NEXTERA ENERGY INC	80,990	67.35	5,454,676.50
NISOURCE INC	15,610	27.59	430,679.90
NRG ENERGY INC	8,760	38.89	340,676.40
P G & E CORP	73,270	17.40	1,274,898.00
PPL CORP	30,338	25.67	778,776.46
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	19,888	60.70	1,207,201.60
SEMPRA	24,864	73.33	1,823,277.12
SOUTHERN CO	43,485	71.20	3,096,132.00

	VISTRA CORP	14,720	32.34	476,044.80	
	WEC ENERGY GROUP INC	12,220	87.16	1,065,095.20	
	XCEL ENERGY INC	22,174	59.96	1,329,553.04	
	ADVANCED MICRO DEVICES	64,304	100.34	6,452,263.36	
	ANALOG DEVICES INC	20,097	176.08	3,538,679.76	
	APPLIED MATERIALS INC	33,733	136.97	4,620,409.01	
	BROADCOM INC	16,530	830.57	13,729,322.10	
	ENPHASE ENERGY INC	5,440	123.97	674,396.80	
	ENTEGRIS INC	5,660	90.72	513,475.20	
	FIRST SOLAR INC	4,260	169.24	720,962.40	
	INTEL CORP	167,432	34.69	5,808,216.08	
	KLA CORP	5,489	452.18	2,482,016.02	
	LAM RESEARCH CORP	5,402	618.86	3,343,081.72	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	5,150	84.61	435,741.50	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	33,614	52.94	1,779,525.16	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,028	76.72	1,689,988.16	
	MICRON TECHNOLOGY INC	44,157	69.68	3,076,859.76	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,820	452.86	824,205.20	
	NVIDIA CORP	98,880	422.39	41,765,923.20	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	10,447	194.96	2,036,747.12	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	17,340	92.84	1,609,845.60	
	QORVO INC	4,240	95.21	403,690.40	
	QUALCOMM INC	44,802	109.22	4,893,274.44	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,440	96.33	620,365.20	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	2,310	139.20	321,552.00	
	TERADYNE INC	6,190	95.99	594,178.10	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	36,472	162.10	5,912,111.20	
	WOLFSPEED INC	5,080	39.54	200,863.20	
	CBRE GROUP INC - A	12,560	78.09	980,810.40	
	COSTAR GROUP INC	16,800	81.13	1,362,984.00	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,500	3.50	141,750.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	6,370	47.78	304,358.60	
	米ドル小計	13,682,127		1,527,077,317.63 (226,664,086,255)	
加ドル	ARC RESOURCES LTD	25,510	20.82	531,118.20	
	CAMECO CORP	16,352	53.21	870,089.92	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	44,054	84.60	3,726,968.40	
	CENOVUS ENERGY INC	57,213	27.14	1,552,760.82	
	ENBRIDGE INC	81,027	47.11	3,817,181.97	
	IMPERIAL OIL LTD	8,922	78.26	698,235.72	
	KEYERA CORP	8,460	32.66	276,303.60	
	PARKLAND CORP	6,170	39.23	242,049.10	
	PEMBINA PIPELINE CORP	23,552	41.31	972,933.12	

SUNCOR ENERGY INC	53,489	46.45	2,484,564.05
TC ENERGY CORP	41,663	50.13	2,088,566.19
TOURMALINE OIL CORP	12,040	68.08	819,683.20
AGNICO EAGLE MINES LTD	21,496	67.68	1,454,849.28
BARRICK GOLD CORP	69,624	22.13	1,540,779.12
CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	57.09	328,267.50
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	33.70	763,305.00
FRANCO-NEVADA CORP	8,125	193.55	1,572,593.75
IVANHOE MINES LTD-CL A	24,510	11.93	292,404.30
KINROSS GOLD CORP	46,025	7.05	324,476.25
LUNDIN MINING CORP	25,010	9.93	248,349.30
NUTRIEN LTD	20,908	84.80	1,772,998.40
PAN AMERICAN SILVER CORP	12,860	21.78	280,090.80
TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,975	56.58	1,017,025.50
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,450	98.13	240,418.50
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,165	60.13	1,152,391.45
CAE INC	12,305	32.81	403,727.05
STANTEC INC	4,100	89.54	367,114.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,260	111.55	363,653.00
WSP GLOBAL INC	4,590	192.24	882,381.60
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,410	44.95	333,079.50
RB GLOBAL INC	7,560	86.90	656,964.00
THOMSON REUTERS CORP	6,310	172.85	1,090,683.50
AIR CANADA	7,190	19.64	141,211.60
CANADIAN NATL RAILWAY CO	22,438	152.58	3,423,590.04
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	37,551	105.63	3,966,512.13
TFI INTERNATIONAL INC	3,210	176.74	567,335.40
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,668	74.59	795,726.12
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,570	102.69	161,223.30
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,040	37.65	265,056.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,998	92.95	1,022,264.10
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,250	150.78	339,255.00
DOLLARAMA INC	12,990	95.63	1,242,233.70
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	30,860	71.39	2,203,095.40
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	36.98	257,011.00
LOBLAW COMPANIES LTD	6,339	113.68	720,617.52
METRO INC	9,570	72.37	692,580.90
WESTON (GEORGE) LTD	2,808	153.95	432,291.60
SAPUTO INC	9,620	28.66	275,709.20
BANK OF MONTREAL	27,631	118.33	3,269,576.23
BANK OF NOVA SCOTIA	47,539	64.52	3,067,216.28
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	37,740	55.15	2,081,361.00
NATIONAL BANK OF CANADA	13,750	94.71	1,302,262.50

	ROYAL BANK OF CANADA	54,929	122.77	6,743,633.33	
	TORONTO-DOMINION BANK	73,180	83.03	6,076,135.40	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	13,859	47.74	661,628.66	
	BROOKFIELD CORP	57,209	47.09	2,693,971.81	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	13,800	19.85	273,930.00	
	IGM FINANCIAL INC	3,335	37.75	125,896.25	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,250	21.12	47,520.00	
	ONEX CORPORATION	2,765	81.46	225,236.90	
	TMX GROUP LTD	10,850	29.61	321,268.50	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	1,151.50	1,036,350.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	11,324	41.19	466,435.56	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,075	88.55	360,841.25	
	INTACT FINANCIAL CORP	7,215	200.70	1,448,050.50	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	71,921	26.16	1,881,453.36	
	POWER CORP OF CANADA	20,479	37.88	775,744.52	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	24,774	67.88	1,681,659.12	
	CGI INC	8,030	138.13	1,109,183.90	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	810	2,787.98	2,258,263.80	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,740	98.55	368,577.00	
	OPEN TEXT CORP	11,190	49.69	556,031.10	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	47,780	76.74	3,666,637.20	
	BCE INC	3,000	54.63	163,890.00	
	QUEBECOR INC -CL B	6,110	29.64	181,100.40	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	13,875	56.32	781,440.00	
	TELUS CORP	12,662	22.98	290,972.76	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	9.42	255,093.60	
	ALTAGAS LTD	11,170	26.94	300,919.80	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	37.29	203,044.05	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	31.13	141,952.80	
	EMERA INC	10,460	51.25	536,075.00	
	FORTIS INC	19,055	55.30	1,053,741.50	
	HYDRO ONE LTD	13,230	36.35	480,910.50	
	NORTHLAND POWER INC	8,600	23.61	203,046.00	
	FIRSTSERVICE CORP	1,500	209.48	314,220.00	
	加ドル小計	1,610,409		97,076,989.68 (10,686,235,023)	
ユーロ	ENI SPA	89,476	15.23	1,363,256.33	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	18,755	14.02	262,945.10	
	NESTE OYJ	16,380	35.30	578,214.00	
	OMV AG	5,480	45.81	251,038.80	
	REPSOL SA	54,849	15.36	842,754.88	
	TENARIS SA	17,895	15.09	270,035.55	
	TOTALENERGIES SE	90,417	62.29	5,632,074.93	

AIR LIQUIDE SA	20,889	162.16	3,387,360.24
AKZO NOBEL	6,937	69.70	483,508.90
ARCELORMITTAL	20,552	23.98	492,836.96
ARKEMA	2,215	91.64	202,982.60
BASF SE	37,045	45.68	1,692,400.82
COVESTRO AG	7,410	51.90	384,579.00
CRH PLC	30,060	50.34	1,513,220.40
DSM-FIRMENICH AG	7,552	80.16	605,368.32
EVONIK INDUSTRIES AG	8,230	18.08	148,798.40
HEIDELBERG MATERIALS AG	5,715	72.66	415,251.90
OCI NV	4,810	25.61	123,184.10
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,050	32.28	292,134.00
SOLVAY SA	2,811	109.30	307,242.30
STORA ENSO OYJ-R SHS	25,365	11.80	299,433.82
SYMRISE AG	5,790	92.36	534,764.40
UMICORE	7,960	23.18	184,512.80
UPM-KYMMENE OYJ	21,098	32.32	681,887.36
VOESTALPINE AG	4,249	26.94	114,468.06
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,876	34.36	270,619.36
AIRBUS GROUP SE	23,598	129.64	3,059,244.72
ALSTOM	11,635	24.06	279,938.10
BOUYGUES SA	8,460	33.91	286,878.60
BRENTAG SE	6,865	77.58	532,586.70
CNH INDUSTRIAL NV	39,510	12.26	484,392.60
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	19,106	57.94	1,107,001.64
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	18,186	34.00	618,324.00
DASSAULT AVIATION SA	900	181.00	162,900.00
EIFFAGE	3,250	92.36	300,170.00
FERROVIAL SE	17,825	30.34	540,810.50
GEA GROUP AG	6,020	35.70	214,914.00
IMCD NV	2,120	120.80	256,096.00
KINGSPAN GROUP PLC	5,900	72.00	424,800.00
KNORR-BREMSE AG	2,970	59.58	176,952.60
KONE OYJ-B	13,614	40.66	553,545.24
LEGRAND SA	11,128	87.68	975,703.04
METSO CORPORATION	24,200	10.37	250,954.00
MTU AERO ENGINES AG	2,020	162.60	328,452.00
PRYSMIAN SPA	9,565	38.99	372,939.35
RATIONAL AG	230	603.50	138,805.00
RHEINMETALL AG	1,730	258.20	446,686.00
SAFRAN SA	13,080	152.04	1,988,683.20
SCHNEIDER ELECTRIC SE	21,918	157.96	3,462,167.28
SIEMENS AG-REG	30,576	136.20	4,164,451.20

SIEMENS ENERGY AG	21,343	12.62	269,455.37
THALES SA	4,015	137.30	551,259.50
VINCI SA	20,600	107.68	2,218,208.00
WARTSILA OYJ ABP	18,180	11.42	207,706.50
BUREAU VERITAS SA	10,920	24.10	263,172.00
RANDSTAD NV	4,675	52.08	243,474.00
TELEPERFORMANCE	2,240	122.45	274,288.00
WOLTERS KLUWER	10,027	116.60	1,169,148.20
ADP	1,090	115.20	125,568.00
AENA SA	2,870	143.70	412,419.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	8.12	193,977.24
DEUTSCHE POST AG-REG	39,823	39.58	1,576,393.45
GETLINK	17,310	15.71	271,940.10
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,355	100.24	1,338,705.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,210	91.90	203,099.00
CONTINENTAL AG	4,385	67.02	293,882.70
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	4,380	94.64	414,523.20
FERRARI NV	5,019	287.20	1,441,456.80
MERCEDES-BENZ GROUP AG	34,202	68.21	2,332,918.42
MICHELIN (CGDE)	24,706	30.29	748,344.74
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	49.49	280,608.30
RENAULT SA	8,247	39.02	321,797.94
STELLANTIS NV	90,796	18.61	1,690,258.33
VALEO SA	7,420	17.65	130,963.00
VOLKSWAGEN AG	1,151	129.65	149,227.15
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,073	111.82	902,722.86
ADIDAS AG	6,571	166.80	1,096,042.80
HERMES INTERNATIONAL	1,272	1,876.40	2,386,780.80
KERING	3,007	457.60	1,376,003.20
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	11,084	736.70	8,165,582.80
MONCLER SPA	8,080	57.74	466,539.20
PUMA SE	4,200	59.40	249,480.00
SEB SA	987	91.00	89,817.00
ACCOR SA	6,056	34.20	207,115.20
AMADEUS IT GROUP SA	18,350	62.76	1,151,646.00
DELIVERY HERO SE	6,600	31.89	210,474.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,816	170.00	1,158,720.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	32.54	126,906.00
SODEXO	3,240	101.40	328,536.00
BOLLORE SE	33,530	5.30	177,709.00
PUBLICIS GROUPE	9,305	72.02	670,146.10
SCOUT24 SE	2,970	66.04	196,138.80
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	31,460	24.41	767,938.60

VIVENDI SE	26,070	8.32	217,058.82
D'IETEREN GROUP	1,050	161.90	169,995.00
INDITEX	43,905	35.79	1,571,359.95
PROSUS NV	62,794	28.87	1,812,862.78
ZALANDO SE	8,260	24.13	199,313.80
CARREFOUR SA	22,633	16.92	383,063.52
HELLOFRESH SE	6,070	32.24	195,696.80
JERONIMO MARTINS	10,585	21.56	228,212.60
KESKO OYJ-B SHS	10,930	17.67	193,187.75
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	40,028	29.32	1,173,620.96
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	33,221	53.41	1,774,333.61
DANONE	25,794	54.08	1,394,939.52
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,850	11.76	233,436.00
HEINEKEN HOLDING NV	4,895	73.25	358,558.75
HEINEKEN NV	11,343	87.26	989,790.18
JDE PEET'S NV	6,290	25.66	161,401.40
KERRY GROUP PLC-A	6,460	83.26	537,859.60
PERNOD-RICARD SA	8,296	168.70	1,399,535.20
REMY COINTREAU	810	129.85	105,178.50
BEIERSDORF AG	4,375	126.75	554,531.25
HENKEL AG & CO KGAA	4,520	60.94	275,448.80
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,793	67.86	460,972.98
L'OREAL	9,651	410.00	3,956,910.00
AMPLIFON SPA	4,830	30.35	146,590.50
BIOMERIEUX	1,690	92.52	156,358.80
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	82.94	133,533.40
DIASORIN ITALIA SPA	930	90.32	83,997.60
ESSILORLUXOTTICA	11,505	175.34	2,017,286.70
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,613	43.20	328,881.60
FRESENIUS SE & CO KGAA	15,695	31.11	488,271.45
KONINKLIJKE PHILIPS NV	36,772	19.90	732,056.97
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,640	45.83	487,631.20
ARGENX SE	2,315	487.60	1,128,794.00
BAYER AG-REG	39,064	49.15	1,920,190.92
EUROFINS SCIENTIFIC	5,050	56.14	283,507.00
GRIFOLS SA	12,050	13.03	157,011.50
IPSEN	1,600	126.10	201,760.00
MERCK KGAA	5,150	160.40	826,060.00
ORION OYJ-CLASS B	4,500	37.08	166,860.00
QIAGEN N.V.	10,384	37.82	392,722.88
RECORDATI SPA	3,720	47.40	176,328.00
SANOFI	45,686	103.80	4,742,206.80
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,230	333.00	409,590.00

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	239.70	258,876.00
UCB SA	4,928	84.78	417,795.84
ABN AMRO BANK NV-CVA	15,170	13.80	209,421.85
AIB GROUP PLC	51,000	4.05	206,958.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	241,763	7.49	1,811,771.92
BANCO SANTANDER SA	662,389	3.52	2,333,596.44
BANK OF IRELAND GROUP PLC	44,790	8.80	394,152.00
BNP PARIBAS	44,242	62.07	2,746,100.94
CAIXABANK S.A	163,050	3.61	589,099.65
COMMERZBANK AG	40,474	9.95	402,716.30
CREDIT AGRICOLE SA	49,662	11.80	586,011.60
ERSTE GROUP BANK AG	13,018	33.04	430,114.72
FINECOBANK SPA	23,540	12.05	283,657.00
ING GROEP NV-CVA	146,925	13.11	1,927,068.30
INTESA SANPAOLO	658,093	2.51	1,654,116.75
KBC GROEP NV	9,719	61.12	594,025.28
MEDIOBANCA SPA	19,520	12.40	242,145.60
SOCIETE GENERALE	30,909	23.83	736,561.47
UNICREDIT SPA	73,256	23.10	1,692,213.60
ADYEN NV	865	663.90	574,273.50
AMUNDI SA	2,140	54.45	116,523.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	80,935	10.15	821,490.25
DEUTSCHE BOERSE AG	7,600	165.75	1,259,700.00
EDENRED	9,626	60.88	586,030.88
EURAZEO SE	1,487	58.15	86,469.05
EURONEXT NV	3,470	65.60	227,632.00
EXOR NV	4,164	85.90	357,687.60
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,452	73.68	254,343.36
NEXI SPA	21,240	6.13	130,328.64
SOFINA	655	200.80	131,524.00
WENDEL	1,000	78.85	78,850.00
WORLDLINE SA	8,950	28.10	251,495.00
AEGON NV	69,679	4.81	335,155.99
AGEAS	5,924	40.19	238,085.56
ALLIANZ SE-REG	16,233	231.40	3,756,316.20
ASR NEDERLAND NV	5,880	42.74	251,311.20
ASSICURAZIONI GENERALI	42,248	20.00	844,960.00
AXA SA	75,752	29.35	2,223,321.20
HANNOVER RUECK SE-REG	2,275	211.90	482,072.50
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,626	377.30	2,122,689.80
NN GROUP NV	10,270	37.29	382,968.30
POSTE ITALIANE SPA	19,560	10.22	199,903.20
SAMPO OYJ-A SHS	19,639	41.65	817,964.35

TALANX AG	2,500	59.20	148,000.00	
BECHTLE AG	3,070	44.71	137,259.70	
CAP GEMINI SA	6,509	168.90	1,099,370.10	
DASSAULT SYSTEMES SE	27,400	35.22	965,028.00	
NEMETSCHKE SE	2,350	58.78	138,133.00	
SAP SE	41,962	125.46	5,264,552.52	
NOKIA OYJ	213,336	3.72	793,929.92	
CELLNEX TELECOM SA	21,660	36.24	784,958.40	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	128,776	20.75	2,672,745.88	
ELISA OYJ	6,005	45.93	275,809.65	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	11.77	178,550.90	
KONINKLIJKE KPN NV	122,956	3.23	398,008.57	
ORANGE S.A.	72,804	11.25	819,045.00	
TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.32	130,166.72	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	46,470	1.81	84,250.11	
TELEFONICA SA	195,629	4.08	799,926.98	
ACCIONA SA	830	128.50	106,655.00	
E.ON SE	90,999	11.85	1,078,793.14	
EDP RENOVAVEIS SA	11,156	16.56	184,799.14	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	126,131	4.23	533,786.39	
ELIA GROUP SA/NV	1,356	106.00	143,736.00	
ENAGAS SA	8,610	16.57	142,667.70	
ENDESA SA	12,050	20.18	243,169.00	
ENEL SPA	309,737	6.27	1,943,599.67	
ENGIE	71,874	15.16	1,090,184.83	
FORTUM OYJ	16,755	12.27	205,583.85	
IBERDROLA SA	244,512	11.26	2,753,205.12	
NATURGY ENERGY GROUP SA	4,522	27.74	125,440.28	
REDEIA CORP SA	15,580	15.45	240,711.00	
RWE AG	25,835	36.80	950,728.00	
SNAM SPA	91,120	4.81	438,742.80	
TERNA SPA	53,627	7.75	415,823.75	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	25,530	29.61	755,943.30	
VERBUND AG	2,780	83.45	231,991.00	
ASM INTERNATIONAL NV	1,935	372.05	719,916.75	
ASML HOLDING NV	16,172	556.60	9,001,335.20	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	2,870	89.28	256,233.60	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	51,775	31.52	1,632,206.87	
STMICROELECTRONICS NV	27,283	40.70	1,110,554.51	
LEG IMMOBILIEN SE	3,010	70.74	212,927.40	
VONOVIA SE	27,119	24.13	654,381.47	
ユーロ小計	7,226,420		186,550,618.75 (29,432,091,120)	

英ボンド	BP PLC	703,648	5.23	3,682,893.63
	SHELL PLC-NEW	270,927	25.94	7,029,201.01
	ANGLO AMERICAN PLC	54,004	22.96	1,239,931.84
	ANTOFAGASTA PLC	14,330	14.55	208,501.50
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,131	50.56	309,983.36
	ENDEAVOUR MINING PLC	6,490	16.59	107,669.10
	GLENCORE PLC	417,803	4.63	1,938,188.11
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,339	17.34	127,258.26
	MONDI PLC	18,370	13.73	252,220.10
	RIO TINTO PLC	44,725	52.84	2,363,269.00
	ASHTED GROUP PLC	17,770	52.08	925,461.60
	BAE SYSTEMS PLC ORD	124,235	10.45	1,298,255.75
	BUNZL PLC	12,896	29.41	379,271.36
	DCC PLC	3,820	45.79	174,917.80
	MELROSE INDUSTRIES PLC	50,400	4.86	244,944.00
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	353,031	2.23	789,730.34
	SMITHS GROUP PLC	13,603	16.94	230,434.82
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,890	97.84	282,757.60
	EXPERIAN PLC	37,408	27.89	1,043,309.12
	INTERTEK GROUP PLC	6,025	41.86	252,206.50
	RELX PLC	76,445	28.28	2,161,864.60
	RENTOKIL INITIAL PLC	115,300	6.03	695,950.80
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	4.65	189,551.60
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,515	41.95	189,404.25
	BURBERRY GROUP PLC	15,504	20.41	316,436.64
	PERSIMMON PLC	12,440	11.00	136,840.00
	TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.21	151,017.53
	COMPASS GROUP PLC	72,268	20.64	1,491,611.52
	ENTAIN PLC	24,860	11.09	275,821.70
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,473	62.98	470,649.54
	PEARSON PLC	26,089	8.75	228,278.75
	WHITBREAD PLC	8,110	36.32	294,555.20
	AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	6.26	228,656.64
	INFORMA PLC	56,580	7.50	424,463.16
WPP PLC	41,144	7.50	308,580.00	
JD SPORTS FASHION PLC	97,350	1.32	129,426.82	
KINGFISHER PLC	78,137	2.15	168,541.50	
NEXT PLC	5,667	71.06	402,697.02	
OCADO GROUP PLC	22,670	8.08	183,264.28	
SAINSBURY (J) PLC	70,601	2.76	195,494.16	
TESCO PLC	288,058	2.70	779,196.89	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,125	20.86	273,787.50	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	84,677	27.35	2,315,915.95	

COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	22.98	176,716.20
DIAGEO PLC	90,492	31.99	2,895,291.54
IMPERIAL BRANDS PLC	38,792	17.62	683,709.00
HALEON PLC	218,251	3.34	730,267.84
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	28,605	59.08	1,689,983.40
UNILEVER PLC	100,772	41.15	4,147,271.66
NMC HEALTH PLC	8,090	-	-
SMITH & NEPHEW PLC	33,906	10.51	356,521.59
ASTRAZENECA PLC	61,752	109.50	6,761,844.00
GSK PLC	163,260	15.34	2,505,061.44
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,740	21.27	122,089.80
BARCLAYS PLC	639,751	1.59	1,020,914.64
HSBC HOLDINGS PLC	789,061	6.33	4,997,912.37
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,649,936	0.44	1,180,811.48
NATWEST GROUP PLC	204,035	2.41	492,540.49
STANDARD CHARTERED PLC	95,420	7.49	715,077.48
3I GROUP PLC	40,649	20.54	834,930.46
ABRDN PLC	88,515	1.59	141,225.68
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	8.15	106,217.16
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	16,267	83.76	1,362,523.92
M&G PLC	99,522	2.02	201,731.09
SCHRODERS PLC	30,300	4.14	125,442.00
ST JAMES'S PLACE PLC	20,540	8.47	174,055.96
WISE PLC - A	21,400	6.80	145,520.00
ADMIRAL GROUP PLC	6,795	24.15	164,099.25
AVIVA PLC	94,524	4.01	379,419.33
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	225,651	2.30	520,125.55
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,230	5.38	162,818.78
PRUDENTIAL PLC	110,702	9.23	1,022,665.07
SAGE GROUP PLC/THE	38,840	10.23	397,527.40
HALMA PLC	14,690	20.76	304,964.40
BT GROUP PLC	267,752	1.21	325,050.92
VODAFONE GROUP PLC	996,528	0.81	807,386.98
CENTRICA PLC	209,200	1.69	354,698.60
NATIONAL GRID PLC	140,528	10.34	1,453,762.16
SEVERN TRENT PLC	9,023	24.79	223,680.17
SSE PLC	43,667	17.02	743,430.67
UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	9.95	259,849.17
英ボンド小計	11,168,149		73,579,548.50 (13,448,869,874)
スイスフラン			
CLARIANT AG-REG	7,990	14.94	119,370.60
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	648.00	174,960.00
GIVAUDAN-REG	378	2,965.00	1,120,770.00

HOLCIM LTD	22,219	59.58	1,323,808.02	
SIG GROUP AG	10,900	23.26	253,534.00	
SIKA AG-REG	5,675	242.80	1,377,890.00	
ABB LTD-REG	61,275	32.88	2,014,722.00	
GEBERIT AG-REG	1,490	456.30	679,887.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,070	180.40	193,028.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	187.85	278,018.00	
VAT GROUP AG	1,015	325.40	330,281.00	
ADECCO GROUP AG-REG	6,817	38.25	260,750.25	
SGS SA-REG	5,950	80.00	476,000.00	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,160	269.00	581,040.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	20,559	115.55	2,375,592.45	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,125	239.90	269,887.50	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,950	45.75	89,212.50	
DUFRY AG-REG	3,460	37.05	128,193.00	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	130	1,493.00	194,090.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	40	10,510.00	420,400.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	103,600.00	518,000.00	
NESTLE SA-REG	107,170	106.72	11,437,182.40	
ALCON INC	19,554	72.50	1,417,665.00	
SONOVA HOLDING AG-REG	2,051	218.00	447,118.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,370	128.00	559,360.00	
BACHEM HOLDING AG	1,400	70.40	98,560.00	
LONZA GROUP AG-REG	2,973	440.70	1,310,201.10	
NOVARTIS AG-REG	82,243	92.89	7,639,552.27	
ROCHE HOLDING AG-BR	1,280	278.60	356,608.00	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	28,203	256.10	7,222,788.30	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,510	96.70	146,017.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	8,420	60.28	507,557.60	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	900	1,053.00	947,700.00	
UBS GROUP AG-REG	132,512	23.74	3,145,834.88	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,740	136.70	237,858.00	
HELVETIA HOLDING AG-REG	1,320	131.60	173,712.00	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,285	576.00	740,160.00	
SWISS RE AG	12,289	95.00	1,167,455.00	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,011	429.80	2,583,527.80	
TEMENOS AG	2,280	65.62	149,613.60	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	64.34	428,504.40	
SWISSCOM AG-REG	1,024	551.00	564,224.00	
BKW AG	840	164.60	138,264.00	
SWISS PRIME SITE-REG	3,441	85.90	295,581.90	
スイスフラン小計	585,434		54,894,479.57 (9,048,257,067)	

スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	10,290	313.55	3,226,429.50	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,520	429.20	1,510,784.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	22,680	149.75	3,396,330.00	
	ALFA LAVAL AB	10,710	375.50	4,021,605.00	
	ASSA ABLOY AB-B	42,940	246.00	10,563,240.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	111,390	147.30	16,407,747.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	56,870	127.60	7,256,612.00	
	BEIJER REF AB	15,480	118.60	1,835,928.00	
	EPIROC AB-A	31,565	212.90	6,720,188.50	
	EPIROC AB-B	15,450	179.70	2,776,365.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	84.28	1,264,200.00	
	INDUTRADE AB	10,180	210.20	2,139,836.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	196.50	1,336,200.00	
	LIFCO AB-B SHS	8,470	196.45	1,663,931.50	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	63,000	72.20	4,548,600.00	
	SAAB AB-B	2,780	583.00	1,620,740.00	
	SANDVIK AB	40,890	209.30	8,558,277.00	
	SKANSKA AB-B SHS	14,390	181.00	2,604,590.00	
	SKF AB-B SHARES-B	14,079	184.35	2,595,463.65	
	VOLVO AB-A SHS	9,530	234.00	2,230,020.00	
	VOLVO AB-B SHS-B	58,430	232.30	13,573,289.00	
	SECURITAS AB-B SHS	17,788	86.58	1,540,085.04	
	VOLVO CAR AB-B	20,400	43.97	896,988.00	
	EVOLUTION AB	7,140	1,167.40	8,335,236.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,848	159.94	4,454,009.12	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	23,695	241.00	5,710,495.00	
	GETINGE AB-B SHS	9,470	202.00	1,912,940.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	7,130	218.60	1,558,618.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM-BTA	1,018	220.00	223,960.00	
	NORDEA BANK ABP	131,132	122.80	16,103,009.60	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	62,450	130.95	8,177,827.50	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60,120	98.64	5,930,236.80	
	SWEDBANK AB - A SHARES	34,550	203.60	7,034,380.00	
	EQT AB	14,450	216.80	3,132,760.00	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	297.00	1,480,248.00		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	296.70	1,774,266.00		
INVESTOR AB-B SHS	69,350	217.25	15,066,287.50		
LUNDBERGS AB-B SHS	3,590	465.50	1,671,145.00		
ERICSSON LM-B SHS	114,915	57.44	6,600,717.60		
HEXAGON AB-B SHS	80,990	95.26	7,715,107.40		
TELE2 AB-B SHS	23,245	83.34	1,937,238.30		
TELIA CO AB	118,530	23.38	2,771,231.40		
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	23,220	52.50	1,219,050.00		

	SAGAX AB-B	7,910	223.10	1,764,721.00
スウェーデンクローナ小計		1,434,349		206,860,933.41 (2,747,113,195)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	12,100	303.90	3,677,190.00
	EQUINOR ASA	39,014	355.95	13,887,033.30
	NORSK HYDRO A S	50,660	63.76	3,230,081.60
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,670	406.40	2,710,688.00
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,900	460.60	1,796,340.00
	ADEVINTA ASA	11,400	83.60	953,040.00
	MOWI ASA	16,360	196.55	3,215,558.00
	ORKLA ASA	32,290	83.20	2,686,528.00
	SALMAR ASA	3,590	563.00	2,021,170.00
	DNB BANK ASA	35,845	217.50	7,796,287.50
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,410	163.80	1,213,758.00
	TELENOR ASA	23,915	123.45	2,952,306.75
ノルウェークローネ小計		243,154		46,139,981.15 (633,501,941)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,840	447.60	1,718,784.00
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,165	295.00	2,408,675.00
	ROCKWOOL A/S-B SHS	315	1,677.50	528,412.50
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	41,480	158.28	6,565,454.40
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	115	12,650.00	1,454,750.00
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	195	12,800.00	2,496,000.00
	DSV A/S	7,890	1,312.00	10,351,680.00
	PANDORA A/S	3,310	718.80	2,379,228.00
	CARLSBERG AS-B	3,910	946.00	3,698,860.00
	COLOPLAST-B	5,015	770.60	3,864,559.00
	DEMANT A/S	3,640	307.00	1,117,480.00
	GENMAB A/S	2,580	2,620.00	6,759,600.00
	NOVO NORDISK A/S-B	131,150	662.60	86,899,990.00
	DANSKE BANK A/S	26,635	165.20	4,400,102.00
	TRYG A/S	13,945	136.55	1,904,189.75
ORSTED A/S	7,570	416.10	3,149,877.00	
デンマーククローネ小計		259,755		139,697,641.65 (2,957,399,073)
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	33.24	291,681.00
	SANTOS LTD	121,660	7.70	936,782.00
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	75,946	37.00	2,810,002.00
	BHP GROUP LTD	203,587	44.64	9,088,123.68
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	19.21	351,735.10
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	65,915	20.61	1,358,508.15
	IGO LTD	24,300	12.64	307,152.00
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	16,955	42.09	713,635.95

MINERAL RESOURCES LTD	7,320	69.43	508,227.60
NEWCREST MINING LTD	35,809	26.70	956,100.30
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42,190	11.19	472,106.10
ORICA LIMITED	17,675	15.59	275,553.25
PILBARA MINERALS LTD	114,530	4.14	474,154.20
RIO TINTO LTD	14,858	117.03	1,738,831.74
SOUTH32 LTD	207,787	3.33	691,930.71
REECE LTD	10,200	18.89	192,678.00
BRAMBLES LTD	54,798	14.68	804,434.64
COMPUTERSHARE LTD	20,910	25.95	542,614.50
AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	3.58	263,380.60
QANTAS AIRWAYS LTD	35,030	5.33	186,709.90
TRANSURBAN GROUP	129,996	13.13	1,706,847.48
ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,520	42.23	993,249.60
IDP EDUCATION LTD	10,150	23.46	238,119.00
LOTTERY CORP LTD/THE	85,554	4.68	400,392.72
REA GROUP LTD	1,820	160.39	291,909.80
SEEK LTD	12,860	21.93	282,019.80
WESFARMERS LTD	47,855	53.63	2,566,463.65
COLES GROUP LTD	57,925	15.73	911,160.25
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	50,462	5.26	265,430.12
WOOLWORTHS GROUP LTD	49,102	37.82	1,857,037.64
TREASURY WINE ESTATES LTD	27,906	11.61	323,988.66
COCHLEAR LTD	2,947	260.00	766,220.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,105	51.20	363,776.00
SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	30.06	530,859.60
CSL LTD	19,212	262.63	5,045,647.56
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	120,799	25.54	3,085,206.46
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	67,117	101.84	6,835,195.28
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	124,183	29.39	3,649,738.37
WESTPAC BANKING CORP	140,651	21.53	3,028,216.03
ASX LTD	7,105	56.79	403,492.95
MACQUARIE GROUP LTD	14,604	173.29	2,530,727.16
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,370	34.36	287,593.20
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	5.88	559,335.00
MEDIBANK PRIVATE LTD	108,430	3.48	377,336.40
QBE INSURANCE GROUP LTD	55,210	15.42	851,338.20
SUNCORP GROUP LTD	44,036	14.15	623,109.40
WISETECH GLOBAL LTD	5,920	68.00	402,560.00
XERO LTD	5,960	114.38	681,704.80
TELSTRA GROUP LTD	164,284	3.84	630,850.56
APA GROUP	45,818	8.54	391,285.72
ORIGIN ENERGY LTD	68,320	8.67	592,334.40

豪ドル小計		2,790,131		64,437,487.23 (6,144,114,407)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,165	7.86	370,716.90
	EBOS GROUP LTD	5,630	35.67	200,822.10
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,130	21.74	502,846.20
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	4.79	366,803.83
	MERCURY NZ LTD	34,100	6.22	212,102.00
	MERIDIAN ENERGY LTD	57,830	5.24	303,318.35
ニュージーランドドル小計		244,432		1,956,609.38 (171,809,869)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	103,208	41.55	4,288,292.40
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	52,500	79.10	4,152,750.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	71,000	10.82	768,220.00
	MTR CORP	62,500	30.85	1,928,125.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	13.64	709,280.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	91,000	51.55	4,691,050.00
	SANDS CHINA LTD	96,600	25.15	2,429,490.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	16.76	1,138,004.00
	WH GROUP LTD	299,894	4.10	1,229,565.40
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	148,000	21.35	3,159,800.00
	HANG SENG BANK LTD	29,100	95.70	2,784,870.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	48,300	286.60	13,842,780.00
	AIA GROUP LTD	460,390	65.55	30,178,564.50
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	8.30	1,245,000.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	38.40	960,000.00
	CLP HOLDINGS LTD	63,000	59.10	3,723,300.00
	HONG KONG & CHINA GAS	456,237	5.56	2,536,677.72
	POWER ASSETS HOLDINGS	58,000	39.20	2,273,600.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	80,538	40.50	3,261,789.00
	ESR GROUP LTD	75,800	11.06	838,348.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	10.36	808,080.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	20.15	1,166,705.15
	NEW WORLD DEVELOPMENT	61,666	15.38	948,423.08
	SINO LAND CO	123,050	8.65	1,064,382.50
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,480	80.35	4,859,568.00
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	17,517	55.60	973,945.20
SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	15.90	661,440.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	30.25	1,929,950.00	
香港ドル小計		2,994,981		98,551,999.95 (1,870,516,959)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	68,560	6.85	469,636.00
	SEATRIM LTD	1,488,177	0.13	202,392.07
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	63,300	3.87	244,971.00

	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	6.65	358,435.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.87	184,712.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	3.73	275,870.80	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	71,195	33.68	2,397,847.60	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	134,240	12.69	1,703,505.60	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	49,900	28.51	1,422,649.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	9.95	422,875.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	354,480	2.46	872,020.80	
	SEMCORP INDUSTRIES LTD	30,200	5.23	157,946.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	105,000	3.15	330,750.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	6.73	116,429.00	
	UOL GROUP LTD	15,550	6.51	101,230.50	
	シンガポールドル小計	2,779,362		9,261,270.87 (1,005,310,952)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	26,090	22.25	580,502.50	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,010	769.10	776,791.00	
	BANK HAPOALIM BM	50,495	32.11	1,621,394.45	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	62,565	30.71	1,921,371.15	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	48,330	19.76	955,000.80	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,900	130.30	899,070.00	
	NICE LTD	2,440	678.00	1,654,320.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,780	204.60	364,188.00	
	イスラエルシュケル小計	199,610		8,772,637.90 (341,470,543)	
	合 計	45,218,313		305,150,776,278 (305,150,776,278)	

(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	775,578.40	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	12,110	434,264.60	
		AMERICAN TOWER CORP	18,549	3,290,778.09	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	18,847	386,928.91	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,790	1,057,717.20	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,717	374,806.52	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,810	491,582.00	
		CROWN CASTLE INC	16,330	1,579,764.20	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,695	1,497,778.65	
		EQUINIX INC	3,728	2,824,742.88	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,550	443,042.00	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	15,450	964,389.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	555,197.60	

		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,800	1,122,352.00
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,340	549,876.60
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	14,810	238,589.10
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	405,462.50
		HOST HOTELS & RESORTS INC	27,179	440,299.80
		INVITATION HOMES INC	25,700	872,772.00
		IRON MOUNTAIN INC	13,365	848,009.25
		KIMCO REALTY CORP	23,760	438,372.00
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,300	587,810.00
		PROLOGIS INC	37,145	4,491,201.95
		PUBLIC STORAGE	6,319	1,710,995.63
		REALTY INCOME CORP	28,201	1,517,213.80
		REGENCY CENTERS CORP	6,005	375,132.35
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,175	897,499.75
		SIMON PROPERTY GROUP INC	13,394	1,523,701.44
		SUN COMMUNITIES INC	4,640	585,336.00
		UDR INC	12,100	458,953.00
		VENTAS INC	17,025	748,759.50
		VICI PROPERTIES INC	39,120	1,199,419.20
		WELLTOWER INC	20,360	1,735,893.60
		WEYERHAEUSER CO	29,998	952,436.50
		WP CAREY INC	8,610	550,609.50
米ドル小計			505,687	36,927,265.52 (5,481,114,021)
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	136,640.00
加ドル小計			2,800	136,640.00 (15,041,331)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	84,430.50
		GECINA SA	1,950	197,145.00
		KLEPIERRE	8,402	209,881.96
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,990	242,514.00
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,730	188,612.00
ユーロ小計			24,997	922,583.46 (145,555,992)
英ポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	161,447.93
		SEGRO PLC	45,033	338,287.89
英ポンド小計			71,657	499,735.82 (91,341,713)
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	42,067	305,827.09
		GOODMAN GROUP	70,642	1,586,619.32
		GPT GROUP	71,335	292,473.50
		LENDLEASE GROUP	23,367	170,812.77
		MIRVAC GROUP	159,875	351,725.00

		SCENTRE GROUP	198,271	505,591.05	
		STOCKLAND	102,400	406,528.00	
		VICINITY CENTRES	154,902	269,529.48	
豪ドル小計			822,859	3,889,106.21 (370,826,277)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	104,160	3,937,248.00	
香港ドル小計			104,160	3,937,248.00 (74,728,967)	
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,243	389,845.26	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	402,347.52	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	144,556	248,636.32	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	106,000	160,060.00	
シンガポールドル小計			598,355	1,200,889.10 (130,356,511)	
合計				6,308,964,812 (6,308,964,812)	

(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	605銘柄	97.6%		73.0%
	投資証券	35銘柄		2.4%	1.8%
加ドル	株式	86銘柄	99.9%		3.4%
	投資証券	1銘柄		0.1%	0.0%
ユーロ	株式	220銘柄	99.5%		9.4%
	投資証券	5銘柄		0.5%	0.0%
英ポンド	株式	81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	44銘柄	100.0%		2.9%
スウェーデンクローナ	株式	44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%		0.9%
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	96.2%		0.6%
	投資証券	1銘柄		3.8%	0.0%
シンガポールドル	株式	15銘柄	88.5%		0.3%
	投資証券	4銘柄		11.5%	0.0%
イスラエルシェケル	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。

海外新興国株式インデックスMSCIEマージング（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 9月21日現在	2023年 9月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,933,542,413	450,838,687
コール・ローン	1,260,817,628	88,600,054
株式	89,562,031,570	102,083,507,534
投資証券	100,035,022	106,998,403
派生商品評価勘定	1,086,299	-
未収入金	31,275,549	17,171,096
未収配当金	151,418,286	194,672,169
未収利息	10,491	10,433
差入委託証拠金	4,214,592,065	5,350,236,983
流動資産合計	97,254,809,323	108,292,035,359
資産合計	97,254,809,323	108,292,035,359
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	213,183,222	49,629,055
未払金	-	9,429,038
未払解約金	1,290,576,504	6,085,140
未払利息	1,715	81
流動負債合計	1,503,761,441	65,143,314
負債合計	1,503,761,441	65,143,314
純資産の部		
元本等		
元本	42,339,806,937	44,072,759,067
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	53,411,240,945	64,154,132,978
元本等合計	95,751,047,882	108,226,892,045
純資産合計	95,751,047,882	108,226,892,045
負債純資産合計	97,254,809,323	108,292,035,359

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、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。 （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 9月21日現在	2023年 9月21日現在
--	---------------	---------------

1.	期首	2021年 9月22日	2022年 9月22日
	期首元本額	48,129,522,181円	42,339,806,937円
	期首からの追加設定元本額	9,267,492,418円	14,406,225,342円
	期首からの一部解約元本額	15,057,207,662円	12,673,273,212円
	元本の内訳		
	日興五大陸株式ファンド	1,751,341,825円	1,830,617,112円
	インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	16,229,704,319円	18,876,081,407円
	インデックスファンド新興国株式（適格機関投資家向け）	3,279,235,631円	3,177,686,494円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	21,079,525,162円	20,069,108,938円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	- 円	1,874,412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	42,664,259円
	Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）	- 円	73,395,266円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	- 円	1,042,114円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	- 円	289,065円
	計	42,339,806,937円	44,072,759,067円
2.	受益権の総数	42,339,806,937口	44,072,759,067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 9月22日 至 2022年 9月21日	自 2022年 9月22日 至 2023年 9月21日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

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

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,672,839,224

投資証券	8,732,217
合計	2,681,571,441

(2023年 9月21日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	545,462,705
投資証券	8,691,068
合計	554,153,773

(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 9月21日現在)

(単位:円)

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

(2023年 9月21日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	6,084,151,637	-	6,034,522,582	49,629,055
合計		6,084,151,637	-	6,034,522,582	49,629,055

(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 9月21日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	388,720,878	-	389,145,016	424,138
	米ドル	388,720,878	-	389,145,016	424,138
	売建	478,457,608	-	479,624,423	1,166,815
	メキシコペソ	5,340,975	-	5,392,350	51,375
	ブラジルリアル	41,041,518	-	41,041,518	-
	香港ドル	54,660,300	-	54,926,100	265,800

インドネシアルピア	26,736,160	-	26,736,160	-
韓国ウォン	112,488,000	-	112,597,000	109,000
台湾ドル	145,840,000	-	146,556,800	716,800
南アフリカランド	29,735,455	-	29,595,295	140,160
サウジアラビアリアル	62,615,200	-	62,779,200	164,000
合計	867,178,486	-	868,769,439	742,677

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(2023年 9月21日現在)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2022年 9月21日現在		2023年 9月21日現在	
1口当たり純資産額	2.2615円	1口当たり純資産額	2.4556円
(1万口当たり純資産額)	(22,615円)	(1万口当たり純資産額)	(24,556円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	COSAN SA -ADR	3,000	15.19	45,570.00	
	GAZPROM PAO-SPON ADR	649,360	0.00	64.93	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	129,600	1.38	179,236.80	
	LUKOIL PJSC	43,315	0.00	4.33	
	LUKOIL PJSC-SPON-ADR	2,640	0.00	0.26	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	10,221	0.00	1.02	
	PETROLEO BRASILEIRO S.A. -ADR	13,300	15.33	203,889.00	
	PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	18,400	14.03	258,152.00	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	126,380	0.00	12.63	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	174,750	0.00	17.47	
	TATNEFT-SPONSORED-ADR	27,469	0.00	2.74	
	CEMEX SAB-SPONS ADR PART CER	9,800	7.12	69,776.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	22,750	8.26	187,915.00	

GERDAU SA -SPON ADR	11,552	5.10	58,915.20
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	72,014	0.00	7.20
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	18,540	0.00	1.85
PHOSAGRO PJSC REG S-GDR	17,606	0.00	1.76
PHOSAGRO PJSC REG S-GDR(FUKA)	113	0.00	0.01
POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,870	0.00	0.78
SEVERSTAL - GDR REG S	26,330	0.00	2.63
SOUTHERN COPPER CORP(US)	8,965	77.88	698,194.20
SUZANO SA - SPON ADR	9,200	11.20	103,040.00
VALE SA-SP ADR	7,600	14.20	107,920.00
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	5,451	58.80	320,518.80
GRUPO AEROPORTUARIO PAC-ADR	500	180.35	90,175.00
GRUPO AEROPORTUARIO SUR-ADR	150	256.58	38,487.00
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	44,050	24.72	1,088,916.00
NIO INC - ADR	143,050	8.82	1,261,701.00
H WORLD GROUP LTD-ADR	19,922	39.44	785,723.68
TAL EDUCATION GROUP- ADR	47,500	7.21	342,475.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	43,500	56.10	2,440,350.00
AUTOHOME INC-ADR	7,790	29.66	231,051.40
GRUPO TELEVISIA SA-SPONS ADR	11,500	3.39	38,985.00
IQIYI INC-ADR	44,800	4.67	209,216.00
JOYY INC-ADR	4,790	39.70	190,163.00
KANZHUN LTD-ADR	18,650	14.99	279,563.50
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	74,500	6.12	455,940.00
VK CO LTD -GDR	15,200	0.00	1.52
WEIBO CORP-SPON-ADR	7,714	11.93	92,028.02
YANDEX NV-A	35,050	0.00	3.50
MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	9,100	25.49	231,959.00
OZON HOLDINGS PLC - ADR	6,400	0.00	0.64
PDD HOLDINGS INC-ADR	61,470	94.48	5,807,685.60
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	36,448	14.45	526,673.60
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	43,800	0.00	4.38
SENDAS DISTRIBUIDORA-ADR	14,150	12.44	176,026.00
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	15,430	0.00	1.54
AMBEV SA-ADR	34,100	2.73	93,093.00
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	6,980	13.34	93,113.20
COCA-COLA FEMSA SAB-SP ADR	1,650	81.37	134,260.50
FOMENTO ECONOMICO MEX-SP ADR	1,800	109.61	197,298.00
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	6,200	64.24	398,288.00
BANCO BRADESCO-ADR	36,400	3.05	111,020.00
BANCO DE CHILE-ADR	2,200	20.52	45,144.00
BANCO SANTANDER BRASIL-ADS	11,900	5.46	64,974.00
BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	2,500	18.70	46,750.00

	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	250,000	1.26	317,000.00	
	CREDICORP LTD	6,895	135.00	930,825.00	
	ITAU UNIBANCO H-SPON PRF ADR-ADR	34,850	5.62	195,857.00	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	576,360	0.00	57.63	
	SBERBANK PJSC-SPONSORED ADR	51,750	0.00	5.17	
	TCS GROUP HOLDING -REG S-GDR	13,410	0.00	1.34	
	VTB BANK PJSC	336,460,000	0.00	33,646.00	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	69,250	1.12	77,560.00	
	QIFU TECHNOLOGY INC-ADR	11,900	15.19	180,761.00	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	54,288	2.04	111,018.96	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	60,892	0.00	6.08	
	TELEFONICA BRASIL-ADR	5,687	9.20	52,320.40	
	TIM SA-ADR	5,550	15.78	87,579.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BR-SP ADR	82,600	7.41	612,066.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE-ADR	4,200	12.33	51,786.00	
	ENEL CHILE SA-ADR	12,300	3.16	38,868.00	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	6,350	30.21	191,833.50	
	KE HOLDINGS INC-ADR	68,070	16.16	1,100,011.20	
米ドル小計		339,999,772		21,685,517.97 (3,218,781,432)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	1,475,603	12.21	18,017,112.63	
	GRUPO MEXICO SA-SER B	320,554	84.22	26,997,057.88	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	19,850	222.78	4,422,183.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	101,665	40.04	4,070,666.60	
	ALFA S.A.B. -A	322,500	11.08	3,573,300.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	56,300	143.13	8,058,219.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	34,562	308.14	10,649,934.68	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	18,675	437.35	8,167,511.25	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	21,040	161.42	3,396,276.80	
	GRUPO TELEVISIA SAB	224,900	11.54	2,595,346.00	
	WALMART DE MEXICO -SER V	537,800	65.78	35,376,484.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	52,800	161.38	8,520,864.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	40,100	139.19	5,581,519.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	183,154	187.31	34,306,575.74	
	GRUMA S.A.B. -B	19,615	293.70	5,760,925.50	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	140,200	83.35	11,685,670.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	164,470	38.26	6,292,622.20	
	BANCO DEL BAJIO SA	80,800	57.96	4,683,168.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	269,447	151.45	40,807,748.15	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	227,000	36.53	8,292,310.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,990,749	15.59	31,035,776.91	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	145,200	16.21	2,353,692.00	
		6,446,984		284,644,963.34	

メキシコペソ小計				(2,468,042,619)	
ブラジルリアル	COSAN SA	111,200	18.51	2,058,312.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	356,160	37.41	13,323,945.60	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	464,960	34.29	15,943,478.40	
	PRIO SA	77,600	48.71	3,779,896.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	77,480	18.96	1,469,020.80	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL	64,800	12.41	804,168.00	
	GERDAU SA-PREF	106,575	24.97	2,661,177.75	
	KLABIN SA - UNIT	81,100	24.06	1,951,266.00	
	SUZANO SA	71,547	54.89	3,927,214.83	
	VALE SA	348,106	69.31	24,127,226.86	
	WEG SA	174,272	35.79	6,237,194.88	
	CCR SA	110,220	12.79	1,409,713.80	
	LOCALIZA RENT A CAR SA	93,235	59.75	5,570,791.25	
	RUMO SA	134,400	23.88	3,209,472.00	
	LOJAS RENNER S.A.	98,662	14.66	1,446,384.92	
	MAGAZINE LUIZA SA	292,700	2.52	737,604.00	
	VIBRA ENERGIA SA	120,200	19.38	2,329,476.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	67,500	9.22	622,350.00	
	RAIA DROGASIL SA	131,916	27.18	3,585,476.88	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	77,900	12.14	945,706.00	
	AMBEV SA	446,100	13.47	6,008,967.00	
	JBS SA	80,500	18.62	1,498,910.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	94,532	15.93	1,505,894.76	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	536,163	4.43	2,375,202.09	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	59,600	27.49	1,638,404.00	
	HYPERMARCAS SA	44,600	37.79	1,685,434.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	138,840	13.06	1,813,250.40	
	BANCO BRADESCO SA-PRF	530,979	14.81	7,863,798.99	
	BANCO DO BRASIL S.A.	89,500	47.70	4,269,150.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	24,150	26.56	641,424.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	464,715	27.62	12,835,428.30	
	ITAUSA SA-PRF	542,070	9.39	5,090,037.30	
	ITAUSA SA-RTS	7,469	2.87	21,436.03	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	604,449	13.13	7,936,415.37	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	118,600	31.06	3,683,716.00		
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	73,900	32.20	2,379,580.00		
TOTVS SA	53,000	27.01	1,431,530.00		
TELEFONICA BRASIL S.A.	36,375	44.80	1,629,600.00		
TIM SA	56,736	15.35	870,897.60		
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	28,700	39.11	1,122,457.00		
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	42,700	36.12	1,542,324.00		
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	146,491	13.15	1,926,356.65		

	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	31,460	60.46	1,902,071.60	
	CPFL ENERGIA SA	23,300	35.77	833,441.00	
	ENERGISA SA-UNITS	23,800	50.03	1,190,714.00	
	ENEVA SA	95,600	12.16	1,162,496.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	21,050	43.41	913,780.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	107,249	33.54	3,597,131.46	
ブラジルリアル小計		7,583,161		175,509,724.02	(5,335,425,406)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	39,100	6,197.00	242,302,700.00	
	EMPRESAS CMPC SA	109,000	1,625.00	177,125,000.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B-PRF	9,450	52,762.00	498,600,900.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	1,875,000	55.31	103,706,250.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	89,300	2,050.00	183,065,000.00	
	CENCOSUD SA	130,150	1,756.00	228,543,400.00	
	BANCO DE CHILE	4,238,027	90.75	384,600,950.25	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,596	23,800.00	156,984,800.00	
	BANCO SANTANDER CHILE SA	6,020,500	41.25	248,345,625.00	
	ENEL AMERICAS SA	2,277,620	101.50	231,178,430.00	
	ENEL CHILE SA	2,487,370	57.05	141,904,458.50	
チリペソ小計		17,282,113		2,596,357,513.75	(436,681,370)
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	25,330	32,900.00	833,357,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PRF	47,200	27,310.00	1,289,032,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	44,210	15,230.00	673,318,300.00	
コロンビアペソ小計		116,740		2,795,707,300.00	(106,385,049)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	7,430	23.02	171,038.60	
	MYTILINEOS S.A.	10,680	35.20	375,936.00	
	OPAP SA	20,150	15.77	317,765.50	
	JUMBO SA	12,640	24.80	313,472.00	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	227,400	1.28	291,867.90	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	258,200	1.45	375,939.20	
	NATIONAL BANK OF GREECE	57,240	5.32	304,631.28	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	68,500	2.70	184,950.00	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,200	13.29	268,458.00	
	PUBLIC POWER CORP	21,300	9.50	202,350.00	
ユーロ小計		703,740		2,806,408.48	(442,767,065)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	98,350	141.30	13,896,855.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	151,667	41.00	6,218,347.00	
	HEKTAS TICARET T.A.S	144,300	23.02	3,321,786.00	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	91,200	27.34	2,493,408.00	
	SASA POLYESTER SANAYI	118,739	45.60	5,414,498.40	

	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	153,200	38.00	5,821,600.00	
	KOC HOLDING AS	73,684	134.60	9,917,866.40	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	152,600	51.10	7,797,860.00	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	4,350	755.00	3,284,250.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	57,000	223.30	12,728,100.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	7,470	826.20	6,171,714.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	12,000	277.80	3,333,600.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	46,160	270.00	12,463,200.00	
	AKBANK T.A.S.	336,489	29.60	9,960,074.40	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	95,700	55.55	5,316,135.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	383,412	22.50	8,626,770.00	
	YAPI VE KREDI BANKASI	361,000	16.51	5,960,110.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	116,756	53.40	6,234,770.40	
	トルコリラ小計	2,404,077		128,960,944.60 (708,085,858)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	8,160	671.00	5,475,360.00	
	MONETA MONEY BANK AS	39,000	84.80	3,307,200.00	
	CEZ AS	16,660	965.00	16,076,900.00	
	チェココルナ小計	63,820		24,859,460.00 (160,815,846)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	49,270	2,814.00	138,645,780.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,070	9,205.00	138,719,350.00	
	OTP BANK PLC	23,835	14,010.00	333,928,350.00	
	ハンガリーフォリント小計	88,175		611,293,480.00 (251,070,458)	
ポーランドズロチ	ORLEN SA	60,399	59.27	3,579,848.73	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	15,980	115.15	1,840,097.00	
	BUDIMEX	1,250	443.00	553,750.00	
	LPP SA	114	13,270.00	1,512,780.00	
	CD PROJEKT SA	6,650	153.00	1,017,450.00	
	CYFROWY POLSAT SA	25,030	13.21	330,646.30	
	ALLEGRO.EU SA	50,390	30.74	1,548,988.60	
	PEPCO GROUP NV	17,980	26.40	474,672.00	
	DINO POLSKA SA	5,040	376.30	1,896,552.00	
	BANK PEKAO SA	19,012	103.85	1,974,396.20	
	MBANK SA	1,620	400.60	648,972.00	
	PKO BANK POLSKI SA	88,655	35.63	3,158,777.65	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,390	372.20	1,261,758.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	60,580	41.17	2,494,078.60	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	86,630	7.76	672,941.84		
	ポーランドズロチ小計	442,720		22,965,708.92 (785,732,688)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	216,000	6.19	1,337,040.00	

CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	9.58	1,839,360.00
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,515,300	4.28	10,765,484.00
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	346,000	25.15	8,701,900.00
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	124,000	8.00	992,000.00
PETROCHINA CO LTD-H	2,145,000	5.81	12,462,450.00
YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	230,000	15.36	3,532,800.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	415,000	4.62	1,917,300.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	122,000	21.40	2,610,800.00
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	245,000	8.06	1,974,700.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	392,000	4.14	1,622,880.00
CHINA RESOURCES CEMENT	246,000	2.15	528,900.00
CMOC GROUP LTD-H	351,000	5.29	1,856,790.00
DONGYUE GROUP	161,000	5.86	943,460.00
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H	42,960	35.20	1,512,192.00
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	119,000	13.06	1,554,140.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	183,000	4.50	823,500.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	77,250	15.94	1,231,365.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	137,000	11.92	1,633,040.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	539,750	13.18	7,113,905.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	248,000	3.62	897,760.00
BOC AVIATION LTD	21,500	57.60	1,238,400.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	290,000	3.39	983,100.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	169,000	6.89	1,164,410.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	376,000	4.06	1,526,560.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	214,000	8.45	1,808,300.00
CITIC LTD	577,000	7.45	4,298,650.00
CRRG CORP LTD - H	401,000	3.77	1,511,770.00
FOSUN INTERNATIONAL LTD	241,000	4.76	1,147,160.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	69,000	16.60	1,145,400.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	126,000	12.00	1,512,000.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	67,000	14.88	996,960.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	196,400	10.72	2,105,408.00
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	63,600	27.10	1,723,560.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	396,518	2.84	1,126,111.12
AIR CHINA LTD-H	174,000	5.52	960,480.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	204,000	3.67	748,680.00
CHINA COSCO HOLDINGS-H	333,350	8.31	2,770,138.50
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	139,000	9.87	1,371,930.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	198,000	3.95	782,100.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	210,000	4.92	1,033,200.00
JD LOGISTICS INC	196,400	9.71	1,907,044.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	158,000	7.14	1,128,120.00
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	13,500	108.00	1,458,000.00

SHENZHEN INTL HOLDINGS	158,000	5.01	791,580.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	133,000	5.83	775,390.00
BYD CO LTD-H	107,000	244.40	26,150,800.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	312,000	3.03	945,360.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	78,400	37.25	2,920,400.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	627,000	9.48	5,943,960.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	273,500	9.30	2,543,550.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	390,845	3.90	1,524,295.50
LI AUTO INC-CLASS A	117,000	152.10	17,795,700.00
MINTH GROUP LTD	74,000	20.55	1,520,700.00
XPENG INC - CLASS A SHARES	107,900	68.10	7,347,990.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	132,000	15.58	2,056,560.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	127,200	89.20	11,346,240.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	446,000	3.29	1,467,340.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	237,600	24.20	5,749,920.00
LI NING CO LTD	252,500	34.60	8,736,500.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	86,300	69.05	5,959,015.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	148,500	7.39	1,097,415.00
EAST BUY HOLDING LTD	45,500	36.95	1,681,225.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	168,000	19.88	3,339,840.00
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	111,000	10.68	1,185,480.00
MEITUAN-CLASS B	526,485	119.20	62,757,012.00
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	158,900	43.90	6,975,710.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	125,600	17.32	2,175,392.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	94,000	14.36	1,349,840.00
TRIP.COM GROUP LTD	57,140	279.60	15,976,344.00
BAIDU INC-CLASS A	234,860	128.40	30,156,024.00
BILIBILI INC-CLASS Z	19,517	105.30	2,055,140.10
CHINA LITERATURE LTD	39,400	28.85	1,136,690.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	644,000	2.09	1,345,960.00
KINGSOFT CORP LTD	97,200	28.00	2,721,600.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	242,100	61.90	14,985,990.00
NETEASE INC	202,075	155.00	31,321,625.00
TENCENT HOLDINGS LTD	693,250	309.20	214,352,900.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,710,000	84.50	144,495,000.00
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	74,000	4.34	321,160.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	106.80	961,200.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	216,800	10.98	2,380,464.00
JD.COM INC - CL A	244,273	118.00	28,824,214.00
POP MART INTERNATIONAL GROUP	55,200	23.75	1,311,000.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	212,000	6.11	1,295,320.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	72,500	21.65	1,569,625.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	502,000	4.73	2,374,460.00

JD HEALTH INTERNATIONAL INC	116,700	41.35	4,825,545.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	67,200	18.34	1,232,448.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	10,200	135.50	1,382,100.00
CHINA FEIHE LTD	379,000	4.49	1,701,710.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	90,000	-	-
CHINA MENGNIU DAIRY CO	335,000	25.85	8,659,750.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	167,000	42.45	7,089,150.00
NONGFU SPRING CO LTD-H	179,800	44.15	7,938,170.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	184,000	7.11	1,308,240.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	202,000	10.56	2,133,120.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	62,000	63.20	3,918,400.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	126,000	5.53	696,780.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	517,000	5.14	2,657,380.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	55,000	13.24	728,200.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	64,500	26.45	1,706,025.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	37,000	18.00	666,000.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	37,400	42.75	1,598,850.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	100,700	12.44	1,252,708.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	263,600	7.06	1,861,016.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	82,600	12.44	1,027,544.00
SINOPHARM GROUP CO-H	138,000	22.65	3,125,700.00
3SBIO INC	216,500	6.82	1,476,530.00
AKESO INC - B	53,000	37.15	1,968,950.00
BEIGENE LTD	69,481	121.00	8,407,201.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	154,000	11.60	1,786,400.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	193,500	5.11	988,785.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	316,000	3.26	1,030,160.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	946,160	5.83	5,516,112.80
GENSCRIPT BIOTECH CORP	122,000	19.84	2,420,480.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	142,000	9.87	1,401,540.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	119,000	38.40	4,569,600.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	42,500	18.32	778,600.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,102,750	2.94	3,242,085.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	34,629	84.75	2,934,807.75
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	399,500	41.95	16,759,025.00
ZAI LAB LTD	100,550	19.74	1,984,857.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,891,000	2.85	8,239,350.00
BANK OF CHINA LTD - H	8,233,000	2.73	22,476,090.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	837,245	4.66	3,901,561.70
CHINA CITIC BANK - H	929,000	3.66	3,400,140.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	9,961,920	4.44	44,230,924.80
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	182,000	2.33	424,060.00
CHINA MERCHANTS BANK - H	387,650	32.00	12,404,800.00

CHINA MINSHENG BANKING-H	662,640	2.64	1,749,369.60
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,677,575	3.80	25,374,785.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	798,000	3.96	3,160,080.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	901,000	0.80	720,800.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	440,000	4.07	1,790,800.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	177,200	14.50	2,569,400.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	178,675	15.70	2,805,197.50
FAR EAST HORIZON LTD	165,000	5.87	968,550.00
GF SECURITIES CO LTD-H	101,000	10.78	1,088,780.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	237,200	4.80	1,138,560.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	127,000	10.24	1,300,480.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	743,000	12.20	9,064,600.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	266,400	19.06	5,077,584.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	154,740	8.27	1,279,699.80
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO-H	81,000	19.36	1,568,160.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	867,000	2.81	2,436,270.00
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	724,001	9.75	7,059,009.75
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	689,000	46.20	31,831,800.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	70,700	23.60	1,668,520.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	304,000	5.59	1,699,360.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	86,856	10.24	889,405.44
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	300,000	10.06	3,018,000.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	74,500	13.34	993,830.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	82,000	36.65	3,005,300.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	70,500	18.86	1,329,630.00
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	105,000	6.12	642,600.00
LENOVO GROUP LTD	766,000	7.92	6,066,720.00
SUNNY OPTICAL TECH	78,000	58.00	4,524,000.00
XIAOMI CORP-CLASS B	1,592,800	11.80	18,795,040.00
ZTE CORP-H	71,200	23.20	1,651,840.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	4,606,000	0.75	3,454,500.00
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	56,500	27.60	1,559,400.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	504,000	1.78	897,120.00
CGN POWER CO LTD-H	1,078,000	2.06	2,220,680.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	287,800	7.69	2,213,182.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	375,000	6.48	2,430,000.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	538,000	2.99	1,608,620.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	96,000	23.40	2,246,400.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	209,000	15.12	3,160,080.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	81,600	63.40	5,173,440.00
GUANGDONG INVEST	316,000	5.67	1,791,720.00
HUANENG POWER INTL INC-H	404,000	3.90	1,575,600.00
KUNLUN ENERGY CO LTD	398,000	6.76	2,690,480.00

	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	57,000	17.46	995,220.00	
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	2,126,000	1.33	2,827,580.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROU	240,000	-	-	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	60,000	19.32	1,159,200.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	522,000	5.79	3,022,380.00	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	73,000	19.58	1,429,340.00	
	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	702,000	1.07	751,140.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	409,820	16.00	6,557,120.00	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	135,000	8.78	1,185,300.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	337,777	32.35	10,927,085.95	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	72,000	33.75	2,430,000.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	209,526	8.84	1,852,209.84	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	226,000	8.30	1,875,800.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	125,500	8.42	1,056,710.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	203,000	15.24	3,093,720.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	189,200	9.42	1,782,264.00	
香港ドル小計		87,122,868		1,205,106,537.15 (22,872,922,075)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	357,700	2.16	772,632.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	30,600	23.20	709,920.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	306,400	7.30	2,236,720.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	401,400	4.90	1,966,860.00	
	GAMUDA BHD	228,700	4.41	1,008,567.00	
	SIME DARBY BERHAD	279,020	2.24	625,004.80	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	65,700	7.28	478,296.00	
	MISC BHD	135,900	7.11	966,249.00	
	GENTING BHD	218,900	4.28	936,892.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	315,400	2.56	807,424.00	
	MR DIY GROUP M BHD	419,750	1.50	629,625.00	
	IOI CORPORATION BERHAD	256,875	4.00	1,027,500.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	52,500	21.44	1,125,600.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,500	129.30	840,450.00	
	PPB GROUP BERHAD	63,980	15.64	1,000,647.20	
	QL RESOURCES BHD	114,500	5.47	626,315.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	213,120	4.46	950,515.20	
	IHH HEALTHCARE BHD	202,900	5.96	1,209,284.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	195,800	3.73	730,334.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	667,300	5.62	3,750,226.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	64,800	19.84	1,285,632.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	27,300	17.66	482,118.00	
	MALAYAN BANKING BHD	550,650	8.86	4,878,759.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	1,522,350	4.19	6,378,646.50	
	RHB BANK BHD	154,859	5.68	879,599.12	

	AXIATA GROUP BERHAD	296,400	2.49	738,036.00	
	CELCOMDIGI BHD	336,100	4.42	1,485,562.00	
	MAXIS BHD	235,400	4.05	953,370.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	110,200	5.03	554,306.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	79,600	17.16	1,365,936.00	
	TENAGA NASIONAL BERHAD	256,925	10.12	2,600,081.00	
	INARI AMERTRON BHD	324,900	2.89	938,961.00	
	マレーシアリングット小計	8,492,429		44,940,067.82 (1,420,766,762)	
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	883,700	7.65	6,760,305.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	146,610	165.50	24,263,955.00	
	PTT PCL-NVDR	1,013,300	33.25	33,692,225.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	138,100	48.25	6,663,325.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	196,800	26.25	5,166,000.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	221,145	33.50	7,408,357.50	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	130,900	39.00	5,105,100.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	81,200	303.00	24,603,600.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	429,100	69.75	29,929,725.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-NVDR	783,800	8.60	6,740,680.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	802,600	7.15	5,738,590.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	911,900	3.94	3,592,886.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	324,068	30.75	9,965,091.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	206,416	39.25	8,101,828.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	665,400	13.00	8,650,200.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	350,000	18.80	6,580,000.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	123,700	31.75	3,927,475.00	
	CP ALL PCL-NVDR	598,400	60.75	36,352,800.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	208,700	33.00	6,887,100.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	406,600	20.20	8,213,320.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	163,800	27.25	4,463,550.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,144,700	26.50	30,334,550.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	61,500	257.00	15,805,500.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	60,000	128.00	7,680,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	394,225	18.80	7,411,430.00	
	SCB X PCL-NVDR	85,100	110.00	9,361,000.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	2,342,000	1.70	3,981,400.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	130,400	45.75	5,965,800.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	76,900	38.25	2,941,425.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	319,500	106.00	33,867,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	121,600	221.00	26,873,600.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	99,900	73.50	7,342,650.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	1,002,720	7.55	7,570,536.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	83,500	31.00	2,588,500.00	

	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	30,400	125.50	3,815,200.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	177,200	56.00	9,923,200.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	64,900	47.25	3,066,525.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	314,990	45.75	14,410,792.50	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	101,850	32.00	3,259,200.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	214,800	65.25	14,015,700.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	917,700	8.05	7,387,485.00	
タイパーツ小計		16,530,124		470,407,606.00 (1,923,967,108)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	190,400	46.00	8,758,400.00	
	AYALA CORPORATION	30,452	610.00	18,575,720.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	300,345	35.05	10,527,092.25	
	SM INVESTMENTS CORP	23,993	789.50	18,942,473.50	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	101,830	204.00	20,773,320.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	47,540	225.20	10,706,008.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	90,460	113.00	10,221,980.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	194,990	107.00	20,863,930.00	
	BDO UNIBANK INC	242,125	127.80	30,943,575.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	188,237	52.55	9,891,854.35	
	PLDT INC	8,365	1,138.00	9,519,370.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	31,630	362.40	11,462,712.00	
	AYALA LAND INC	682,560	26.80	18,292,608.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,074,210	28.95	31,098,379.50	
フィリピンペソ小計		3,207,137		230,577,422.60 (602,591,036)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	1,485,200	2,960.00	4,396,192,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	160,000	28,500.00	4,560,000,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	899,300	1,860.00	1,672,698,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	3,096,796	1,445.00	4,474,870,220.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	283,000	10,925.00	3,091,775,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,356,873	3,260.00	4,423,405,980.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	347,712	6,875.00	2,390,520,000.00	
	VALE INDONESIA TBK PT	236,200	5,725.00	1,352,245,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,091,900	6,300.00	13,178,970,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	88,529,000	90.00	7,967,610,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	1,832,200	2,900.00	5,313,380,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	728,100	4,910.00	3,574,971,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	212,300	10,850.00	2,303,455,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAK TBK	452,600	6,800.00	3,077,680,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	753,000	3,630.00	2,733,390,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,187,700	1,750.00	3,828,475,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	5,753,500	9,150.00	52,644,525,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	3,857,500	6,075.00	23,434,312,500.00	

	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	7,065,200	5,375.00	37,975,450,000.00	
	PT BANK NEGARA INDONESIA	785,200	9,575.00	7,518,290,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,314,200	1,000.00	2,314,200,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,172,900	3,810.00	19,708,749,000.00	
	インドネシア小計	129,600,381		211,935,163,700.00 (2,055,771,087)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	4,950	67,600.00	334,620,000.00	
	S-OIL CORPORATION	4,835	78,900.00	381,481,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	5,767	164,400.00	948,094,800.00	
	SK INNOVATION CO LTD(N)	428	164,400.00	70,363,200.00	
	ECOPRO CO LTD	2,040	953,000.00	1,944,120,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	10,722	31,650.00	339,351,300.00	
	HYUNDAI STEEL CO	9,690	40,200.00	389,538,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	825	546,000.00	450,450,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,970	134,100.00	264,177,000.00	
	LG CHEM LTD	5,167	551,000.00	2,847,017,000.00	
	LG CHEM LTD-PRF	770	322,000.00	247,940,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	2,075	142,200.00	295,065,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	7,460	594,000.00	4,431,240,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,860	80,100.00	229,086,000.00	
	SKC CO LTD	2,170	81,600.00	177,072,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	5,610	55,700.00	312,477,000.00	
	DOOSAN ENERBILITY	45,250	17,060.00	771,965,000.00	
	ECOPRO BM CO LTD	5,084	290,500.00	1,476,902,000.00	
	GS HOLDINGS	4,395	40,350.00	177,338,250.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	3,510	109,400.00	383,994,000.00	
	HANWHA OCEAN CO LTD	4,180	35,050.00	146,509,000.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	2,190	127,300.00	278,787,000.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	4,417	120,000.00	530,040,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	7,560	37,400.00	282,744,000.00	
	HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,850	89,400.00	254,790,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,940	48,750.00	387,075,000.00	
	LG CORP	9,611	85,300.00	819,818,300.00	
	LG ENERGY SOLUTION	4,785	499,500.00	2,390,107,500.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	3,213	411,000.00	1,320,543,000.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	5,510	81,300.00	447,963,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	8,487	108,700.00	922,536,900.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	16,500	32,050.00	528,825,000.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	63,069	8,430.00	531,671,670.00	
	SK INC	3,741	152,600.00	570,876,600.00	
	SK SQUARE CO LTD	10,503	43,200.00	453,729,600.00	
	HMM CO LTD	25,940	17,210.00	446,427,400.00	
	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,870	184,500.00	345,015,000.00	

KOREAN AIR LINES CO LTD	19,324	22,650.00	437,688,600.00	
PAN OCEAN CO LTD	30,520	5,080.00	155,041,600.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	7,952	40,000.00	318,080,000.00	
HANON SYSTEMS	18,900	9,400.00	177,660,000.00	
HYUNDAI MOBIS	6,300	242,500.00	1,527,750,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	14,200	194,900.00	2,767,580,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,530	107,000.00	377,710,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	2,400	106,000.00	254,400,000.00	
KIA CORP	27,290	81,400.00	2,221,406,000.00	
COWAY CO LTD	5,640	42,900.00	241,956,000.00	
F&F CO LTD / NEW	2,060	116,300.00	239,578,000.00	
LG ELECTRONICS INC	10,905	103,400.00	1,127,577,000.00	
KANGWON LAND INC	10,810	15,830.00	171,122,300.00	
HYBE CO LTD	2,000	243,000.00	486,000,000.00	
JYP ENTERTAINMENT CORP	2,820	108,800.00	306,816,000.00	
KAKAO CORP	32,415	47,100.00	1,526,746,500.00	
KAKAO GAMES CORP	3,940	26,400.00	104,016,000.00	
KRAFTON INC	2,940	152,000.00	446,880,000.00	
NAVER CORP	13,545	217,500.00	2,946,037,500.00	
NCSOFT CORP	1,430	248,000.00	354,640,000.00	
NETMARBLE CORP	2,210	45,250.00	100,002,500.00	
PEARL ABYSS CORP	3,205	48,150.00	154,320,750.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	3,390	88,300.00	299,337,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	767	148,600.00	113,976,200.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	874	306,000.00	267,444,000.00	
KT&G CORP	10,815	90,200.00	975,513,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	2,326	124,700.00	290,052,200.00	
AMOREPACIFIC CORP	2,990	123,700.00	369,863,000.00	
LG H&H	955	457,500.00	436,912,500.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	10,812	64,200.00	694,130,400.00	
HLB INC	12,382	30,950.00	383,222,900.00	
CELLTRION INC	11,383	145,300.00	1,653,949,900.00	
CELLTRION PHARM INC	1,786	69,500.00	124,127,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	717	298,000.00	213,666,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,820	719,000.00	1,308,580,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,350	88,400.00	296,140,000.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,940	70,600.00	207,564,000.00	
YUHAN CORP	5,447	74,800.00	407,435,600.00	
HANA FINANCIAL GROUP	30,958	44,000.00	1,362,152,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	27,600	11,500.00	317,400,000.00	
KAKAObANK CORP	16,870	25,100.00	423,437,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	40,290	56,800.00	2,288,472,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	44,738	37,800.00	1,691,096,400.00	

	WOORI FINANCIAL GROUP INC	62,591	12,560.00	786,142,960.00	
	KAKAOPAY CORP	2,540	44,600.00	113,284,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,985	56,700.00	225,949,500.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	10,786	54,200.00	584,601,200.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	24,868	6,850.00	170,345,800.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,770	10,810.00	127,233,700.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6,807	38,500.00	262,069,500.00	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	4,850	93,200.00	452,020,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,200	265,500.00	849,600,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	8,005	72,000.00	576,360,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,980	136,300.00	542,474,000.00	
	COSMOAM&T CO LTD	2,280	162,700.00	370,956,000.00	
	COSMOAM&T CO LTD-RIGHTS(N)	119	39,900.00	4,748,100.00	
	L&F CO LTD	2,560	187,200.00	479,232,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	23,410	13,560.00	317,439,600.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,485	246,500.00	366,052,500.00	
	LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	2,500	44,000.00	110,000,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,865	142,200.00	834,003,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	496,460	69,600.00	34,553,616,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	85,570	56,100.00	4,800,477,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	5,743	563,000.00	3,233,309,000.00	
	KT CORP	6,330	32,900.00	208,257,000.00	
	LG UPLUS CORP.	21,900	10,430.00	228,417,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,740	18,290.00	489,074,600.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	4,320	49,700.00	214,704,000.00	
	SK HYNIX INC	56,810	118,000.00	6,703,580,000.00	
韓国ウォン小計		1,650,964		115,301,177,330.00 (12,821,490,919)	
台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	117,080	81.50	9,542,020.00	
	ASIA CEMENT CORP	227,978	40.05	9,130,518.90	
	CHINA STEEL CORP	1,231,181	26.50	32,626,296.50	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	360,047	64.80	23,331,045.60	
	FORMOSA PLASTICS CORP	396,424	82.40	32,665,337.60	
	NAN YA PLASTICS CORP	490,145	68.40	33,525,918.00	
	TAIWAN CEMENT	641,420	34.35	22,032,777.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	14,696	981.00	14,416,776.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	322,957	29.20	9,430,344.40	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	7,000	1,495.00	10,465,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	301,786	37.65	11,362,242.90	
	CHINA AIRLINES LTD	319,000	22.15	7,065,850.00	
	EVA AIRWAYS CORP	281,000	29.95	8,415,950.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	109,200	117.50	12,831,000.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	203,000	30.15	6,120,450.00	

WAN HAI LINES LTD	69,575	51.30	3,569,197.50
YANG MING MARINE TRANSPORT	194,000	46.30	8,982,200.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	211,947	43.40	9,198,499.80
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	20,254	500.00	10,127,000.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	50,927	195.00	9,930,765.00
GIANT MANUFACTURING	32,979	181.50	5,985,688.50
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	18,000	313.00	5,634,000.00
POU CHEN	226,145	29.05	6,569,512.25
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	31,620	670.00	21,185,400.00
MOMO.COM INC	8,500	501.00	4,258,500.00
MOMO.COM INC(N)	700	501.00	350,700.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	56,448	264.50	14,930,496.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	488,703	70.90	34,649,042.70
PHARMAESSENTIA CORP	27,000	342.00	9,234,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	534,348	17.45	9,324,372.60
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,808,746	24.85	44,947,338.10
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,447,229	24.35	35,240,026.15
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,125,910	27.00	30,399,570.00
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	928,004	20.90	19,395,283.60
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,160,330	37.85	43,918,490.50
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,119,297	17.60	19,699,627.20
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,177,195	18.00	21,189,510.00
TAIWAN BUSINESS BANK	622,000	13.45	8,365,900.00
TAIWAN BUSINESS BANK(N)	14,928	13.45	200,781.60
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,058,215	26.10	27,619,411.50
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	394,610	43.55	17,185,265.50
CHAILEASE HOLDING CO LTD	157,479	180.00	28,346,220.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,034,422	25.40	26,274,318.80
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO(N)	15,516	25.40	394,106.40
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	970,044	45.70	44,331,010.80
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,640,715	11.85	19,442,472.75
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	751,113	62.10	46,644,117.30
FUBON FINANCIAL HOLDING CO(N)	37,555	62.10	2,332,165.50
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	1,362,954	9.41	12,825,397.14
ACCTON TECHNOLOGY CORP	53,000	472.00	25,016,000.00
ACER INC	324,812	36.60	11,888,119.20
ADVANTECH CO LTD	47,984	342.50	16,434,520.00
ASUSTEK COMPUTER INC	73,797	360.50	26,603,818.50
AUO CORP	664,795	16.70	11,102,076.50
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	66,405	181.50	12,052,507.50
COMPAL ELECTRONICS	437,955	30.55	13,379,525.25
DELTA ELECTRONICS INC	201,541	330.50	66,609,300.50
E INK HOLDINGS INC	89,000	180.00	16,020,000.00

	GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	51,000	263.50	13,438,500.00
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,295,212	106.00	137,292,472.00
	INNOLUX CORP	891,803	13.65	12,173,110.95
	INVENTEC CORP	289,162	48.50	14,024,357.00
	LARGAN PRECISION CO LTD	10,286	2,095.00	21,549,170.00
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	209,787	120.00	25,174,440.00
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	68,000	175.50	11,934,000.00
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	23,000	260.50	5,991,500.00
	PEGATRON CORP	199,854	77.00	15,388,758.00
	QUANTA COMPUTER INC	279,416	218.50	61,052,396.00
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	142,120	63.90	9,081,468.00
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	145,000	183.50	26,607,500.00
	WISTRON CORP	271,000	98.70	26,747,700.00
	WIWYNN CORP	9,000	1,365.00	12,285,000.00
	WPG HOLDINGS LTD	175,520	59.60	10,460,992.00
	YAGEO CORPORATION	32,884	520.00	17,099,680.00
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	69,000	101.50	7,003,500.00
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	393,371	117.00	46,024,407.00
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	167,000	73.60	12,291,200.00
	TAIWAN MOBILE CO LTD	180,188	95.00	17,117,860.00
	ASE INDUSTRIAL HOLDING CO LT	317,387	114.50	36,340,811.50
	EEMORY TECHNOLOGY INC	7,100	2,120.00	15,052,000.00
	GLOBAL UNICHIP CORP	9,000	1,360.00	12,240,000.00
	GLOBALWAFERS CO LTD	23,200	472.50	10,962,000.00
	MEDIATEK INC	158,932	759.00	120,629,388.00
	NANYA TECHNOLOGY CORP	140,000	70.70	9,898,000.00
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	60,522	431.50	26,115,243.00
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	1,030.00	8,240,000.00
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	313,000	27.25	8,529,250.00
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	47,815	404.00	19,317,260.00
	SILERGY CORP	33,800	319.50	10,799,100.00
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,558,355	535.00	1,368,719,925.00
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,191,592	45.90	54,694,072.80
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	100,000	69.30	6,930,000.00
	WINBOND ELECTRONICS CORP	326,000	26.50	8,639,000.00
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	183,979	34.90	6,420,867.10
台湾ドル小計		36,160,896		3,271,012,709.89 (15,150,676,669)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	78,450	352.55	27,657,547.50
	COAL INDIA LTD	166,680	284.30	47,387,124.00
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	61,380	257.80	15,823,764.00
	INDIAN OIL CORP LTD	270,530	91.85	24,848,180.50
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	317,980	188.20	59,843,836.00

PETRONET LNG LTD	78,980	239.60	18,923,608.00
RELIANCE INDUSTRIES LTD	316,462	2,382.15	753,859,953.30
AMBUJA CEMENTS LIMITED	63,790	428.15	27,311,688.50
ASIAN PAINTS LTD	40,100	3,214.35	128,895,435.00
BERGER PAINTS INDIA LTD	28,450	747.10	21,254,995.00
GRASIM INDUSTRIES LTD	27,260	1,944.70	53,012,522.00
HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	128,490	478.30	61,456,767.00
JINDAL STEEL & POWER LTD	38,230	688.95	26,338,558.50
JSW STEEL LTD	63,540	786.75	49,990,095.00
PI INDUSTRIES LTD	7,770	3,501.50	27,206,655.00
PIDILITE INDUSTRIES LTD	16,120	2,499.20	40,287,104.00
SHREE CEMENT LTD	955	26,107.75	24,932,901.25
SRF LTD	15,610	2,319.85	36,212,858.50
SUPREME INDUSTRIES LTD	6,370	4,169.80	26,561,626.00
TATA STEEL LTD	768,370	128.30	98,581,871.00
ULTRATECH CEMENT LTD	11,730	8,458.15	99,214,099.50
UPL LTD	53,425	622.50	33,257,062.50
VEDANTA LTD	75,460	231.80	17,491,628.00
ABB INDIA LTD	5,240	4,329.05	22,684,222.00
ADANI ENTERPRISES LTD	18,040	2,470.30	44,564,212.00
ASHOK LEYLAND LTD	147,000	182.25	26,790,750.00
ASTRAL LTD	12,100	1,892.70	22,901,670.00
BHARAT ELECTRONICS LTD	390,900	136.90	53,514,210.00
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	63,350	431.60	27,341,860.00
CUMMINS INDIA LTD	13,850	1,728.35	23,937,647.50
HAVELLS INDIA LTD	25,550	1,413.20	36,107,260.00
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	8,290	3,992.60	33,098,654.00
LARSEN & TOUBRO LTD	71,030	2,890.00	205,276,700.00
SIEMENS LTD	8,940	3,774.10	33,740,454.00
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	26,000	678.55	17,642,300.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	54,163	818.05	44,308,042.15
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	29,942	742.20	22,222,952.40
INTERGLOBE AVIATION LTD	13,550	2,401.90	32,545,745.00
BAJAJ AUTO LTD	6,690	5,182.95	34,673,935.50
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	7,940	2,550.30	20,249,382.00
BHARAT FORGE LTD	27,720	1,128.25	31,275,090.00
EICHER MOTORS LTD	14,590	3,441.20	50,207,108.00
HERO MOTOCORP LTD	11,820	3,061.85	36,191,067.00
MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	97,080	1,634.00	158,628,720.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	14,100	10,346.75	145,889,175.00
MRF LTD	200	109,603.90	21,920,780.00
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	240,860	98.65	23,760,839.00
SONA BLW PRECISION FORGINGS	40,500	603.20	24,429,600.00

TATA MOTORS LTD	171,708	638.50	109,635,558.00
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	11,340	3,361.50	38,119,410.00
TVS MOTOR CO LTD	25,520	1,512.10	38,588,792.00
PAGE INDUSTRIES LTD	660	39,876.70	26,318,622.00
TITAN CO LTD	36,850	3,306.65	121,850,052.50
INDIAN HOTELS CO LTD	90,930	418.00	38,008,740.00
JUBILANT FOODWORKS LTD	44,490	533.80	23,748,762.00
ZOMATO LTD	428,800	100.00	42,880,000.00
INFO EDGE INDIA LTD	7,230	4,464.90	32,281,227.00
TRENT LTD	19,010	2,061.60	39,191,016.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	16,640	3,729.40	62,057,216.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	11,240	4,527.40	50,887,976.00
ITC LTD	306,355	452.95	138,763,497.25
MARICO LTD	55,700	574.50	31,999,650.00
NESTLE INDIA LIMITED	3,365	22,680.25	76,319,041.25
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	59,060	869.70	51,364,482.00
UNITED SPIRITS LTD	29,680	1,038.70	30,828,616.00
VARUN BEVERAGES LTD	45,800	904.65	41,432,970.00
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	12,900	2,000.65	25,808,385.00
DABUR INDIA LTD	65,930	561.15	36,996,619.50
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	41,565	990.10	41,153,506.50
HINDUSTAN UNILEVER LTD	85,360	2,466.85	210,570,316.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	10,250	5,006.30	51,314,575.00
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	79,360	554.15	43,977,344.00
AUROBINDO PHARMA LTD	27,210	890.00	24,216,900.00
CIPLA LTD	55,000	1,239.70	68,183,500.00
DIVI'S LABORATORIES LTD	12,840	3,779.60	48,530,064.00
DR. REDDY'S LABORATORIES	11,040	5,615.05	61,990,152.00
LUPIN LTD	20,890	1,149.55	24,014,099.50
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	99,554	1,153.15	114,800,695.10
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	10,420	1,884.15	19,632,843.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	17,810	755.45	13,454,564.50
AXIS BANK LTD	236,090	1,027.30	242,535,257.00
BANDHAN BANK LTD	74,240	244.95	18,185,088.00
BANK OF BARODA	100,500	213.45	21,451,725.00
HDFC BANK LIMITED	287,193	1,563.70	449,083,694.10
ICICI BANK LTD	535,787	987.15	528,902,137.05
IDFC FIRST BANK LTD	326,000	93.60	30,513,600.00
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	112,850	1,789.45	201,939,432.50
STATE BANK OF INDIA	183,320	601.10	110,193,652.00
YES BANK LTD	1,377,600	18.00	24,796,800.00
BAJAJ FINANCE LTD	28,330	7,539.00	213,579,870.00
BAJAJ FINSERV LTD	38,590	1,553.35	59,943,776.50

	BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	2,880	7,230.70	20,824,416.00
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	43,140	1,199.00	51,724,860.00
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	8,500	2,684.05	22,814,425.00
	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	315,502	229.65	72,455,034.30
	MUTHOOT FINANCE LTD	13,050	1,300.05	16,965,652.50
	POWER FINANCE CORPORATION	106,000	286.90	30,411,400.00
	REC LTD	119,000	254.30	30,261,700.00
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	31,920	811.20	25,893,504.00
	SHRIRAM FINANCE LTD	29,334	1,917.90	56,259,678.60
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	99,780	648.20	64,677,396.00
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	25,340	1,375.40	34,852,636.00
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	35,540	588.20	20,904,628.00
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	47,040	1,345.20	63,278,208.00
	HCL TECHNOLOGIES LTD	97,070	1,293.40	125,550,338.00
	INFOSYS LTD	345,188	1,490.25	514,416,417.00
	LTIMINDTREE LTD	8,991	5,473.45	49,211,788.95
	MPHASIS LTD	7,840	2,482.70	19,464,368.00
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	94,436	3,606.05	340,540,937.80
	TATA ELXSI LTD	3,480	7,301.90	25,410,612.00
	TECH MAHINDRA LTD	55,910	1,274.35	71,248,908.50
	WIPRO LTD	140,669	430.10	60,501,736.90
	BHARTI AIRTEL LTD	230,375	910.70	209,802,512.50
	ADANI GREEN ENERGY LTD	32,600	1,008.95	32,891,770.00
	ADANI POWER LTD	76,500	368.40	28,182,600.00
	GAIL INDIA LTD	234,863	123.55	29,017,323.65
	INDRAPRASTHA GAS LTD	30,240	463.60	14,019,264.00
	NTPC LIMITED	448,922	241.75	108,526,893.50
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	360,513	204.65	73,778,985.45
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD(N)	120,171	204.65	24,592,995.15
	TATA POWER CO LTD	150,180	262.00	39,347,160.00
	DLF LTD	63,670	522.35	33,258,024.50
	GODREJ PROPERTIES LTD	12,400	1,588.40	19,696,160.00
	インドルピー小計	12,591,628		8,925,078,814.15 (16,065,141,865)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	67,690	15.89	1,075,594.10
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	248,600	3.76	936,724.80
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	473,800	1.79	851,418.60
	INDUSTRIES QATAR	157,210	14.02	2,204,084.20
	COMMERCIAL BANK PQSC	342,480	5.60	1,918,230.48
	DUKHAN BANK	179,000	3.98	712,599.00
	MASRAF AL RAYAN	575,200	2.21	1,274,643.20
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	116,100	9.76	1,133,600.40
	QATAR ISLAMIC BANK	173,680	18.69	3,246,079.20

	QATAR NATIONAL BANK	475,640	15.18	7,220,215.20	
	OOREDOO QPSC	77,600	10.80	838,080.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	44,020	17.60	774,752.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	214,700	2.64	567,881.50	
カタールリアル小計		3,145,720		22,753,902.68	(928,359,229)
南アフリカランド	ANGLOGOLD ASHANTI PLC(N)	43,602	346.78	15,120,301.56	
	EXXARO RESOURCES LTD	24,980	182.85	4,567,593.00	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	13,240	176.55	2,337,522.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	6,660	730.62	4,865,929.20	
	GOLD FIELDS LTD	93,680	237.50	22,249,000.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	57,570	85.70	4,933,749.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	90,320	101.00	9,122,320.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	7,080	478.44	3,387,355.20	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	36,420	116.48	4,242,201.60	
	SASOL LTD	60,095	250.33	15,043,581.35	
	SIBANYE STILLWATER LTD	292,830	32.15	9,414,484.50	
	BIDVEST GROUP LTD	30,292	275.72	8,352,110.24	
	NASPERS LTD-N SHS	20,330	3,145.89	63,955,943.70	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	193,850	16.97	3,289,634.50	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	95,575	70.92	6,778,179.00	
	BID CORP LTD	34,799	436.91	15,204,031.09	
	CLICKS GROUP LTD	26,070	261.74	6,823,561.80	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	50,570	245.19	12,399,258.30	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	39,681	173.30	6,876,717.30	
	ABSA GROUP LTD	89,130	180.97	16,129,856.10	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	9,112	1,720.90	15,680,840.80	
	NEDBANK GROUP LTD	48,728	209.24	10,195,846.72	
	STANDARD BANK GROUP LTD	136,343	187.95	25,625,666.85	
	FIRSTRAND LTD	523,419	66.75	34,938,218.25	
	REINET INVESTMENTS SCA	13,180	409.91	5,402,613.80	
	REMGRO LTD	55,390	155.72	8,625,330.80	
DISCOVERY LTD	55,055	148.35	8,167,409.25		
OLD MUTUAL LTD	508,380	12.27	6,237,822.60		
OUTSURANCE GROUP LTD	97,200	43.52	4,230,144.00		
SANLAM LTD	181,761	68.90	12,523,332.90		
MTN GROUP LTD	177,442	117.89	20,918,637.38		
VODACOM GROUP LTD	62,895	109.59	6,892,663.05		
NEPI ROCKCASTLE N.V.	49,648	106.88	5,306,378.24		
南アフリカランド小計		3,225,327		399,838,234.08	(3,138,730,137)
アラブディルハム	MULTIPLY GROUP	402,100	4.05	1,628,505.00	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	250,000	4.12	1,030,000.00	

	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	322,900	3.79	1,223,791.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	297,404	8.68	2,581,466.72	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	150,050	10.36	1,554,518.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	316,633	5.71	1,807,974.43	
	EMIRATES NBD PJSC	190,070	18.50	3,516,295.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	457,801	13.50	6,180,313.50	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	363,731	20.40	7,420,112.40	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	418,950	5.44	2,279,088.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	687,050	7.49	5,146,004.50	
アラブディルハム小計		3,856,689		34,368,068.55 (1,391,219,414)	
クウェート・ ディナール	AGILITY	161,452	0.55	89,928.76	
	BOUBYAN BANK K.S.C	156,497	0.60	94,993.67	
	GULF BANK	231,575	0.26	60,209.50	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	831,967	0.73	614,823.61	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	778,899	0.91	713,471.48	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	218,400	0.50	109,855.20	
	MABANEE CO KPSC	67,685	0.83	56,449.29	
クウェート・ディナール小計		2,446,475		1,739,731.51 (837,593,735)	
香港・オフショ ア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	57,700	6.17	356,009.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	214,717	6.14	1,318,362.38	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	49,400	31.47	1,554,618.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	23,600	12.82	302,552.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	46,500	7.64	355,260.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	166,233	8.12	1,349,811.96	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	73,700	18.94	1,395,878.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	30,600	10.05	307,530.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	36,150	21.44	775,056.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	14,900	32.28	480,972.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	117,200	6.56	768,832.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	34,200	26.95	921,690.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	206,200	6.40	1,319,680.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	26,289	14.07	369,886.23	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	139,200	6.23	867,216.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH-A	38,100	21.84	832,104.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-A	16,100	45.35	730,135.00	
	GEM CO LTD-A	55,400	6.20	343,480.00	
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	16,600	27.95	463,970.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	50,954	14.78	753,100.12	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	7,400	60.96	451,104.00		
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	438,792	1.77	776,661.84		
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	66,500	4.20	279,300.00		

JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	58,800	11.65	685,020.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	20,600	20.02	412,412.00
LB GROUP CO LTD-A	14,800	18.63	275,724.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	67,500	14.19	957,825.00
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	50,000	17.36	868,000.00
RONGSHENG PETROCHEMICAL CO-A	77,800	12.15	945,270.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	27,244	26.07	710,251.08
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	15,340	33.08	507,447.20
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	145,000	3.22	466,900.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	17,545	30.81	540,561.45
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	30,700	7.09	217,663.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	13,500	55.31	746,685.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	14,600	15.14	221,044.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	22,500	91.72	2,063,700.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	8,320	26.50	220,480.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C-A	8,300	60.94	505,802.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	15,150	37.82	572,973.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	154,600	13.25	2,048,450.00
AECC AVIATION POWER CO-A	24,100	36.71	884,711.00
AVICOPTER PLC-A	9,400	37.46	352,124.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	12,200	30.48	371,856.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	40,900	27.75	1,134,975.00
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	308,200	2.25	693,450.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	48,800	7.69	375,272.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	185,000	6.70	1,239,500.00
CHINA STATE CONSTRUCTION-A	324,000	5.64	1,827,360.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	29,700	209.90	6,234,030.00
CRRC CORP LTD-A	231,200	5.83	1,347,896.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	21,700	16.03	347,851.00
EVE ENERGY CO LTD-A	17,383	45.02	782,582.66
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	60,060	5.79	347,747.40
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	3,500	70.90	248,150.00
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	43,900	9.15	401,685.00
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD-A	14,100	22.94	323,454.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	13,020	32.99	429,529.80
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,879	65.29	775,579.91
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	30,800	13.75	423,500.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	157,500	3.68	579,600.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	65,080	22.22	1,446,077.60
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	2,340	76.19	178,284.60
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	122,702	5.13	629,461.26
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	1,050	125.45	131,722.50
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	69,100	16.05	1,109,055.00

SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	87,700	2.82	247,314.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	121,700	4.68	569,556.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	12,576	67.82	852,904.32
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	13,100	86.62	1,134,722.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	12,200	15.20	185,440.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	2,560	120.88	309,452.80
TBEA CO LTD-A	51,350	14.42	740,467.00
WEICHAJ POWER CO LTD-A	57,500	12.23	703,225.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	70,000	6.61	462,700.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	20,100	23.34	469,134.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	49,000	6.88	337,120.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	5,400	37.41	202,014.00
AIR CHINA LTD-A	61,500	8.24	506,760.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	309,600	5.10	1,578,960.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	113,700	4.51	512,787.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	71,400	6.28	448,392.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	103,710	9.94	1,030,877.40
DAQIN RAILWAY CO LTD-A	135,800	7.34	996,772.00
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	231,600	1.48	342,768.00
S F HOLDING CO LTD-A	32,200	41.05	1,321,810.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	11,338	37.81	428,689.78
YUNDA HOLDING CO LTD-A	24,570	10.13	248,894.10
BYD CO LTD -A	12,800	244.00	3,123,200.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	2,300	149.50	343,850.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	65,482	12.87	842,753.34
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	6,300	38.27	241,101.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS-A	29,471	18.62	548,750.02
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	5,200	137.92	717,184.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC-A	11,800	17.83	210,394.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	7,700	72.57	558,789.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	64,200	14.98	961,716.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	12,500	21.19	264,875.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	18,100	36.60	662,460.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	53,100	24.11	1,280,241.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	9,400	27.70	260,380.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	3,780	98.15	371,007.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	6,493	49.23	319,650.39
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	7,000	38.16	267,120.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	17,320	12.39	214,594.80
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	17,300	20.60	356,380.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	22,700	8.59	194,993.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	128,100	7.25	928,725.00
KUNLUN TECH CO LTD-A	6,400	30.25	193,600.00

MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	17,400	26.81	466,494.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	15,300	12.71	194,463.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	58,200	4.81	279,942.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	12,500	109.60	1,370,000.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	32,200	7.53	242,466.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	67,900	4.79	325,241.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	7,170	35.45	254,176.50
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	3,200	278.01	889,632.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	4,500	53.15	239,175.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	5,000	74.17	370,850.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	52,000	6.96	361,920.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING-A	30,872	38.67	1,193,820.24
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	14,600	48.02	701,092.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	31,677	27.22	862,247.94
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	54,300	26.14	1,419,402.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	11,600	61.39	712,124.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	10,383	134.61	1,397,655.63
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	5,647	34.54	195,047.38
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	8,160	1,824.00	14,883,840.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,600	227.15	2,180,640.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	34,452	40.42	1,392,549.84
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	41,775	11.46	478,741.50
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	8,460	248.04	2,098,418.40
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	6,300	67.48	425,124.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	6,600	88.57	584,562.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO-A	43,080	17.50	753,900.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	25,500	159.84	4,075,920.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	13,300	35.17	467,761.00
BY-HEALTH CO LTD-A	25,500	19.10	487,050.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	66,176	17.84	1,180,579.84
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	13,100	31.03	406,493.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	3,700	62.62	231,694.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	10,000	34.33	343,300.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	29,303	10.71	313,835.13
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	16,073	16.15	259,578.95
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	23,271	6.93	161,268.03
OVCTEK CHINA INC-A	6,720	25.89	173,980.80
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	17,900	17.85	319,515.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	7,755	276.12	2,141,310.60
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	3,400	87.54	297,636.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	1,960	138.88	272,204.80
BEIJING TONGRENTANG CO-A	13,000	53.70	698,100.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	5,684	48.84	277,606.56

BGI GENOMICS CO LTD-A	3,300	53.04	175,032.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	3,300	135.13	445,929.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	9,700	48.16	467,152.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	19,200	47.94	920,448.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	3,400	64.92	220,728.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	20,930	21.79	456,064.70
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	1,300	405.50	527,150.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	47,673	44.35	2,114,297.55
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	21,091	12.66	267,012.06
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	10,350	28.09	290,731.50
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	24,000	17.84	428,160.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	20,700	28.24	584,568.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	65,500	6.88	450,640.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	9,280	28.80	267,264.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	14,800	23.86	353,128.00
WUXI APPTec CO LTD-A	19,488	80.19	1,562,742.72
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	12,740	54.02	688,214.80
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	4,900	269.48	1,320,452.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	11,620	16.70	194,054.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	24,480	16.33	399,758.40
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	672,600	3.58	2,407,908.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	199,923	4.64	927,642.72
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	38,000	14.10	535,800.00
BANK OF CHINA LTD-A	180,800	3.78	683,424.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	313,500	5.75	1,802,625.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	55,760	11.37	633,991.20
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	94,310	7.19	678,088.90
BANK OF NANJING CO LTD -A	79,112	8.02	634,478.24
BANK OF NINGBO CO LTD -A	45,407	28.29	1,284,564.03
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	134,327	6.19	831,484.13
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	47,700	6.24	297,648.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	439,900	3.10	1,363,690.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	154,410	32.73	5,053,839.30
CHINA MINSHENG BANKING-A	167,700	3.85	645,645.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	125,443	5.69	713,770.67
IND & COMM BK OF CHINA-A	384,100	4.69	1,801,429.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	152,821	16.22	2,478,756.62
PING AN BANK CO LTD-A	147,644	11.15	1,646,230.60
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	172,500	5.12	883,200.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	185,521	7.13	1,322,764.73
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	70,700	3.58	253,106.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	73,580	7.91	582,017.80
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	87,100	5.90	513,890.00

CHINA INTERNATIONAL CAPITAL-A	6,100	37.70	229,970.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	69,230	13.94	965,066.20
CITIC SECURITIES CO-A	94,970	21.90	2,079,843.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	41,000	24.68	1,011,880.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	43,500	8.27	359,745.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	123,866	15.25	1,888,956.50
EVERBRIGHT SECURITIE CO-A	30,800	16.72	514,976.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	55,200	5.92	326,784.00
GF SECURITIES CO LTD-A	46,700	14.81	691,627.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	59,317	9.28	550,461.76
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	69,188	14.69	1,016,371.72
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	68,900	6.90	475,410.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	88,200	10.00	882,000.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	4,400	142.67	627,748.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	68,100	16.48	1,122,288.00
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	41,400	8.37	346,518.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	68,640	6.44	442,041.60
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	60,160	9.74	585,958.40
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	220,000	4.35	957,000.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	79,937	8.34	666,674.58
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	88,900	4.18	371,602.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	55,200	6.68	368,736.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,800	10.10	442,380.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	22,867	36.67	838,532.89
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	53,312	29.33	1,563,640.96
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	15,000	37.60	564,000.00
PICC HOLDING CO-A	77,900	5.95	463,505.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	76,657	48.89	3,747,760.73
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	64,500	9.73	627,585.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,215	346.63	1,461,045.45
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	18,672	11.40	212,860.80
DHC SOFTWARE CO LTD -A	48,200	6.31	304,142.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	17,660	32.06	566,179.60
IFLYTEK CO LTD-A	17,400	46.50	809,100.00
NAVINFO CO LTD-A	30,300	10.05	304,515.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,800	93.47	355,186.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	22,916	44.65	1,023,199.40
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	31,571	16.60	524,078.60
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	320,712	3.79	1,215,498.48
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	23,100	10.45	241,395.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	67,100	18.40	1,234,640.00
GOERTEK INC -A	35,700	15.15	540,855.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	47,875	11.84	566,840.00

GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	36,300	10.61	385,143.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	13,336	34.93	465,826.48
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	41,100	11.72	481,692.00
LINGYI ITECH GUANGDONG CO-A	45,000	5.54	249,300.00
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	51,560	29.21	1,506,067.60
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	4,880	119.43	582,818.40
NINESTAR CORP-A	16,800	25.28	424,704.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,805	135.23	920,240.15
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	25,300	17.35	438,955.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	172,920	3.96	684,763.20
TIANMA MICROELECTRONICS-A	32,300	9.13	294,899.00
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	27,002	24.01	648,318.02
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	12,300	43.38	533,574.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	25,352	7.54	191,154.08
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	14,948	19.88	297,166.24
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	7,630	36.64	279,563.20
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	28,000	19.96	558,880.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	7,200	97.15	699,480.00
ZTE CORP-A	36,100	32.43	1,170,723.00
CHINA UNITED NETWORK-A	217,000	5.08	1,102,360.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	124,900	7.36	919,264.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	270,700	4.71	1,274,997.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	169,509	22.56	3,824,123.04
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	111,900	3.76	420,744.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	71,900	5.36	385,384.00
HUANENG POWER INTL INC-A	86,900	8.10	703,890.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	70,500	12.12	854,460.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	42,192	15.09	636,677.28
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	4,104	138.58	568,732.32
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	3,920	123.30	483,336.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	5,376	100.44	539,965.44
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	14,756	27.54	406,380.24
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	25,648	24.01	615,808.48
JINKO SOLAR CO LTD-A	63,000	9.83	619,290.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	54,235	25.74	1,396,008.90
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	4,400	233.98	1,029,512.00
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	47,200	15.51	732,072.00
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A	17,080	20.02	341,941.60
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	1,300	180.64	234,832.00
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	30,500	22.44	684,420.00
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	27,500	8.85	243,375.00
TONGWEI CO LTD-A	33,400	30.34	1,013,356.00
TRINA SOLAR CO LTD-A	16,250	29.44	478,400.00

	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,579	86.30	567,767.70
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	10,160	93.58	950,772.80
	XINJIANG DAQO NEW ENERGY C-A	16,830	40.10	674,883.00
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	13,500	49.80	672,300.00
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	61,077	12.76	779,342.52
	CHINA VANKE CO LTD -A	75,200	13.29	999,408.00
	GEMDALE CORP-A	20,500	7.10	145,550.00
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	84,753	13.20	1,118,739.60
	SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	15,000	13.60	204,000.00
	SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	76,498	4.30	328,941.40
香港・オフショア人民元小計		16,914,291		236,491,172.11 (4,796,584,900)
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	50,122	10.68	535,302.96
	SAUDI ARABIAN OIL CO	275,839	34.30	9,461,277.70
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	14,800	40.60	600,880.00
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	38,290	12.86	492,409.40
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	24,000	137.60	3,302,400.00
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	38,390	36.10	1,385,879.00
	SAUDI ARABIAN MINING CO	133,920	39.45	5,283,144.00
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	6,260	150.60	942,756.00
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	93,290	84.00	7,836,360.00
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	38,016	24.22	920,747.52
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	80,560	12.90	1,039,224.00
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	28,830	41.95	1,209,418.50
	SAUDI RESEARCH AND MARKETING	3,990	163.40	651,966.00
	JARIR MARKETING CO	62,840	14.60	917,464.00
	NAHDI MEDICAL CO	3,940	146.60	577,604.00
	ALMARAI CO	24,340	64.40	1,567,496.00
	SAVOLA	26,820	36.85	988,317.00
	DALLAH HEALTHCARE CO	3,130	140.20	438,826.00
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	8,950	232.60	2,081,770.00
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	10,060	101.40	1,020,084.00
	AL RAJHI BANK	203,782	69.00	14,060,958.00
	ALINMA BANK	101,660	34.25	3,481,855.00
	ARAB NATIONAL BANK	70,920	24.30	1,723,356.00
	BANK AL-JAZIRA	42,440	17.10	725,724.00
	BANK ALBILAD	49,936	40.50	2,022,408.00
	BANQUE SAUDI FRANSI	61,170	37.15	2,272,465.50
	RIYAD BANK	153,010	28.05	4,291,930.50
	SAUDI AWWAL BANK	103,950	34.20	3,555,090.00
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	52,710	16.00	843,360.00
	THE SAUDI NATIONAL BANK	306,275	33.45	10,244,898.75
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	4,860	191.60	931,176.00

BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	7,635	196.60	1,501,041.00	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	6,200	118.00	731,600.00	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	2,580	304.80	786,384.00	
ELM CO	2,380	719.20	1,711,696.00	
ETIHAD ETISALAT CO	38,960	44.40	1,729,824.00	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	47,250	13.00	614,250.00	
SAUDI TELECOM CO	203,965	38.15	7,781,264.75	
ACWA POWER CO	9,420	193.00	1,818,060.00	
POWER & WATER UTILITY CO FOR	7,330	62.00	454,460.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	83,220	19.46	1,619,461.20	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	57,980	15.78	914,924.40	
サウジアラビアリアル小計	2,584,020		105,069,513.18 (4,163,904,807)	
合計	702,660,251		102,083,507,534 (102,083,507,534)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
メキシコペソ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	299,900	8,466,177.00	
メキシコペソ小計			299,900	8,466,177.00 (73,406,834)	
インドルピー	社債券	BRITANNIA INDUSTRIES LTD-5.5%-24/06/03	368,880.00		
インドルピー小計			368,880.00	()	
南アフリカランド	投資証券	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	379,360	4,279,180.80	
南アフリカランド小計			379,360	4,279,180.80 (33,591,569)	
合計				106,998,403 (106,998,403)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入債券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 74銘柄	100.0%			3.1%
メキシコペソ	株式 22銘柄	97.1%			2.4%
	投資証券 1銘柄			2.9%	0.1%
ブラジルリアル	株式 48銘柄	100.0%			5.2%
チリペソ	株式 11銘柄	100.0%			0.4%
コロンビアペソ	株式 3銘柄	100.0%			0.1%
ユーロ	株式 10銘柄	100.0%			0.4%
トルコリラ	株式 18銘柄	100.0%			0.7%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%			0.2%

ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%			0.2%
ポーランドズロチ	株式	15銘柄	100.0%			0.8%
香港ドル	株式	189銘柄	100.0%			22.5%
マレーシアリンギット	株式	32銘柄	100.0%			1.4%
タイバーツ	株式	41銘柄	100.0%			1.9%
フィリピンペソ	株式	14銘柄	100.0%			0.6%
インドネシアルピア	株式	22銘柄	100.0%			2.0%
韓国ウォン	株式	106銘柄	100.0%			12.5%
台湾ドル	株式	94銘柄	100.0%			14.8%
インドルピー	株式	123銘柄	100.0%			15.7%
	社債券	1銘柄				
カタールリアル	株式	13銘柄	100.0%			0.9%
南アフリカランド	株式	33銘柄	98.9%			3.1%
	投資証券	1銘柄			1.1%	0.0%
アラブディルハム	株式	11銘柄	100.0%			1.4%
クウェート・ディナール	株式	7銘柄	100.0%			0.8%
香港・オフショア人民元	株式	291銘柄	100.0%			4.7%
サウジアラビアリアル	株式	42銘柄	100.0%			4.1%

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。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年 9月21日現在	2023年 9月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	97,066,906	279,675,539
コール・ローン	2,217,199,357	39,672,014
投資証券	53,049,241,120	56,095,902,116
派生商品評価勘定	5,496	15,164
未収入金	9,646,871	4,409,018
未収配当金	166,641,059	188,308,230
流動資産合計	55,539,800,809	56,607,982,081
資産合計	55,539,800,809	56,607,982,081
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	57,996
未払金	93,084,521	11,239,038
未払解約金	2,192,654,322	44,831,711
未払利息	3,015	36
流動負債合計	2,285,741,858	56,128,781
負債合計	2,285,741,858	56,128,781
純資産の部		
元本等		
元本	18,428,589,771	19,015,976,201

2022年 9月21日現在

2023年 9月21日現在

剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	34,825,469,180	37,535,877,099
元本等合計	53,254,058,951	56,551,853,300
純資産合計	53,254,058,951	56,551,853,300
負債純資産合計	55,539,800,809	56,607,982,081

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2022年 9月21日現在	2023年 9月21日現在
1.	期首	2021年 9月22日	2022年 9月22日
	期首元本額	28,868,868,987円	18,428,589,771円
	期首からの追加設定元本額	3,307,478,503円	6,400,522,675円
	期首からの一部解約元本額	13,747,757,719円	5,813,136,245円
	元本の内訳		
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,077,326,280円	2,212,293,483円
	インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）	10,631,291円	7,816,872円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	16,106,034,269円	16,560,623,741円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	- 円	9,002,707円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	- 円	867,019円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	- 円	476,969円
	海外先進国REITインデックスファンド（適格機関投資家向け）	234,597,931円	224,895,410円
	計	18,428,589,771円	19,015,976,201円
2.	受益権の総数	18,428,589,771口	19,015,976,201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 9月22日 至 2022年 9月21日	自 2022年 9月22日 至 2023年 9月21日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

	自 2021年 9月22日 至 2022年 9月21日	自 2022年 9月22日 至 2023年 9月21日
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、為替予約取引があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

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

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	522,055,775
合計	522,055,775

(2023年 9月21日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1,257,028,544
合計	1,257,028,544

(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 9月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,148,253	-	3,153,749	5,496
	韓国ウォン	3,148,253	-	3,153,749	5,496
合計		3,148,253	-	3,153,749	5,496

(2023年 9月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	32,908,020	-	32,950,852	42,832
	米ドル	5,912,000	-	5,936,236	24,236
	加ドル	12,090,870	-	12,107,018	16,148
	英ポンド	7,325,200	-	7,310,036	15,164
	シンガポールドル	7,579,950	-	7,597,562	17,612
合計		32,908,020	-	32,950,852	42,832

(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 9月21日現在		2023年 9月21日現在	
1口当たり純資産額	2.8898円	1口当たり純資産額	2.9739円
(1万口当たり純資産額)	(28,898円)	(1万口当たり純資産額)	(29,739円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	28,661	440,232.96	
		AGREE REALTY CORPORATION	29,225	1,716,092.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	21,994	378,076.86	
		ALEXANDER'S INC	617	123,091.50	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	47,004	5,275,728.96	

ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	4,274	71,803.20	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	14,639	297,464.48	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	96,084	3,445,572.24	
AMERICOLD REALTY TRUST INC	76,852	2,502,301.12	
APARTMENT INCOME REIT CO	45,111	1,467,460.83	
APARTMENT INVT&MGMT CO -A	40,822	290,652.64	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	63,892	1,009,493.60	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	19,895	222,824.00	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	8,742	23,078.88	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	42,912	7,839,164.16	
BOSTON PROPERTIES INC	43,620	2,859,727.20	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	17,457	47,832.18	
BRANDYWINE REALTY TRUST	52,533	258,462.36	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	90,599	2,010,391.81	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	56,823	907,463.31	
BRT APARTMENTS CORP	3,398	61,775.64	
CAMDEN PROPERTY TRUST	32,263	3,297,278.60	
CARETRUST REIT INC	30,246	619,740.54	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,546	160,427.96	
CENTERSPACE	4,468	273,888.40	
CHATHAM LODGING TRUST	14,483	139,616.12	
CITY OFFICE REIT INC	11,825	54,868.00	
CLIPPER REALTY INC	3,393	18,356.13	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	7,481	236,549.22	
COPT DEFENSE PROPERTIES	34,361	868,646.08	
COUSINS PROPERTIES INC	45,905	1,025,976.75	
CTO REALTY GROWTH INC	6,385	105,991.00	
CUBESMART	67,882	2,735,644.60	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	62,754	498,266.76	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	219,824	122,002.32	
DIGITAL REALTY TRUST INC	91,473	11,714,947.11	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	65,324	155,471.12	
DOUGLAS EMMETT INC	50,521	683,043.92	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	68,595.90	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	28,566	364,502.16	
EASTGROUP PROPERTIES INC	13,714	2,410,235.50	
ELME COMMUNITIES	26,672	391,544.96	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	38,903	332,620.65	
EPR PROPERTIES	22,868	977,835.68	
EQUINIX INC	28,268	21,418,946.28	
EQUITY COMMONWEALTH	33,973	633,936.18	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	56,355	3,811,852.20	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	104,239	6,506,598.38	

ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	47,010	1,103,794.80	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	19,405	4,344,197.35	
EXTRA SPACE STORAGE INC	63,815	8,138,965.10	
FARMLAND PARTNERS INC	13,317	140,494.35	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	22,162	2,162,567.96	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	39,965	2,036,616.40	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	27,521	664,081.73	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	26,426	49,680.88	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	79,346	3,847,487.54	
GETTY REALTY CORPORATION	14,108	417,596.80	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	12,252	158,908.44	
GLADSTONE LAND CORP	9,886	148,092.28	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	18,459	176,098.86	
GLOBAL NET LEASE INC	58,628	629,078.44	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	115,625	1,862,718.75	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	165,519	3,293,828.10	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9,863	97,347.81	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	31,976	728,733.04	
HOST HOTELS & RESORTS INC	214,863	3,480,780.60	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	38,883	264,793.23	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	67,712	1,046,150.40	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	18,055	61,387.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	8,471	718,001.96	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	20,353	507,196.76	
INVITATION HOMES INC	173,815	5,902,757.40	
IRON MOUNTAIN INC	88,150	5,593,117.50	
JBG SMITH PROPERTIES	28,529	424,796.81	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	219,100	48,202.00	
KILROY REALTY CORPORATION	32,240	1,143,552.80	
KIMCO REALTY CORP	187,037	3,450,832.65	
KITE REALTY GROUP TRUST	66,425	1,483,270.25	
LTC PROPERTIES INC	12,537	400,181.04	
LXP INDUSTRIAL TRUST	88,799	857,798.34	
MACERICH CO/THE	65,186	772,454.10	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	584,347	27,464.30	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	181,300	1,049,727.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	35,239	4,817,171.30	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	25,145	869,262.65	
NATL HEALTH INVESTORS INC	13,185	668,479.50	
NETSTREIT CORP	20,405	344,844.50	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	9,913	89,217.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL	6,746	232,804.46	
NNN REIT INC	55,199	2,106,393.84	

OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	15,503	86,816.80	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	74,102	2,486,122.10	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,565	88,926.20	
ORION OFFICE REIT INC	17,145	93,783.15	
PARAMOUNT GROUP INC	49,457	258,165.54	
PARK HOTELS & RESORTS INC	65,328	808,760.64	
PEAKSTONE REALTY TRUST	10,885	203,984.90	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	36,320	510,659.20	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	35,720	1,225,910.40	
PHYSICIANS REALTY TRUST	72,662	934,433.32	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	36,153	223,064.01	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	10,767	238,058.37	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	5,728	80,020.16	
PRIME US REIT	184,200	24,682.80	
PROLOGIS INC	279,054	33,740,419.14	
PUBLIC STORAGE	47,803	12,943,618.31	
REALTY INCOME CORP	214,293	11,528,963.40	
REGENCY CENTERS CORP	49,638	3,100,885.86	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	37,875	505,631.25	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	62,257	3,236,118.86	
RLJ LODGING TRUST	47,827	471,095.95	
RPT REALTY	23,731	262,464.86	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	18,059	1,537,001.49	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	70,293	977,072.70	
SAFEHOLD INC	13,393	260,493.85	
SAUL CENTERS INC	3,710	136,787.70	
SERVICE PROPERTIES TRUST	49,195	385,688.80	
SIMON PROPERTY GROUP INC	98,848	11,244,948.48	
SITE CENTERS CORP	54,164	711,714.96	
SL GREEN REALTY CORP	19,475	807,628.25	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	42,582	1,561,481.94	
STAG INDUSTRIAL INC	54,189	1,961,641.80	
STAR HOLDINGS	3,277	40,864.19	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	32,574	183,065.88	
SUN COMMUNITIES INC	37,596	4,742,735.40	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	61,666	561,160.60	
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	31,963	730,993.81	
TERRENO REALTY CORP	25,303	1,545,760.27	
UDR INC	91,696	3,478,029.28	
UMH PROPERTIES INC	17,827	256,708.80	
UNITI GROUP INC	71,822	364,137.54	
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	4,049	175,969.54	
URBAN EDGE PROPERTIES	35,578	581,700.30	

		VENTAS INC	121,688	5,351,838.24
		VERIS RESIDENTIAL INC	24,106	424,024.54
		VICI PROPERTIES INC	305,915	9,379,353.90
		VORNADO REALTY TRUST	48,380	1,219,176.00
		WELLTOWER INC	156,753	13,364,760.78
		WHITESTONE REIT	14,747	146,732.65
		WP CAREY INC	64,709	4,138,140.55
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	31,602	373,535.64
米ドル小計			8,438,635	296,932,731.57 (44,073,725,346)
加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	19,184	392,120.96
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,987	110,949.78
		BOARDWALK EQUITIES INC	6,694	465,835.46
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	5,270	86,849.60
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	10,240	32,870.40
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	25,044	1,222,147.20
		CHOICE PROPERTIES REIT	49,893	669,564.06
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,026	216,831.78
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	15,585	228,476.10
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	39,073	543,896.16
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,293	59,863.83
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	31,571	451,465.30
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	9,426	710,249.10
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	39,122	397,479.52
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	21,570	281,488.50
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	17,841	333,626.70
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,648	81,331.20
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	5,901	93,825.90
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	9,851	77,330.35
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	37,350	235,305.00
		PRIMARIS REIT	15,072	212,515.20
		PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	8,609	43,217.18
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	44,943	872,793.06
		SLATE GROCERY REIT	9,035	115,738.35
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	21,890	529,519.10
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	12,783	30,423.54
加ドル小計			498,901	8,495,713.33 (935,208,123)
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	14,460	819,882.00
		ALTAREA	1,428	132,375.60
		CARE PROPERTY INVEST	11,694	142,900.68
		CARMILA	16,603	242,403.80
		COFINIMMO	10,349	714,598.45

		COVIVIO	14,523	636,978.78
		CROMWELL REIT EUR	97,560	129,754.80
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	12,927	274,310.94
		GECINA SA	15,521	1,569,173.10
		HAMBORNER REIT AG	21,815	143,106.40
		ICADE	9,607	318,183.84
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	17,269	37,560.07
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	88,063	495,354.37
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	8,508	125,407.92
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	144,730	143,716.89
		KLEPIERRE	58,706	1,466,475.88
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	15,711	89,081.37
		MERCIALYS	28,370	246,960.85
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	101,766	835,498.86
		MONTEA	4,596	324,937.20
		NSI NV	5,548	102,638.00
		RETAIL ESTATES	3,761	208,359.40
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	30,580	1,486,188.00
		VASTNED RETAIL	5,691	110,860.68
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	48,689	1,188,011.60
		WERELDHAVE NV	12,267	188,666.46
		XIOR STUDENT HOUSING NV	8,631	241,236.45
			809,373	12,414,622.39 (1,958,654,974)
ユーロ小計				
英債券	投資証券	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	133,422	65,910.46
		AEW UK REIT PLC	47,825	47,920.65
		ASSURA PLC	902,963	410,486.97
		BALANCED COMM PROPERTY TRUST	212,634	146,717.46
		BIG YELLOW GROUP PLC	52,914	540,251.94
		BRITISH LAND COMPANY PLC	283,817	911,336.38
		CLS HOLDINGS PLC	40,564	50,786.12
		CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	142,434	118,647.52
		DERWENT LONDON PLC	33,952	649,501.76
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	178,296	164,032.32
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	75,679	321,181.67
		HAMMERSON PLC	1,162,768	291,854.76
		HELICAL PLC	33,388	74,121.36
		HOME REIT PLC	256,438	97,574.65
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	122,092	104,632.84
		INTU PROPERTIES PLC	758,746	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	226,024	1,370,609.53
		LIFE SCIENCE REIT PLC	110,213	79,132.93
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	296,462	524,737.74

		LXI REIT PLC	518,026	477,619.97	
		NEWRIVER REIT PLC	103,025	88,498.47	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	169,809	118,017.25	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	407,464	400,129.64	
		PRS REIT PLC/THE	163,652	113,738.14	
		REGIONAL REIT LTD	147,696	49,256.61	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	65,153	511,451.05	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	159,661	64,662.70	
		SEGRE PLC	369,626	2,776,630.51	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	593,025	702,734.62	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	376,076	296,347.88	
		TARGET HEALTHCARE REIT PLC	186,494	144,159.86	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	103,176	57,778.56	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	575,963	832,842.49	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	267,309	144,881.47	
		UNITE GROUP PLC	119,299	1,118,428.12	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	140,511	161,306.62	
		WAREHOUSE REIT PLC	121,094	100,871.30	
		WORKSPACE GROUP PLC	39,948	202,935.84	
英債券小計			9,697,638	14,331,728.16 (2,619,553,273)	
豪ドル	投資証券	ABACUS GROUP	142,410	148,106.40	
		ABACUS STORAGE KING	164,070	187,860.15	
		ARENA REIT	106,512	372,792.00	
		BWP TRUST	149,523	541,273.26	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	240,921	361,381.50	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	166,023	511,350.84	
		CENTURIA OFFICE REIT	145,435	179,612.22	
		CHARTER HALL GROUP	141,751	1,414,674.98	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	207,155	708,470.10	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	159,840	527,472.00	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	103,968	277,594.56	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	422,166	175,198.89	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	65,834	176,435.12	
		DEXUS/AU	329,174	2,393,094.98	
		GDI PROPERTY GROUP	181,454	101,614.24	
		GOODMAN GROUP	517,954	11,633,246.84	
		GPT GROUP	581,233	2,383,055.30	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	88,622	196,740.84	
		HEALTHCO REIT	147,704	228,941.20	
		HMC CAPITAL LTD	73,395	378,718.20	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	548,542	693,905.63	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	60,162	177,477.90	

		INGENIA COMMUNITIES GROUP	115,067	486,733.41	
		MIRVAC GROUP	1,204,346	2,649,561.20	
		NATIONAL STORAGE REIT	383,819	840,563.61	
		REGION RE LTD	353,044	737,861.96	
		RURAL FUNDS GROUP	122,187	233,988.10	
		SCENTRE GROUP	1,575,497	4,017,517.35	
		STOCKLAND	722,597	2,868,710.09	
		VICINITY CENTRES	1,179,390	2,052,138.60	
		WAYPOINT REIT	208,543	504,674.06	
豪ドル小計			10,608,338	38,160,765.53 (3,638,628,993)	
ニュー ジール ランド ドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	405,191	850,901.10	
ニュージールランドドル小計			405,191	850,901.10 (74,717,625)	
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	573,000	1,403,850.00	
		FORTUNE REIT	464,900	2,236,169.00	
		LINK REIT	773,680	29,245,104.00	
		PROSPERITY REIT	411,000	595,950.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	306,000	792,540.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	670,610	925,441.80	
香港ドル小計			3,199,190	35,199,054.80 (668,078,060)	
シンガ ポール ドル	投資証券	AIMS APAC REIT	215,817	278,403.93	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,079,832	3,045,126.24	
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	698,892	688,408.62	
		CAPITALAND CHINA TRUST	353,785	320,175.42	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,532,592	2,942,576.64	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	205,300	217,618.00	
		EC WORLD REIT	70,300	19,684.00	
		ESR-LOGOS REIT	1,843,219	571,397.89	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	319,100	201,033.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	335,205	744,155.10	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERC	879,060	975,756.60	
		KEPPEL DC REIT	413,277	905,076.63	
		KEPPEL REIT	600,100	534,089.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	534,452	299,293.12	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	630,608	1,450,398.40	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,007,587	1,733,049.64	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	699,731	1,056,593.81	
		PARAGON REIT	392,500	349,325.00	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	120,300	447,516.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	154,400	103,448.00	
STARHILL GLOBAL REIT	443,600	217,364.00			

		SUNTEC REIT	682,400	832,528.00	
シンガポールドル小計			13,212,057	17,933,017.04 (1,946,628,999)	
韓国ウォン	投資証券	D&D PLATFORM REIT CO LTD	16,715	53,905,875.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	49,349	184,071,770.00	
		JR REIT XXVII	51,594	211,793,370.00	
		KORAMCO LIFE INFRA REIT	16,399	91,670,410.00	
		LOTTE REIT CO LTD	39,257	132,688,660.00	
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,699	41,843,205.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	24,471	153,433,170.00	
		SK REITS CO LTD	27,429	118,081,845.00	
		SK REITS CO LTD-RIGHTS	10,314	10,314.00	
韓国ウォン小計			248,227	987,498,619.00 (109,809,846)	
イスラエルシュケル	投資証券	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	225,077	356,972.12	
		REIT 1 LTD	57,765	942,147.15	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	63,926	522,275.42	
イスラエルシュケル小計			346,768	1,821,394.69 (70,896,877)	
合計				56,095,902,116 (56,095,902,116)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 142銘柄	100.0%	78.5%
加ドル	投資証券 26銘柄	100.0%	1.7%
ユーロ	投資証券 27銘柄	100.0%	3.5%
英ポンド	投資証券 38銘柄	100.0%	4.7%
豪ドル	投資証券 31銘柄	100.0%	6.5%
ニュージーランドドル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	1.2%
シンガポールドル	投資証券 22銘柄	100.0%	3.5%
韓国ウォン	投資証券 9銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシュケル	投資証券 3銘柄	100.0%	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

日本リートインデックスJ - REITマザーファンド

貸借対照表

	2022年 9月21日現在	2023年 9月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	744,794,630	289,721,045
投資証券	59,653,937,700	59,654,725,500
未収配当金	579,364,210	644,133,189
流動資産合計	60,978,096,540	60,588,579,734
資産合計	60,978,096,540	60,588,579,734
負債の部		
流動負債		
未払金	-	79,934,800
未払解約金	478,707,044	50,000
未払利息	1,013	266
流動負債合計	478,708,057	79,985,066
負債合計	478,708,057	79,985,066
純資産の部		
元本等		
元本	22,912,181,985	23,621,589,137
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	37,587,206,498	36,887,005,531
元本等合計	60,499,388,483	60,508,594,668
純資産合計	60,499,388,483	60,508,594,668
負債純資産合計	60,978,096,540	60,588,579,734

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	2022年 9月21日現在	2023年 9月21日現在
1. 期首	2021年 9月22日	2022年 9月22日
期首元本額	29,585,033,053円	22,912,181,985円
期首からの追加設定元本額	2,732,116,718円	8,288,153,891円
期首からの一部解約元本額	9,404,967,786円	7,578,746,739円
元本の内訳		
世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,379,159,052円	2,506,221,464円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	1,389,497,593円	1,576,507,508円
インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	146,780,410円	153,846,157円
グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	18,690,339,580円	18,845,618,130円
財産3分法（適格機関投資家専用）	306,405,350円	536,287,671円
Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	- 円	826,926円
Ni つみインデック斯拉ップ世界10指数（均等型）	- 円	993,150円
Ni つみインデック斯拉ップ世界10指数（安定成長型）	- 円	272,710円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）奇数月分配型	- 円	1,015,421円
計	22,912,181,985円	23,621,589,137円
2. 受益権の総数	22,912,181,985口	23,621,589,137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 9月22日 至 2022年 9月21日	自 2022年 9月22日 至 2023年 9月21日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。当該有価証券の性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

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

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（2023年 9月21日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	7,502,510
合計	7,502,510

(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 9月21日現在		2023年 9月21日現在	
1口当たり純資産額	2.6405円	1口当たり純資産額	2.5616円
(1万口当たり純資産額)	(26,405円)	(1万口当たり純資産額)	(25,616円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	1,144	137,966,400	
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,802	167,586,000	
	S O S i L A物流リート投資法人 投資証券	2,807	354,524,100	
	東海道リート投資法人 投資証券	837	106,131,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,943	1,233,805,000	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	6,616	964,612,800	
	産業ファンド投資法人 投資証券	8,584	1,206,052,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,344	1,795,584,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	4,131	917,908,200	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,951	1,226,140,500	
	G L P投資法人 投資証券	19,005	2,554,272,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,767	914,493,500	
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	9,801	2,673,712,800	
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	1,038	667,434,000	
	O n eリート投資法人 投資証券	981	260,161,200	
	イオンリート投資法人 投資証券	6,902	1,013,213,600	
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,263	857,869,000	
	日本リート投資法人 投資証券	1,827	647,671,500	
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	16,906	1,430,247,600	
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	1,184	167,062,400	
	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	2,446	698,577,600	
	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	1,387	209,020,900	
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,533	179,054,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	18,194	3,096,618,800	
	いちごホテルリート投資法人 投資証券	932	108,391,600	
	ラサールロジポート投資法人 投資証券	7,192	1,050,032,000	
	スターアジア不動産投資法人 投資証券	8,671	508,120,600	
	マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	867	109,588,800	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,340	1,127,880,000	
	大江戸温泉リート投資法人 投資証券	860	54,954,000	
	投資法人みらい 投資証券	7,195	343,201,500	
	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,942	736,989,000	
	C R Eロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,422	402,052,000	
	ザイマックス・リート投資法人 投資証券	913	106,547,100	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	2,668	265,999,600		
アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	2,465	315,766,500		
日本ビルファンド投資法人 投資証券	6,563	3,990,304,000		
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	5,779	3,444,284,000		

日本都市ファンド投資法人 投資証券	26,968	2,613,199,200	
オリックス不動産投資法人 投資証券	11,210	1,997,622,000	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	3,848	1,412,216,000	
N T T都市開発リート投資法人 投資証券	5,408	748,467,200	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	3,772	702,723,600	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	4,155	496,107,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	12,585	1,994,722,500	
森トラストリート投資法人 投資証券	10,845	804,699,000	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	27,241	1,650,804,600	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,087	976,716,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	4,204	622,612,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	3,603	1,055,679,000	
福岡リート投資法人 投資証券	2,910	473,457,000	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	3,274	1,113,160,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	4,610	403,836,000	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,166	776,556,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	2,682	381,648,600	
スタートアップリート投資法人 投資証券	976	215,305,600	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	8,481	2,220,325,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	18,143	1,398,825,300	
大和証券リビング投資法人 投資証券	7,805	897,575,000	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	4,889	654,637,100	
合計	347,064	59,654,725,500	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

マネー・オープン・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2022年 9月21日現在	2023年 9月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	320,806,402	311,929,926
流動資産合計	320,806,402	311,929,926
資産合計	320,806,402	311,929,926
負債の部		
流動負債		
未払解約金	74,372	33,206
未払利息	436	287
流動負債合計	74,808	33,493
負債合計	74,808	33,493
純資産の部		
元本等		
元本	315,782,513	307,207,560
剰余金		

	2022年 9月21日現在	2023年 9月21日現在
剰余金又は欠損金()	4,949,081	4,688,873
元本等合計	320,731,594	311,896,433
純資産合計	320,731,594	311,896,433
負債純資産合計	320,806,402	311,929,926

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

	2022年 9月21日現在	2023年 9月21日現在
1. 期首	2021年 9月22日	2022年 9月22日
期首元本額	422,120,182円	315,782,513円
期首からの追加設定元本額	25,985,278円	12,154,222円
期首からの一部解約元本額	132,322,947円	20,729,175円
元本の内訳		
上場インデックスファンド中国A株(パンダ)E Fund CSI300	198,295円	198,295円
上場インデックスファンド海外債券(FTSE WGBI)毎月分配型	19,740円	19,740円
高金利先進国債券オープン(毎月分配型)	6,753,467円	5,732,863円
世界銀行債券ファンド(毎月分配型)	9,453,676円	9,000,074円
高金利先進国債券オープン(資産成長型)	582,564円	559,861円
資源ファンド(株式と通貨)ブラジルリアル・コース	7,904,694円	7,904,694円
資源ファンド(株式と通貨)南アフリカランド・コース	2,653,229円	2,566,967円
資源ファンド(株式と通貨)オーストラリアドル・コース	1,326,398円	1,173,799円
グローバル3倍3分法ファンド(1年決算型)	161,056,339円	161,056,339円
グローバル3倍3分法ファンド(隔月分配型)	78,638,884円	74,152,633円
グローバル3倍3分法(適格機関投資家専用)	4,986,437円	6,480,606円
グローバル3倍3分法オープン(適格機関投資家専用)	527,561円	460,487円
日興・GS 世界ソブリン・ファンド(毎月分配型)	7,148,340円	6,422,994円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(米ドルコース)	14,319,160円	13,900,917円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(円ヘッジコース)	2,592,879円	2,106,817円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド資産成長型(米ドルコース)	1,258,120円	1,162,010円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(ブラジルリアルコース)	2,342,442円	2,138,030円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(南アフリカランドコース)	476,875円	406,579円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(トルコリラコース)	11,397,645円	10,110,383円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(メキシコペソコース)	581,495円	635,181円
日興・世界ソブリン・ファンドVA(適格機関投資家転売制限付)	522,182円	445,981円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(インドネシアルピアコース)	234,936円	111,337円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(インドルピーコース)	807,155円	460,973円
計	315,782,513円	307,207,560円
2. 受益権の総数	315,782,513口	307,207,560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 9月22日 至 2022年 9月21日	自 2022年 9月22日 至 2023年 9月21日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

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

金融商品の時価等に関する事項

	2022年 9月21日現在	2023年 9月21日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 該当事項はありません。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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

(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 9月21日現在		2023年 9月21日現在	
1口当たり純資産額	1.0157円	1口当たり純資産額	1.0153円
(1万口当たり純資産額)	(10,157円)	(1万口当たり純資産額)	(10,153円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【中間財務諸表】

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2023年 9月22日から2024年 3月21日まで）の中間財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【グローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前計算期間末 2023年 9月21日現在	当中間計算期間末 2024年 3月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,991,707,143	2,712,340,467
投資信託受益証券	162,127,025,854	169,532,579,705
親投資信託受益証券	163,520,500	156,138,098
未収利息	-	5,696
流動資産合計	164,282,253,497	172,401,063,966
資産合計	164,282,253,497	172,401,063,966
負債の部		
流動負債		
未払解約金	669,546,454	1,147,339,392
未払受託者報酬	17,900,275	17,781,026
未払委託者報酬	304,305,652	302,278,489
未払利息	1,834	-
その他未払費用	12,690,704	8,009,457
流動負債合計	1,004,444,919	1,475,408,364
負債合計	1,004,444,919	1,475,408,364
純資産の部		
元本等		
元本	132,105,370,231	121,940,458,877
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	31,172,438,347	48,985,196,725
（分配準備積立金）	28,459,464,889	24,041,018,762
元本等合計	163,277,808,578	170,925,655,602
純資産合計	163,277,808,578	170,925,655,602
負債純資産合計	164,282,253,497	172,401,063,966

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	前中間計算期間 自 2022年 9月22日 至 2023年 3月21日	当中間計算期間 自 2023年 9月22日 至 2024年 3月21日
営業収益		
受取利息	-	5,742
有価証券売買等損益	5,606,024,059	21,296,668,856
営業収益合計	5,606,024,059	21,296,674,598
営業費用		
支払利息	410,507	71,017
受託者報酬	16,319,368	17,781,026
委託者報酬	277,430,366	302,278,489
その他費用	8,055,748	8,009,478
営業費用合計	302,215,989	328,140,010
営業利益又は営業損失（ ）	5,908,240,048	20,968,534,588
経常利益又は経常損失（ ）	5,908,240,048	20,968,534,588
中間純利益又は中間純損失（ ）	5,908,240,048	20,968,534,588
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	336,035,528	1,326,438,433
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	28,284,444,290	31,172,438,347
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,160,736,246	3,244,101,316
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,160,736,246	3,244,101,316
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,384,193,155	5,073,439,093
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,384,193,155	5,073,439,093
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	23,488,782,861	48,985,196,725

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

	前計算期間末 2023年 9月21日現在	当中間計算期間末 2024年 3月21日現在
1. 期首元本額	125,608,307,258円	132,105,370,231円
期中追加設定元本額	24,387,803,435円	11,284,146,183円
期中一部解約元本額	17,890,740,462円	21,449,057,537円
2. 受益権の総数	132,105,370,231口	121,940,458,877口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

前中間計算期間 自 2022年 9月22日 至 2023年 3月21日	当中間計算期間 自 2023年 9月22日 至 2024年 3月21日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	前計算期間末 2023年 9月21日現在	当中間計算期間末 2024年 3月21日現在
中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（１口当たり情報）

	前計算期間末 2023年 9月21日現在	当中間計算期間末 2024年 3月21日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2360円 (12,360円)	1.4017円 (14,017円)

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

また、当ファンドは、「マネー・オープン・マザーファンド」を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

（参考）

グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）

貸借対照表

（単位：円）

	2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	28,822,589,599	25,391,670,705
親投資信託受益証券	196,005,902,301	200,957,866,861

	2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
派生商品評価勘定	2,393,885,323	3,343,396,018
未収入金	-	6,370,461,084
未収利息	-	53,329
差入委託証拠金	22,420,352,401	20,603,249,042
流動資産合計	249,642,729,624	256,666,697,039
資産合計	249,642,729,624	256,666,697,039
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,532,489,412	1,141,102,443
前受金	561,412,100	409,452,900
未払解約金	990,938,631	1,249,084,761
未払受託者報酬	4,585,883	4,330,611
未払委託者報酬	13,757,683	12,991,862
未払利息	26,540	-
その他未払費用	40,126,109	20,064,765
流動負債合計	5,143,336,358	2,837,027,342
負債合計	5,143,336,358	2,837,027,342
純資産の部		
元本等		
元本	191,843,730,360	175,113,484,807
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	52,655,662,906	78,716,184,890
（分配準備積立金）	82,185,580,423	77,835,235,847
元本等合計	244,499,393,266	253,829,669,697
純資産合計	244,499,393,266	253,829,669,697
負債純資産合計	249,642,729,624	256,666,697,039

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。 (2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
1. 期首	2022年 9月22日	2023年 9月22日
期首元本額	187,095,112,660円	191,843,730,360円
期首からの追加設定元本額	9,328,932,566円	163,673,303円
期首からの一部解約元本額	4,580,314,866円	16,893,918,856円
2. 受益権の総数	191,843,730,360口	175,113,484,807口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2023年 9月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	49,800,947,900	-	50,142,860,000	341,912,100
合計		49,800,947,900	-	50,142,860,000	341,912,100

(2024年 3月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	50,174,607,100	-	51,707,885,000	1,533,277,900
合計		50,174,607,100	-	51,707,885,000	1,533,277,900

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

(債券関連)

(2023年 9月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	債券先物取引 買建	494,034,262,493	-	492,556,032,104	1,478,230,389
合計		494,034,262,493	-	492,556,032,104	1,478,230,389

(2024年 3月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	債券先物取引 買建	501,184,094,881	-	501,855,269,306	671,174,425
合計		501,184,094,881	-	501,855,269,306	671,174,425

(注) 1. 時価の算定方法

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

2. 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

また契約額等及び時価の邦貨換算は、本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

2023年 9月21日現在		2024年 3月21日現在	
1口当たり純資産額	1.2745円	1口当たり純資産額	1.4495円
(1万口当たり純資産額)	(12,745円)	(1万口当たり純資産額)	(14,495円)

「グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）」は、「海外株式インデックスMSCI-KOKUSA I（ヘッジなし）マザーファンド」「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド」「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」「日本リートインデックスJ-REITマザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSA I（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,483,073,228	435,698,245
コール・ローン	2,890,184,113	6,113,266,213
株式	305,150,776,278	377,705,836,381
投資証券	6,308,964,812	7,330,410,156
派生商品評価勘定	87,684,309	126,447,709
未収入金	24,350,925	29,741,531
未収配当金	400,666,095	563,457,804
未収利息	-	12,839
差入委託証拠金	602,968,536	703,273,061
流動資産合計	316,948,668,296	393,008,143,939
資産合計	316,948,668,296	393,008,143,939
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	57,887,155	5,871,068
未払金	1,332,127,146	2,412,990
未払解約金	139,683,190	3,200,576,027
未払利息	2,661	-
流動負債合計	1,529,700,152	3,208,860,085
負債合計	1,529,700,152	3,208,860,085
純資産の部		
元本等		
元本	60,966,207,275	62,886,732,117
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	254,452,760,869	326,912,551,737
元本等合計	315,418,968,144	389,799,283,854
純資産合計	315,418,968,144	389,799,283,854
負債純資産合計	316,948,668,296	393,008,143,939

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

<p>2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法</p> <p>3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項</p>	<p>適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p> <p>(2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p> <p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>
---	---

(貸借対照表に関する注記)

		2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
1.	期首	2022年 9月22日	2023年 9月22日
	期首元本額	59,219,776,408円	60,966,207,275円
	期首からの追加設定元本額	11,402,771,949円	5,170,083,364円
	期首からの一部解約元本額	9,656,341,082円	3,249,558,522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）	32,686,702,605円	34,592,038,250円
	DCインデックスバランス（株式20）	112,314,771円	106,705,674円
	DCインデックスバランス（株式40）	315,060,926円	301,753,969円
	DCインデックスバランス（株式60）	667,795,996円	664,495,304円
	DCインデックスバランス（株式80）	795,587,222円	830,805,689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	1,278,242,460円	1,092,536,918円
	日興五大陸株式ファンド	3,473,735,342円	3,380,657,029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）	12,531,422円	-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）	75,144,450円	68,073,225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）	5,847,060,347円	5,646,917,573円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	9,509,562,605円	8,281,596,132円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	7,031,464円	11,075,095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）	160,043,879円	1,963,934,281円
	Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）	275,281,577円	438,653,447円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	492,698円	360,886円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	136,530円	162,476円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,370,140,328円	1,167,220,894円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	15,805,283円	14,183,431円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	45,934,379円	42,259,679円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	73,703,056円	70,036,142円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	74,285,293円	71,839,999円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,169,614,642円	4,141,426,024円
	計	60,966,207,275円	62,886,732,117円
2.	受益権の総数	60,966,207,275口	62,886,732,117口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左

	2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
	(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。	(3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（2023年 9月21日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,986,988,850	-	3,937,416,310	49,572,540
合計		3,986,988,850	-	3,937,416,310	49,572,540

（2024年 3月21日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,883,632,188	-	4,939,742,600	56,110,412
合計		4,883,632,188	-	4,939,742,600	56,110,412

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

また契約額等及び時価の邦貨換算は、本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（通貨関連）

（2023年 9月21日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,179,726,786	-	3,259,096,480	79,369,694
	米ドル	2,680,099,830	-	2,757,046,960	76,947,130
	ユーロ	499,626,956	-	502,049,520	2,422,564
合計		3,179,726,786	-	3,259,096,480	79,369,694

（2024年 3月21日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	4,265,587,184	-	4,334,117,095	68,529,911
	米ドル	3,656,311,890	-	3,711,205,600	54,893,710
	ユーロ	609,275,294	-	622,911,495	13,636,201
	売建	581,871,104	-	585,934,786	4,063,682
	米ドル	456,506,000	-	459,773,115	3,267,115
	ユーロ	48,659,100	-	49,437,480	778,380
	スイスフラン	64,660,800	-	64,675,050	14,250
	シンガポールドル	12,045,204	-	12,049,141	3,937
	合計	4,847,458,288	-	4,920,051,881	64,466,229

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

2023年 9月21日現在		2024年 3月21日現在	
1口当たり純資産額	5.1737円	1口当たり純資産額	6.1984円
(1万口当たり純資産額)	(51,737円)	(1万口当たり純資産額)	(61,984円)

海外新興国株式インデックスMSCIEマージング(ヘッジなし)マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	450,838,687	211,048,638
コール・ローン	88,600,054	122,797,296
株式	102,083,507,534	114,361,919,295
投資証券	106,998,403	123,821,573
派生商品評価勘定	-	812,004
未収入金	17,171,096	2,142,948
未収配当金	194,672,169	288,419,990
未収利息	10,433	28,412
差入委託証拠金	5,350,236,983	6,629,733,970
流動資産合計	108,292,035,359	121,740,724,126
資産合計	108,292,035,359	121,740,724,126
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	49,629,055	58,705,792
未払金	9,429,038	-
未払解約金	6,085,140	3,358,653,031
未払利息	81	-

	2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
流動負債合計	65,143,314	3,417,358,823
負債合計	65,143,314	3,417,358,823
純資産の部		
元本等		
元本	44,072,759,067	44,064,572,182
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	64,154,132,978	74,258,793,121
元本等合計	108,226,892,045	118,323,365,303
純資産合計	108,226,892,045	118,323,365,303
負債純資産合計	108,292,035,359	121,740,724,126

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、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。 (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られた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
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)

	2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
1. 期首	2022年 9月22日	2023年 9月22日
期首元本額	42,339,806,937円	44,072,759,067円
期首からの追加設定元本額	14,406,225,342円	3,664,247,759円
期首からの一部解約元本額	12,673,273,212円	3,672,434,644円
元本の内訳		
日興五大陸株式ファンド	1,830,617,112円	1,919,085,738円
インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	18,876,081,407円	19,685,719,960円
インデックスファンド新興国株式（適格機関投資家向け）	3,177,686,494円	3,067,280,133円
グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	20,069,108,938円	18,734,603,444円
Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	1,874,412円	3,013,460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）	42,664,259円	534,237,883円
Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）	73,395,266円	119,439,352円
Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	1,042,114円	819,367円
Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	289,065円	372,845円
計	44,072,759,067円	44,064,572,182円
2. 受益権の総数	44,072,759,067口	44,064,572,182口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(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。	同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（2023年 9月21日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	6,084,151,637	-	6,034,522,582	49,629,055
	合計	6,084,151,637	-	6,034,522,582	49,629,055

（2024年 3月21日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,905,456,476	-	3,881,658,798	23,797,678
	合計	3,905,456,476	-	3,881,658,798	23,797,678

（注）1.時価の算定方法

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

また契約額等及び時価の邦貨換算は、本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（通貨関連）

（2023年 9月21日現在）

該当事項はありません。

（2024年 3月21日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	3,267,699,000 3,267,699,000	- -	3,301,795,110 3,301,795,110	34,096,110 34,096,110
	合計	3,267,699,000	-	3,301,795,110	34,096,110

（注）1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

2023年 9月21日現在		2024年 3月21日現在	
1口当たり純資産額	2,4556円	1口当たり純資産額	2,6852円
(1万口当たり純資産額)	(24,556円)	(1万口当たり純資産額)	(26,852円)

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
資産の部		
流動資産		
預金	279,675,539	401,362,083
コール・ローン	39,672,014	32,825,924
投資証券	56,095,902,116	56,700,288,283
派生商品評価勘定	15,164	-
未収入金	4,409,018	1,864,268
未収配当金	188,308,230	216,627,208
未収利息	-	68
流動資産合計	56,607,982,081	57,352,967,834
資産合計	56,607,982,081	57,352,967,834
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	57,996	-
未払金	11,239,038	-
未払解約金	44,831,711	3,347,102
未払利息	36	-
流動負債合計	56,128,781	3,347,102
負債合計	56,128,781	3,347,102
純資産の部		
元本等		
元本	19,015,976,201	17,572,804,829
剰余金		
剰余金又は欠損金()	37,535,877,099	39,776,815,903
元本等合計	56,551,853,300	57,349,620,732
純資産合計	56,551,853,300	57,349,620,732
負債純資産合計	56,607,982,081	57,352,967,834

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

(貸借対照表に関する注記)

		2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
1.	期首	2022年 9月22日	2023年 9月22日
	期首元本額	18,428,589,771円	19,015,976,201円
	期首からの追加設定元本額	6,400,522,675円	276,396,802円
	期首からの一部解約元本額	5,813,136,245円	1,719,568,174円
	元本の内訳		
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,212,293,483円	1,990,903,185円
	インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）	7,816,872円	- 円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	16,560,623,741円	15,349,636,391円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	9,002,707円	15,228,283円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	867,019円	675,040円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	476,969円	607,374円
	海外先進国REITインデックスファンド（適格機関投資家向け）	224,895,410円	215,754,556円
	計	19,015,976,201円	17,572,804,829円
2.	受益権の総数	19,015,976,201口	17,572,804,829口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(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)

(2023年 9月21日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	32,908,020	-	32,950,852	42,832
	米ドル	5,912,000	-	5,936,236	24,236

	加ドル	12,090,870	-	12,107,018	16,148
	英ポンド	7,325,200	-	7,310,036	15,164
	シンガポールドル	7,579,950	-	7,597,562	17,612
	合計	32,908,020	-	32,950,852	42,832

(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。

(2024年 3月21日現在)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年 9月21日現在		2024年 3月21日現在	
1口当たり純資産額	2.9739円	1口当たり純資産額	3.2635円
(1万口当たり純資産額)	(29,739円)	(1万口当たり純資産額)	(32,635円)

日本リートインデックスJ - REITマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	289,721,045	99,524,916
投資証券	59,654,725,500	61,158,103,800
未収配当金	644,133,189	716,087,993
未収利息	-	209
流動資産合計	60,588,579,734	61,973,716,918
資産合計	60,588,579,734	61,973,716,918
負債の部		
流動負債		
未払金	79,934,800	-
未払解約金	50,000	19,999,772
未払利息	266	-
流動負債合計	79,985,066	19,999,772
負債合計	79,985,066	19,999,772
純資産の部		
元本等		
元本	23,621,589,137	24,526,269,333
剰余金		
剰余金又は欠損金()	36,887,005,531	37,427,447,813
元本等合計	60,508,594,668	61,953,717,146
純資産合計	60,508,594,668	61,953,717,146
負債純資産合計	60,588,579,734	61,973,716,918

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
1.	期首	2022年 9月22日	2023年 9月22日
	期首元本額	22,912,181,985円	23,621,589,137円
	期首からの追加設定元本額	8,288,153,891円	2,326,400,023円
	期首からの一部解約元本額	7,578,746,739円	1,421,719,827円
	元本の内訳		
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,506,221,464円	2,488,233,690円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	1,576,507,508円	1,678,063,999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）	153,846,157円	158,353,864円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	18,845,618,130円	19,487,539,932円
	財産3分法（適格機関投資家専用）	536,287,671円	680,660,944円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	826,926円	1,392,135円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	993,150円	912,964円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	272,710円	413,421円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）奇数月分配型	1,015,421円	30,698,384円
	計	23,621,589,137円	24,526,269,333円
2.	受益権の総数	23,621,589,137口	24,526,269,333口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2) 上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	<p>(1) 有価証券 同左</p> <p>(2) 上記以外の金融商品 同左</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（1口当たり情報）

2023年 9月21日現在		2024年 3月21日現在	
1口当たり純資産額	2.5616円	1口当たり純資産額	2.5260円
(1万口当たり純資産額)	(25,616円)	(1万口当たり純資産額)	(25,260円)

マネー・オープン・マザーファンド

貸借対照表

	2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	311,929,926	294,806,443
未収利息	-	619
流動資産合計	311,929,926	294,807,062
資産合計	311,929,926	294,807,062
負債の部		
流動負債		
未払解約金	33,206	-
未払利息	287	-
流動負債合計	33,493	-
負債合計	33,493	-
純資産の部		
元本等		
元本	307,207,560	290,385,224
剰余金		
剰余金又は欠損金()	4,688,873	4,421,838
元本等合計	311,896,433	294,807,062
純資産合計	311,896,433	294,807,062
負債純資産合計	311,929,926	294,807,062

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
1. 期首	2022年 9月22日	2023年 9月22日
期首元本額	315,782,513円	307,207,560円
期首からの追加設定元本額	12,154,222円	3,639,652円
期首からの一部解約元本額	20,729,175円	20,461,988円
元本の内訳		
上場インデックスファンド中国A株(パンダ)E Fund CSI300	198,295円	198,295円
上場インデックスファンド海外債券(F T S E W G B I)毎月分配型	19,740円	19,740円
高金利先進国債券オープン(毎月分配型)	5,732,863円	5,419,962円
世界銀行債券ファンド(毎月分配型)	9,000,074円	9,000,074円
高金利先進国債券オープン(資産成長型)	559,861円	536,966円
資源ファンド(株式と通貨)ブラジルリアル・コース	7,904,694円	7,904,694円
資源ファンド(株式と通貨)南アフリカランド・コース	2,566,967円	2,395,279円
資源ファンド(株式と通貨)オーストラリアドル・コース	1,173,799円	995,744円
グローバル3倍3分法ファンド(1年決算型)	161,056,339円	153,800,333円
グローバル3倍3分法ファンド(隔月分配型)	74,152,633円	68,175,020円
グローバル3倍3分法(適格機関投資家専用)	6,480,606円	6,355,298円
グローバル3倍3分法オープン(適格機関投資家専用)	460,487円	469,797円
日興・GS 世界ソブリン・ファンド(毎月分配型)	6,422,994円	6,301,804円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(米ドルコース)	13,900,917円	14,330,614円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(円ヘッジコース)	2,106,817円	2,045,178円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド資産成長型(米ドルコース)	1,162,010円	- 円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(ブラジルリアルコース)	2,138,030円	2,187,464円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(南アフリカランドコース)	406,579円	- 円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(トルコリラコース)	10,110,383円	9,797,994円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分配型(メキシコペソコース)	635,181円	- 円
日興・世界ソブリン・ファンド V A (適格機関投資家販売制限付)	445,981円	450,968円

日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分 配型（インドネシアルピアコース）	111,337円	- 円
日興ピムコ・ハイインカム・ソブリン・ファンド毎月分 配型（インドルビーコース）	460,973円	- 円
計	307,207,560円	290,385,224円
2. 受益権の総数	307,207,560口	290,385,224口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 該当事項はありません。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（1口当たり情報）

	2023年 9月21日現在	2024年 3月21日現在
1口当たり純資産額	1.0153円	1.0152円
(1万口当たり純資産額)	(10,153円)	(10,152円)

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2024年 3月29日現在です。

【グローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）】

【純資産額計算書】

資産総額	174,480,676,427円
負債総額	1,553,698,460円
純資産総額（ - ）	172,926,977,967円
発行済口数	121,010,313,865口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4290円

（参考）

グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）

純資産額計算書

資産総額	257,937,199,750円
負債総額	195,238,172円
純資産総額（ - ）	257,741,961,578円
発行済口数	174,379,496,224口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4781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	395,202,727,508円
負債総額	74,601,668円
純資産総額（ - ）	395,128,125,840円
発行済口数	63,166,889,916口
1口当たり純資産額（ / ）	6.2553円

海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	119,736,777,689円
負債総額	30,499,703円
純資産総額（ - ）	119,706,277,986円
発行済口数	44,159,500,721口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7108円

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	58,701,604,431円
------	-----------------

負債総額	15,426,343円
純資産総額（ - ）	58,686,178,088円
発行済口数	17,572,568,085口
1口当たり純資産額（ / ）	3.3396円

日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	61,788,844,632円
負債総額	24,140,348円
純資産総額（ - ）	61,764,704,284円
発行済口数	24,487,990,757口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5222円

マネー・オープン・マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	294,791,132円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	294,791,132円
発行済口数	290,364,545口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0152円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2024年3月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2024年3月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

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

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

・監査等委員会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（2024年3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、2024年3月末現在の投資信託などは次の通りです。

種類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	802	311,686
株式投資信託	756	271,707
単位型	291	9,045
追加型	465	262,662
公社債投資信託	46	39,979
単位型	33	996
追加型	13	38,983

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)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		42,427		42,036
有価証券		170		1,025
前払費用		932		908
未収入金		96	4	410
未収委託者報酬		25,193		21,336
未収収益	3	1,048	3	589
関係会社短期貸付金		5,005		3,318
立替金		1,056		1,015
その他	2	998	2	1,233
流動資産合計		76,928		71,875
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	244	1	245
器具備品	1	153	1	122
有形固定資産合計		397		367
無形固定資産				
ソフトウェア		335		390
無形固定資産合計		335		390
投資その他の資産				
投資有価証券		23,969		23,274
関係会社株式		22,366		22,366
長期差入保証金		652		375
繰延税金資産		3,678		448
投資その他の資産合計		50,667		46,465
固定資産合計		51,399		47,224
資産合計		128,328		119,099

(単位：百万円)

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

未払収益分配金		7		7
未払償還金		71		71
未払手数料		8,783		6,586
その他未払金		831		892
未払費用	3	5,572	3	4,227
未払法人税等		2,354		-
未払消費税等	4	3,669		-
賞与引当金		3,958		2,563
役員賞与引当金		5		218
訴訟損失引当金		7,847		-
その他		1,330		647
流動負債合計		35,083		15,648
固定負債				
退職給付引当金		1,395		1,424
賞与引当金		423		437
役員賞与引当金		-		16
その他		390		181
固定負債合計		2,209		2,059
負債合計		37,292		17,708
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		68,901		79,307
利益剰余金合計		68,901		79,307
自己株式		2,067		2,067
株主資本合計		89,417		99,823
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		2,350		2,056
繰延ヘッジ損益		731		488
評価・換算差額等合計		1,618		1,567
純資産合計		91,035		101,391
負債純資産合計		128,328		119,099

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	94,938	73,998
その他営業収益	4,743	3,479
営業収益合計	99,682	77,477
営業費用		
支払手数料	42,026	30,699
広告宣伝費	987	755
公告費	1	3

調査費	23,000	17,479
調査費	1,042	1,170
委託調査費	21,932	16,282
図書費	25	26
委託計算費	598	581
営業雑経費	1,014	948
通信費	143	139
印刷費	308	309
協会費	52	56
諸会費	13	16
その他	494	427
営業費用計	67,628	50,469
一般管理費		
給料	11,759	9,818
役員報酬	156	314
役員賞与引当金繰入額	5	234
給料・手当	7,229	6,544
賞与	143	147
賞与引当金繰入額	4,225	2,577
交際費	22	56
寄付金	29	24
旅費交通費	66	205
租税公課	429	433
不動産賃借料	937	938
退職給付費用	394	383
退職金	169	155
固定資産減価償却費	172	183
福利費	1,171	1,097
諸経費	3,888	4,291
一般管理費計	19,042	17,588
営業利益	13,010	9,420

(単位：百万円)

	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		71		107
受取配当金	1	5,257	1	9,255
時効成立分配金・償還金		1		1
為替差益		1,548		-
その他		58		236
営業外収益合計		6,936		9,601
営業外費用				
支払利息		177		407
デリバティブ費用		49		389
有価証券償還損		-		6
時効成立後支払分配金・償還金		9		1
為替差損		-		342
その他		39		15
営業外費用合計		275		1,163
経常利益		19,672		17,858
特別利益				

投資有価証券売却益		253		427
子会社有償減資払戻益		1,445		-
訴訟損失引当金戻入額		-	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 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	68,901	68,901	2,067	89,417
当期変動額							
剰余金の配当				7,420	7,420		7,420
当期純利益				17,826	17,826		17,826
自己株式の取得							
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	10,406	10,406	-	10,406
当期末残高	17,363	5,220	5,220	79,307	79,307	2,067	99,823

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	2,350	731	1,618	91,035
当期変動額				
剰余金の配当				7,420
当期純利益				17,826
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	294	242	51	51
当期変動額合計	294	242	51	10,355
当期末残高	2,056	488	1,567	101,391

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券 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あります。</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あります。</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>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>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・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。さらに、外貨建ての貸付金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額 (*4)			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			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
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	-	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、市場の活発性に基つき、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				
	売建				
	米ドル	投資有価証券	5,445	-	367
	豪ドル		222	-	20
	香港ドル		1,097	-	59
	人民元		5,185	-	324
	ユーロ		35	-	0
	合計		11,986	-	772

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第64期(2023年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

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

(退職給付関係)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

退職給付引当金	1,395
貸借対照表に計上された負債の額	1,395

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

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

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

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

2 確定給付制度

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

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

退職給付引当金	1,424
貸借対照表に計上された負債の額	1,424

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

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

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

(ストックオプション等関係)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ス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

	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。）当権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2018年7月15日から2026年7月31日まで	2019年4月27日から2027年4月30日まで

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

（注） 株式数に換算して記載しております。

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

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

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

失効	-
権利未行使残	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

(注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。

2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 344百万円

(税効果会計関係)

第63期 (2022年3月31日)	第64期 (2023年3月31日)
1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生主な原因別の内訳 (単位：百万円)	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生主な原因別の内訳 (単位：百万円)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 1,341	賞与引当金 918
投資有価証券評価損 97	投資有価証券評価損 97
関係会社株式評価損 52	関係会社株式評価損 52
退職給付引当金 427	退職給付引当金 436
固定資産減価償却費 87	固定資産減価償却費 83
繰延ヘッジ損益 322	繰延ヘッジ損益 215
訴訟損失引当金 2,403	その他 672
その他 1,039	繰延税金資産小計 2,478
繰延税金資産小計 5,772	評価性引当金 52
評価性引当金(注) 52	繰延税金資産合計 2,425
繰延税金資産合計 5,719	
	繰延税金負債
繰延税金負債	その他有価証券評価差額金 1,028
その他有価証券評価差額金 1,092	その他 948
その他 948	繰延税金負債合計 1,977
繰延税金負債合計 2,041	繰延税金資産の純額 448
繰延税金資産の純額 3,678	

(注)関係会社株式評価損に係る繰延税金資産から控除した評価性引当金が、在外子会社の減資により1,377百万円減少しております。

2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳
法定実効税率 30.6%	法定実効税率 30.6%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 0.1%	交際費等永久に損金に算入されない項目 1.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 10.9%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 12.0%
評価性引当金の減少 10.3%	その他 0.8%
その他 0.1%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 20.5%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 9.4%	

(関連当事者情報)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
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、記載していません。

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、記載していません。

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、記載を省略していません。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

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、記載を省略していません。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載していません。

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业務の内容及び当該履行业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	-	2,500	-	2,500
有価証券	-	-	-	-
其他有価証券	-	-	-	-
投資信託	6,821	17,357	-	24,178
資産計	6,821	19,857	-	26,678
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おりません。

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第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
アイザワ証券株式会社	3,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
あかつき証券株式会社	3,067百万円	
今村証券株式会社	857百万円	
岩井コスモ証券株式会社	13,500百万円	
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
F F G 証券株式会社	3,000百万円	
O K B 証券株式会社	1,500百万円	
岡三証券株式会社	5,000百万円	
九州 F G 証券株式会社	3,000百万円	
四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	
静銀ティーエム証券株式会社	3,000百万円	
七十七証券株式会社	3,000百万円	
株式会社証券ジャパン	3,000百万円	
第四北越証券株式会社	600百万円	
ちばぎん証券株式会社	4,374百万円	
中銀証券株式会社	2,000百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
とうほう証券株式会社	3,000百万円	

南都まほろば証券株式会社	2	3,000百万円
野村證券株式会社	1	10,000百万円
八十二証券株式会社		3,000百万円
浜銀ＴＴ証券株式会社		3,307百万円
PWM日本証券株式会社		3,000百万円 (2022年12月末現在)
百五証券株式会社		3,000百万円
ひろぎん証券株式会社		5,000百万円
フィデリティ証券株式会社		11,757百万円 (2022年12月末現在)
ほくほくＴＴ証券株式会社		1,250百万円
北洋証券株式会社		3,000百万円
松井証券株式会社		11,945百万円
マネックス証券株式会社		12,200百万円
丸八証券株式会社		3,751百万円
水戸証券株式会社		12,272百万円
楽天証券株式会社		19,495百万円
ワイエム証券株式会社		1,270百万円
株式会社愛知銀行		18,000百万円
株式会社秋田銀行		14,100百万円
株式会社足利銀行		135,000百万円
株式会社伊予銀行		20,948百万円
株式会社岩手銀行		12,089百万円
株式会社愛媛銀行		21,367百万円
株式会社大垣共立銀行		46,773百万円
株式会社沖縄銀行		22,725百万円
株式会社香川銀行		12,014百万円
株式会社北九州銀行		10,000百万円
株式会社紀陽銀行		80,096百万円
株式会社佐賀銀行		16,062百万円
株式会社佐賀共栄銀行		2,679百万円
株式会社三十三銀行		37,461百万円
株式会社滋賀銀行		33,076百万円
株式会社七十七銀行		24,658百万円
株式会社清水銀行		10,816百万円
株式会社十六銀行		36,839百万円
株式会社荘内銀行		8,500百万円
株式会社常陽銀行		85,113百万円
スルガ銀行株式会社		30,043百万円
ソニー銀行株式会社		38,500百万円
株式会社但馬銀行		5,481百万円
株式会社筑邦銀行		8,000百万円
株式会社千葉銀行		145,069百万円
株式会社千葉興業銀行		62,120百万円
株式会社中京銀行		31,879百万円
株式会社中国銀行		15,149百万円
株式会社東京スター銀行		26,000百万円
株式会社東邦銀行		23,519百万円
株式会社栃木銀行		27,408百万円
株式会社トマト銀行		14,310百万円
株式会社富山銀行		6,730百万円
株式会社長崎銀行		7,621百万円

銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

株式会社長野銀行	13,017百万円	
株式会社名古屋銀行	25,090百万円	
株式会社南都銀行	37,924百万円	
株式会社西日本シティ銀行	85,745百万円	
株式会社八十二銀行 2	52,243百万円	
株式会社百五銀行	20,000百万円	
株式会社広島銀行	54,573百万円	
PayPay銀行株式会社	72,216百万円	
株式会社豊和銀行	12,495百万円	
株式会社北都銀行	12,500百万円	
株式会社北洋銀行	121,101百万円	
株式会社北陸銀行	140,409百万円	
株式会社宮崎銀行	14,697百万円	
株式会社宮崎太陽銀行	8,752百万円	
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	
株式会社もみじ銀行	10,000百万円	
株式会社山形銀行	12,008百万円	
株式会社山口銀行	10,005百万円	
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
おかやま信用金庫	1,775百万円 (出資の総額)	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。
全国信用協同組合連合会	111,875百万円 (出資の総額)	協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
日興アセットマネジメント株式会社	17,363百万円	証券投資信託の設定を行なうとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また金融商品取引法に定める投資助言業務を行なっています。

- 1 募集の取扱いを行ないません。
- 2 2024年7月1日より取扱開始予定です。

2【関係業務の概要】

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

3【資本関係】

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

第3【その他】

- (1) 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用します。
- (2) 目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。
委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日
ファンドの基本的性格など
委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など
委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など
目論見書の使用開始日
- (3) 目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象で

はない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。

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

「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。

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

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

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

「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。

有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。

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

- (4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用する場合があります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。

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

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

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

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

独立監査人の監査報告書

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
業務執行社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連

する注記事項の妥当性を評価する。

- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年12月6日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

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」に掲げられているグローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）の2022年9月22日から2023年9月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、グローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）の2023年9月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

独立監査人の中間監査報告書

2024年5月1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
業務執行社員 公認会計士 辻村 和之指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 榊原 康太

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）の2023年9月22日から2024年3月21日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、グローバル3倍3分法ファンド（1年決算型）の2024年3月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年9月22日から2024年3月21日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。