

【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11月7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】	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）
【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】**

Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）（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】

ありません。

(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11月8日から2025年5月7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、日本を含む世界の株式、不動産投資信託（REIT）および債券などに実質的に投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

単体型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単体型投信	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 年2回 年4回	グローバル (含む日本) 日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)
不動産投信	その他 ()	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動産 投信)))		中近東 (中東) エマージング		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信)))

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

年1回

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

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジあり(部分ヘッジ)

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1

「リスク・パリティ*の観点」からファンド設定時に決定した基本資産配分比率で、世界の株式、REIT、債券に分散投資します。

- 各資産がファンドにもたらすリスクの大きさが等しくなること(リスク・パリティ*)を概ね実現することをめざして決定した「株式20.0%、不動産投資信託(REIT)13.3%、債券66.7%」を基本資産配分比率とし、同比率を維持します。
- 為替変動リスクを株式・REIT・債券の各価格変動リスクに次ぐ4つ目のリスクと捉え、海外債券については為替ヘッジを行なうことで、為替変動リスクのある資産を海外株式と海外REITのみに限定します。

*リスク・パリティを概ね実現するために、各資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクについて、ファンド設定時点における過去長期間のデータを基に、日興アセットマネジメントが独自に各資産の組入比率を決定しました。なお、設定後の各資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクの変化に応じた基本資産配分比率の変更は、原則として行いません。

2

各資産への投資にあたってはインデックスファンドを活用します。

- インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、上記の基本資産配分比率とすることをめざします。なお、各資産における地域別配分比率(各マザーファンドの組入比率)は市場規模に応じた配分とします。
- マザーファンドの合計組入比率は、原則として高位を維持します。

*株式における日本、海外先進国、海外新興国の配分比率は、それぞれ対象マザーファンドの連動対象指数の時価総額に基づいて算出します。REITにおける日本、海外先進国の配分比率は、それぞれ対象マザーファンドの連動対象指数の時価総額に基づいて算出します。債券における日本、海外先進国の配分比率は、日本を含む「FTSE世界国債インデックス」における日本と海外先進国の時価総額に基づいて算出します。

3

購入時手数料はかかりません。

※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えない場合があります。



「おとなのバランス」とは？

リスクを相対的に低く抑えることを志向する当ファンドは、一般的な株式ファンドなどに比べて、**ゆったりと落ち着いた（“おとな”の）スタンス**で保有していただけるファンドとなることをめざしています。

それは、預貯金でコツコツと築いた**「まとまったお金」**を資産運用に振り向けたい、「**期間が限られた積立投資**」を行ないたいといった、いわゆる**「おとな」の投資家**にも活用しやすいバランス、「おとなのバランス」であると考えています。

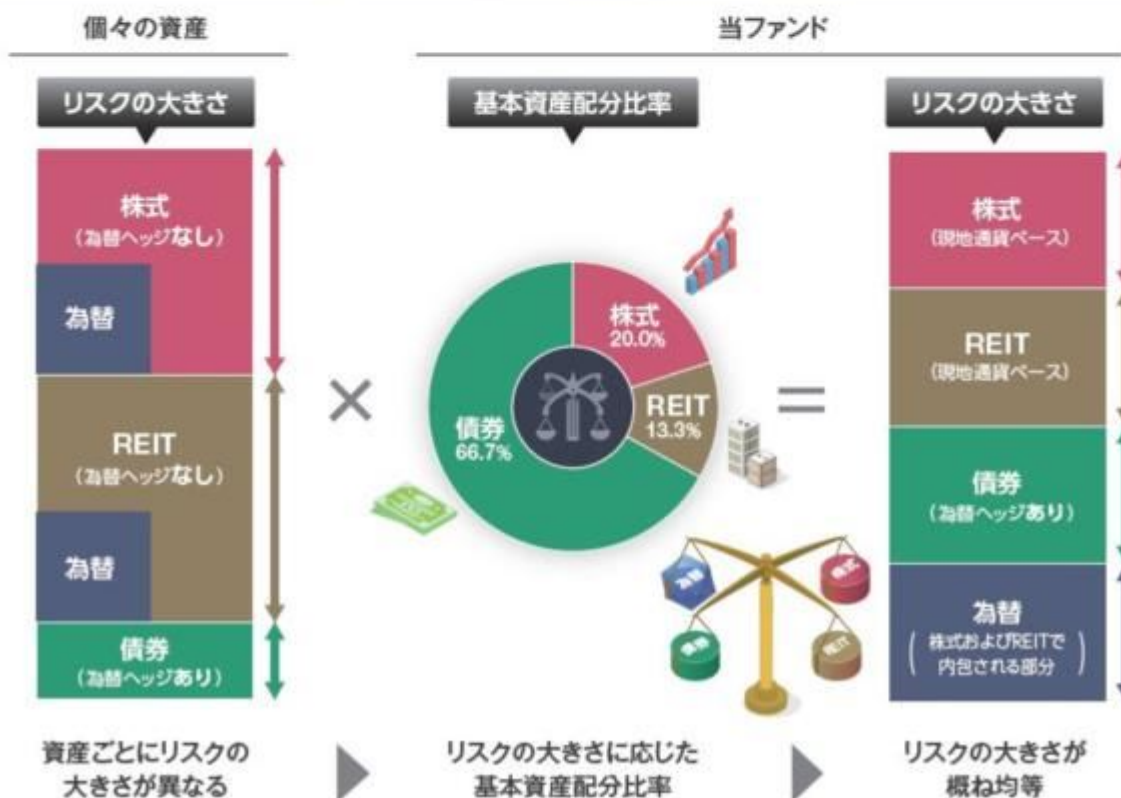
※ファンド設定後は原則、基本資産配分比率を固定します。

1 a. 「リスク・パリティの観点」から決定した資産配分



- 一般的な分散投資では、市場見通しに応じて資産配分を変化させたり、各資産へ均等に投資する方法が主流でした。しかし、これらの方法では、市場の急変時には値動きの大きい資産の影響を強く受けるなど、価格変動が大きくなる傾向がありました。
- 当ファンドは、各資産の価格変動リスクおよび外貨建て資産に内在する為替変動リスクの大きさが等しくなるような資産配分（リスク・パリティ）を意識して決定しました。なお、基本資産配分比率は固定とし、原則その比率を維持します。

当ファンドにおける資産配分の考え方



※上記は「Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)」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、実際の運用成果等を保証するものではありません。

1 b. 各資産の値動きの特徴と当ファンドの値動きのイメージ



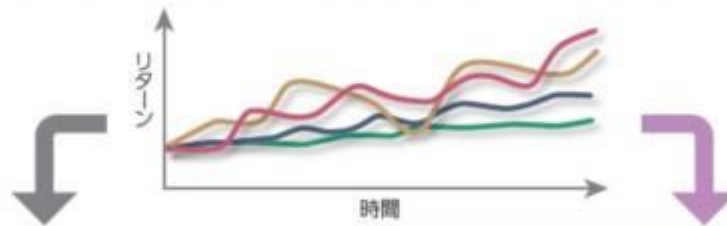
- 当ファンドでは、値動きが異なる傾向にある3つの資産(株式、REIT、債券)へ分散投資を行ないます。
- さらに、これら3つの資産それぞれの価格変動リスクに加え、各資産が内包する為替変動リスクの総計を4つ目の資産(リスク)と捉え、当ファンドが定める基本資産配分比率で投資を行なうことで、特定の資産の影響を受けにくい投資成果をめざします。

各資産の値動きの特徴

	株式	REIT (不動産投資)	債券	為替 (米ドル/円の場合)
景気が良くなると	企業業績が改善する傾向 ↑ 株価は上がる傾向	空室率や賃料水準が改善傾向 ↑ 価格は上がる傾向	金利が上がる傾向 ↓ 債券価格は下がる傾向	相対的に米国の景気が良い場合 通貨価値が上がる傾向 ↑ 米ドル高(円安)傾向
景気が悪くなると	企業業績が悪化する傾向 ↓ 株価は下がる傾向	空室率や賃料水準が悪化する傾向 ↓ 価格は下がる傾向	金利が下がる傾向 ↑ 債券価格は上がる傾向	相対的に米国の景気が悪い場合 通貨価値が下がる傾向 ↓ 米ドル安(円高)傾向

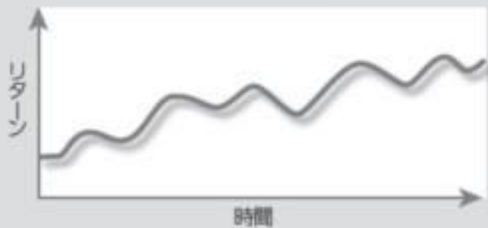
値動きのイメージ

各資産の値動きはそれぞれ異なるため、運用成果は大きく異なる傾向に。



一般的な分散投資にみられる投資成果

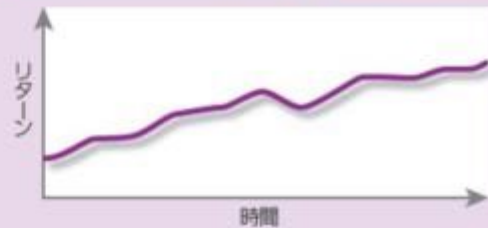
価格変動が比較的大きい資産
価格変動が比較的小さい資産
組入比率は均等



価格変動の大きな資産の影響により、投資成果が大きく変動することも

当ファンドがめざす投資成果

価格変動が比較的大きい資産
価格変動が比較的小さい資産
組入比率は少なめ
組入比率は多め



価格変動の大きな資産の影響を受けづらくなるため、安定的な投資成果が期待される

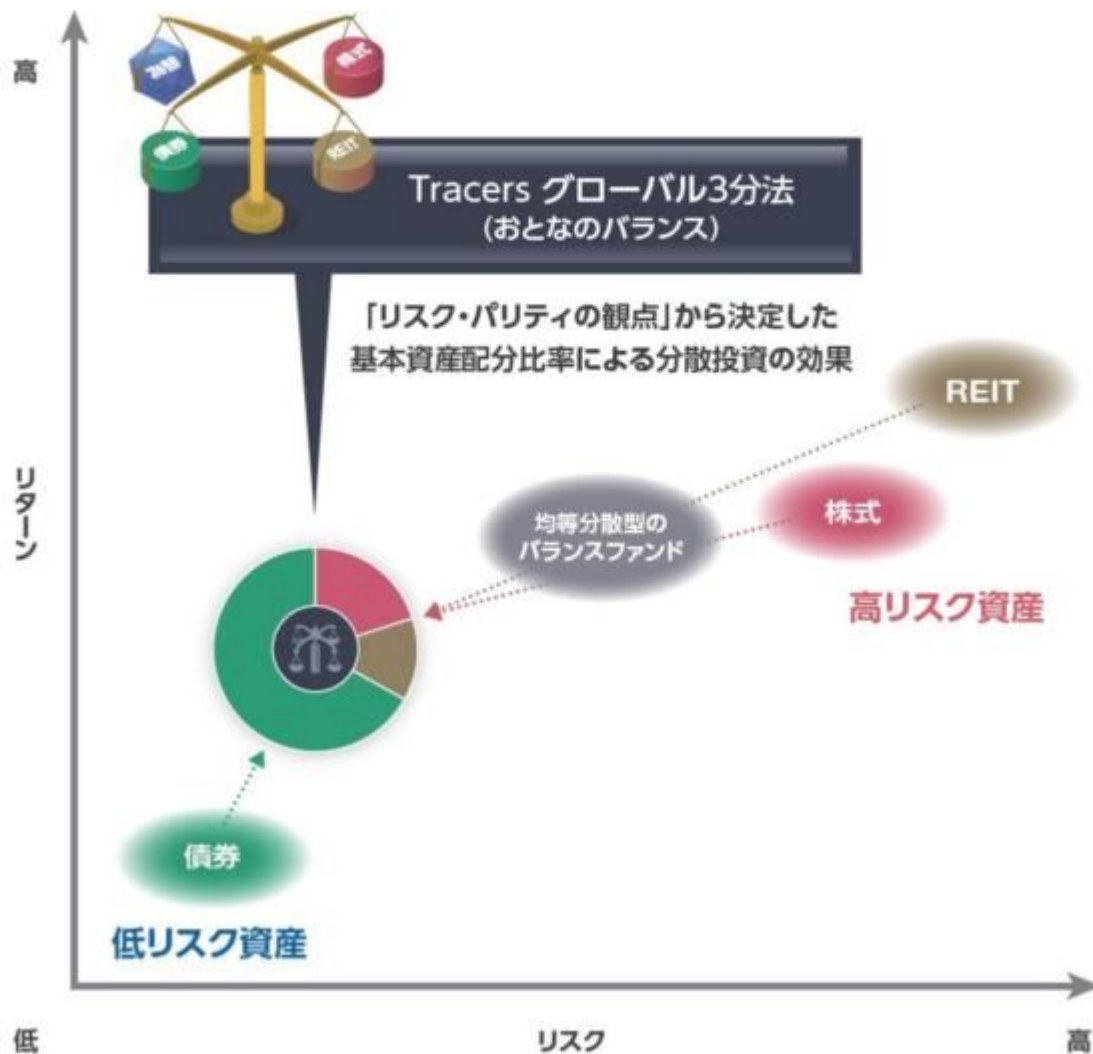
※ 価格変動などに関する説明は一般論であり、実際はこれと異なる値動きをする場合があります。また、各図はイメージです。

1 c. 当ファンドと各資産のリスク・リターンイメージ



- 一般に、値動きが異なる傾向にある複数の資産に分散投資を行なうことで、価格変動リスクの低減とリターンの安定化、つまり、運用効率(リスクあたりのリターン)の向上を期待できます。
- 当ファンドでは、資産ごとの価格変動リスクの傾向を踏まえ、リスクが比較的大きい資産は組入れを少なくし、リスクが比較的小さい資産は組入れを多くする資産配分比率を維持し、リスクの大きな資産の影響を受けづらくすることで、運用効率のさらなる向上をめざします。

各資産と当ファンドのリスク・リターンのイメージ



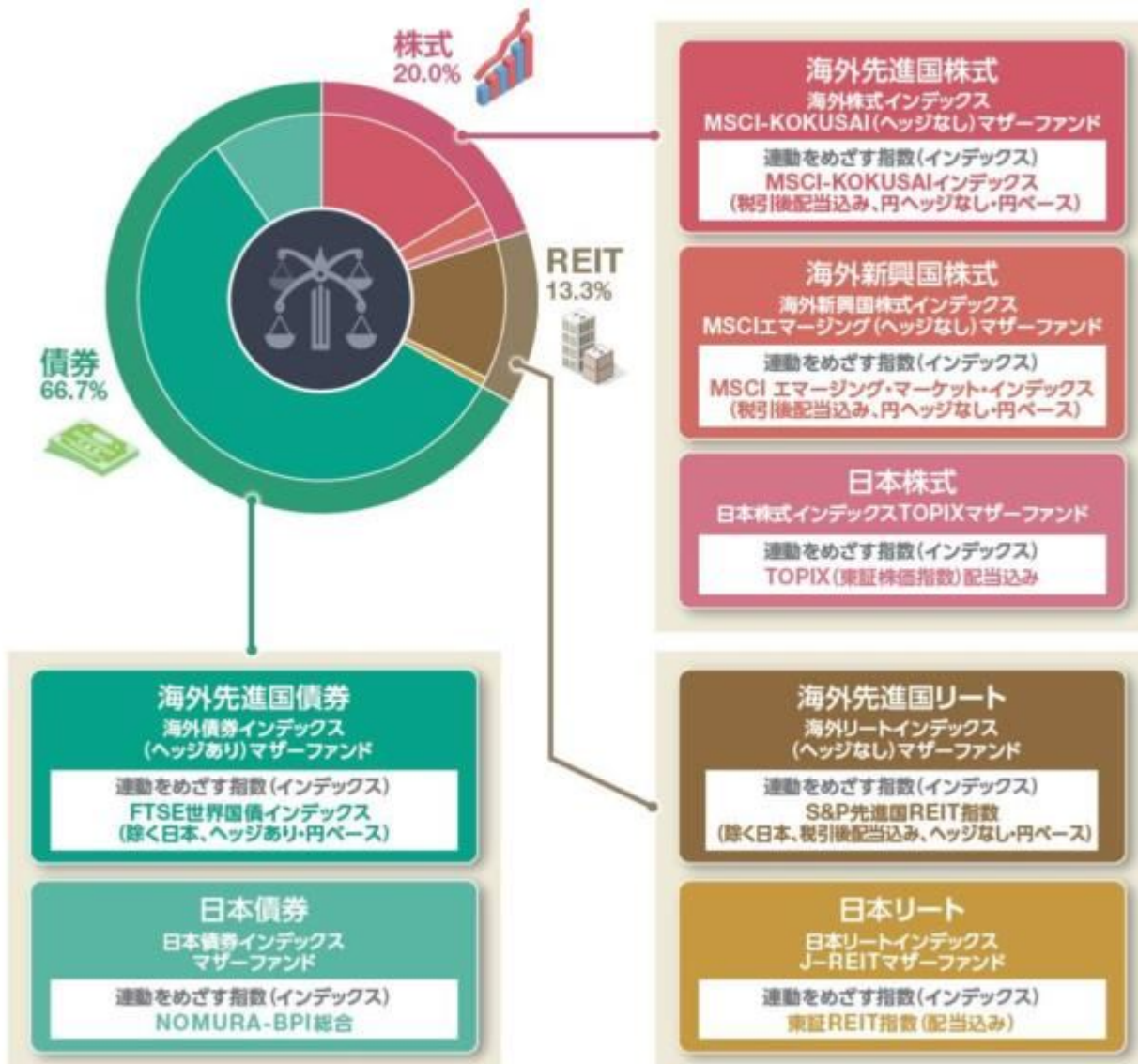
※ 上記は「Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)」についてのご理解を深めていただくためのイメージであり、実際のリスク・リターンなどの運用成果を保証するものではありません。

2 各資産への投資にあたってはインデックスファンドを活用



- インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、以下の基本資産配分比率を維持します。なお、各資産における地域別配分比率(各マザーファンドの組入比率)は市場規模に応じた配分とします。
- 各資産におけるマザーファンドの合計組入比率は、原則として高位を維持します。

基本資産配分比率と各資産における投資対象ファンド



- ※株式における日本、海外先進国、海外新興国の配分比率は、それぞれ対象マザーファンドの連動対象指数の時価総額に基づいて算出します。
REITにおける日本、海外先進国の配分比率は、それぞれ対象マザーファンドの連動対象指数の時価総額に基づいて算出します。債券における日本、海外先進国の配分比率は、日本を含む「FTSE世界国債インデックス」における日本と海外先進国の時価総額に基づいて算出します。
※各資産のマザーファンドの配分比率は変動します。
※市況動向および資金動向などにより上記のような運用ができない場合があります。

各指数(インデックス)の著作権などの権利について

●TOPIX(東証株価指数)

同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)に帰属します。また、JPXは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

●MSCI-KOKUSAIインデックス

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

●MSCI エマージング・マーケット・インデックス

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

●東証REIT指数

同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)に帰属します。また、JPXは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

●S&P先進国REIT指数

同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シー(S&P)社に帰属します。また、S&P社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

●NOMURA-BPI 総合

同指数は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下「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なわれる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

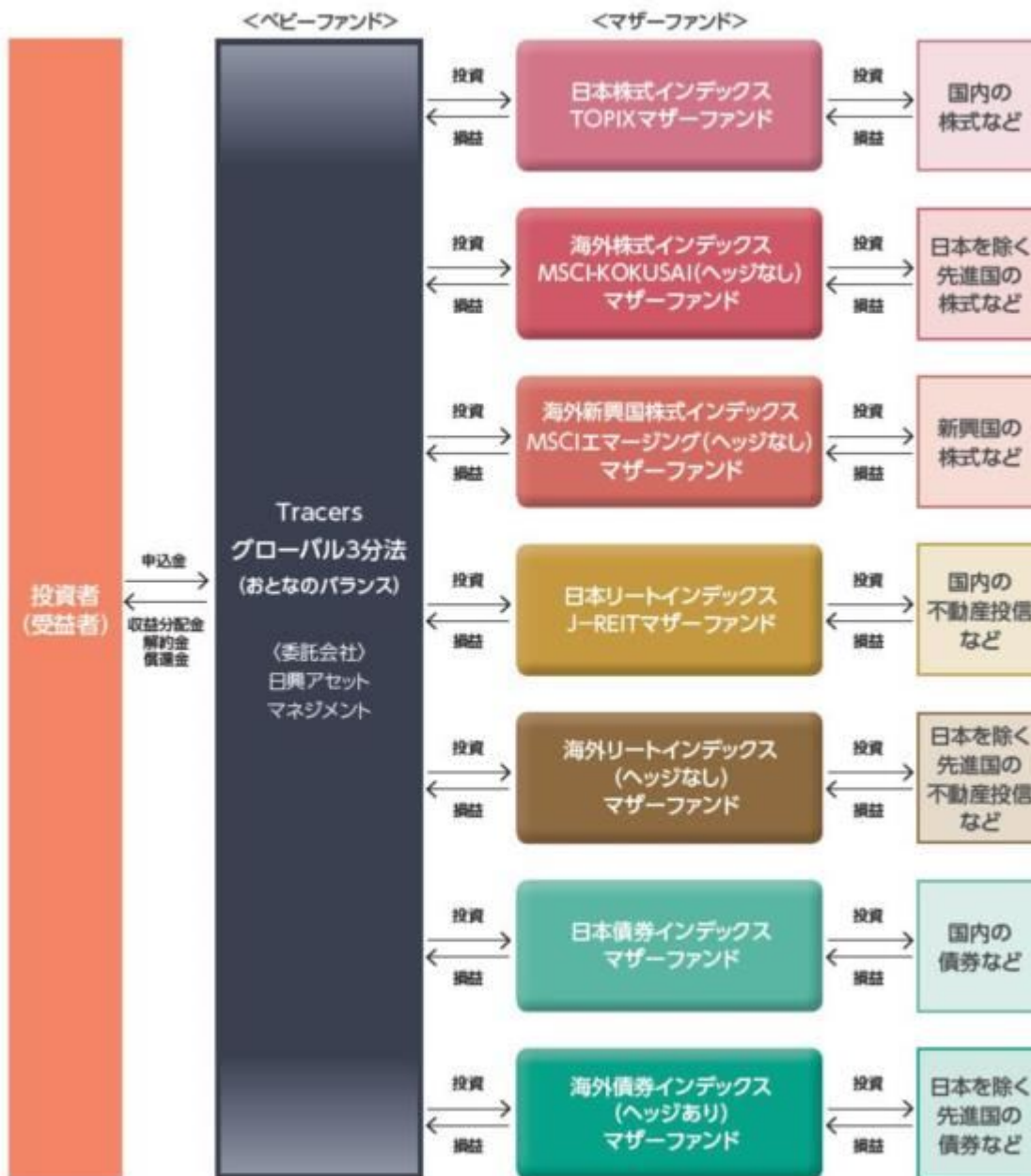
●FTSE世界国債インデックス

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

ファンドの仕組み



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



■ 主な投資制限

- 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

■ 分配方針

- 毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、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。



「こんな欲しかった」をデザインし、
ルール通りに運用(トレース)する

トレイサーズ
Tracersとは

Tracers (トレイサーズ)は、
「こんな欲しかった」というアイデアをファンドの設計に取り入れ、
事前に定めたルールに沿って運用(トレース)する、
日興アセットマネジメントのファンドシリーズです。

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。

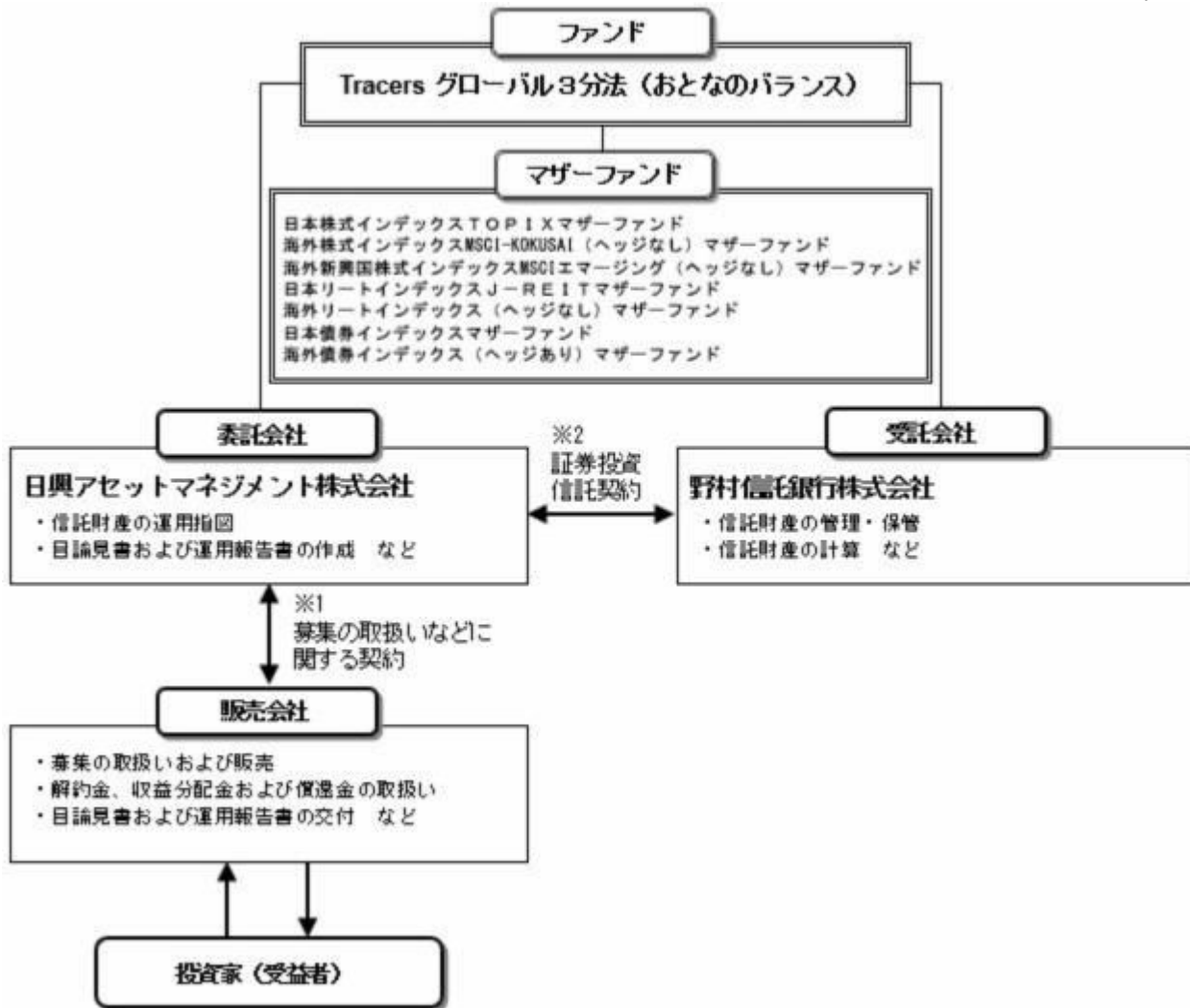
(2) 【ファンドの沿革】

2023年 2月10日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（2024年8月末現在）

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

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- ・主として、以下に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、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。
- ・各マザーファンドは、下記の指数（以下、連動対象指数といいます。）に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
 - 「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」 ... TOPIX（東証株価指数）配当込み
 - 「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」 ... 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）
 - 「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」 ... 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）

- 「日本リートインデックス」- R E I Tマザーファンド」 ... 東証 R E I T 指数(配当込み)
- 「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」 ... S & P 先進国 R E I T 指数(除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース)
- 「日本債券インデックスマザーファンド」 ... NOMURA-BPI総合
- 「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」 ... FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジあり・円ベース)
- ・株式・不動産投信・債券の資産毎に、下記の通り、各マザーファンド受益証券の標準合計組入率を定め、これを維持することを目的として運用を行ないます。
- 「日本株式インデックス T O P I X マザーファンド」、「海外株式インデックス M S C I - K O K U S A I (ヘッジなし)マザーファンド」および「海外新興国株式インデックス M S C I エマージング(ヘッジなし)マザーファンド」の標準合計組入率 20.0%
- 「日本リートインデックス」- R E I T マザーファンド」および「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」の標準合計組入率 13.3%
- 「日本債券インデックスマザーファンド」および「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」の標準合計組入率 66.7%
- ・株式における各マザーファンド受益証券の組入比率は、当該マザーファンドの運動対象指数の時価総額に基づいて算出します。また、不動産投信における各マザーファンド受益証券の組入比率も、同様に当該マザーファンドの運動対象指数の時価総額に基づいて算出します。債券における各マザーファンド受益証券の組入比率は、日本を含む「FTSE世界国債インデックス」における日本と海外先進国の時価総額に基づいて算出します。
- ・マザーファンド受益証券の合計組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることがあります。
- ・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】

< Tracers グローバル3分法(おとなのバランス) >

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

- 証券投資信託「日本株式インデックス T O P I X マザーファンド」
- 証券投資信託「海外株式インデックス M S C I - K O K U S A I (ヘッジなし)マザーファンド」
- 証券投資信託「海外新興国株式インデックス M S C I エマージング(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」- R E I T マザーファンド」
- 証券投資信託「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
- 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
- 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限りません。)
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- 主として次のマザーファンドの受益証券ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。
- 1) 証券投資信託「日本株式インデックス T O P I X マザーファンド」
 - 2) 証券投資信託「海外株式インデックス M S C I - K O K U S A I (ヘッジなし)マザーファンド」
 - 3) 証券投資信託「海外新興国株式インデックス M S C I エマージング(ヘッジなし)マザーファンド」
 - 4) 証券投資信託「日本リートインデックス」- R E I T マザーファンド」
 - 5) 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」
 - 6) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
 - 7) 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」
 - 8) 株券または新株引受権証券
 - 9) 国債証券
 - 10) 地方債証券
 - 11) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 12) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
 - 13) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 - 14) コマーシャル・ペーパー
 - 15) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
 - 16) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、8)~15)の証券または証書の性質を有するもの
 - 17) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。)
 - 18) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))で19)に定めるもの以外のもの
 - 19) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 20) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 - 21) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。)
 - 22) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)

- 23) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 24) 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。）
- 25) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 26) 外国の者に対する権利で25)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
- 次の取引ができます。
- 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
 - 10) 資金の借入
- <日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>
わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。）
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
- 1) 株券または新株引受権証書
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)～8)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
 - 11) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 - 12) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 13) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 次の取引ができます。
- 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 有価証券の貸付
 - 6) 公社債の空売
 - 7) 公社債の借入
- <海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド>
日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限りま。
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)～7)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 11) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12)に定めるもの以外のもの
 - 12) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 13) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りま。
 - 15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りま。
 - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
- 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
- 次の取引ができます。
- 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
- < 海外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 >
 新興国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第17条、第18条および第19条に定めるものに限りま。
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
- 1) 株券または新株引受権証書
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7) コマーシャル・ペーパー

- 8) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)~8)の証券または証書の性質を有するもの
- 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)
- 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
- 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
- 次の取引ができます。
- 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
- <日本リートインデックスJ-REITマザーファンド>
わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
 - 2) 金銭債権
 - 3) 約束手形
 - 4) 為替手形
- 主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。
- 1) 短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)およびコマーシャル・ペーパー
 - 2) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 - 3) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)のうち投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)に類する証券以外のもの
 - 4) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
- <海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド>
日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
 - 2) 金銭債権
 - 3) 約束手形
 - 4) 為替手形
- 主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。
- 1) 短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)およびコマーシャル・ペーパー
 - 2) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)の証券の性質を有するもの
 - 3) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい

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

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

投資対象とするマザーファンドの概要

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数）* 配当込みの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主としてわが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）配当込みの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資は行ないません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）

その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1999年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* TOPIX（東証株価指数）は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、指数採用銘柄の浮動株調整後の時価総額を指数化したものです。
TOPIXの指数値およびTOPIXに係る標章または商標は、株式会社JPM総研または株式会社JPM総研の関連会社（以下「JPM」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXに係る標章または商標に関するすべての権利はJPMが有します。JPMは、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、JPMにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPMは責任を負いません。

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

* MSCI-KOKUSAIインデックスは、MSCI Inc.が発表している、日本を除く世界の主要国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。
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。

< 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（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。

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

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

< 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、S & P先進国REIT指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として、日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、S & P先進国REIT指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動した投資成果をめざします。 不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジは行ないません。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2005年6月30日設定）
決算日	毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）

* S & P 先進国REIT指数（除く日本）は、スタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービス エル エル シー（S & P社）が発表している、日本を除く世界の主要国の不動産投信市場の合成パフォーマンスを表す指数です。

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

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

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

<海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド>

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

ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

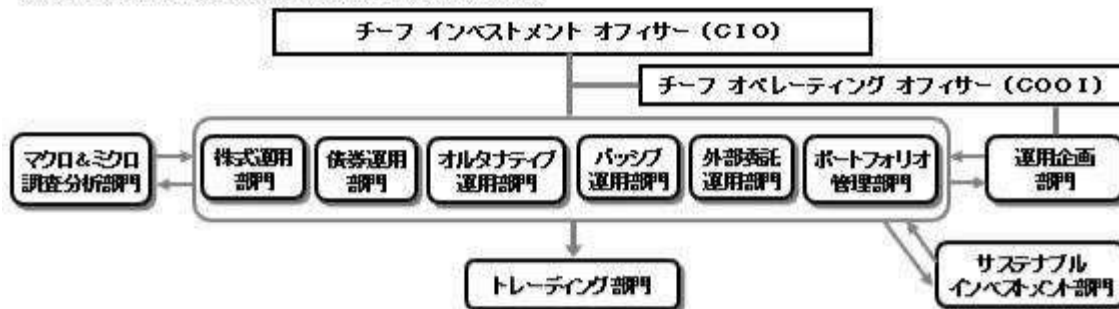
その他

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

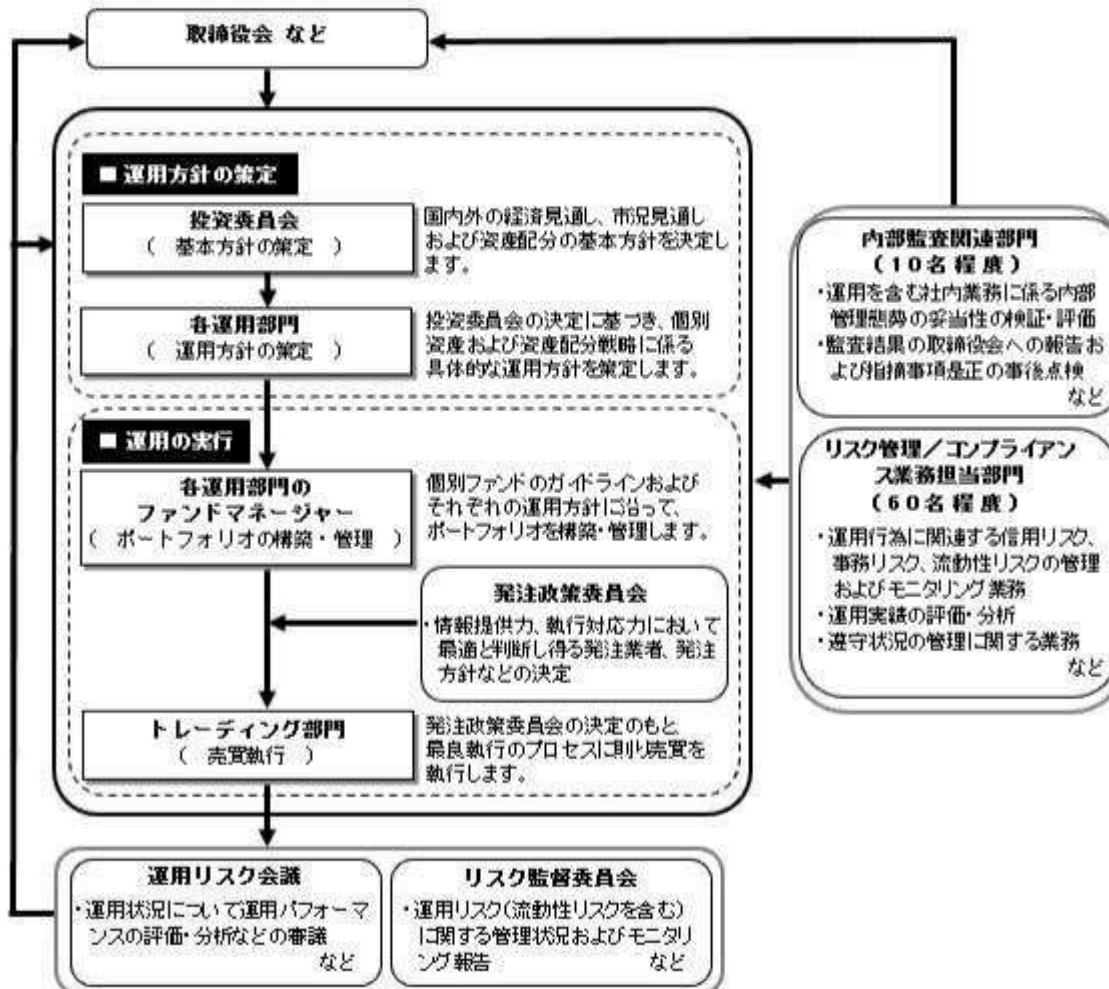
* FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

(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8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

< Tracers グローバル3分法（おとなのバランス） >

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。以下同じ。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができるものとします。
- 3) 投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）

- るものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号八に掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および上場投資信託証券を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
- ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- ハ) 上場投資信託証券の貸付は、貸付時点において、貸付上場投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する上場投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入れ額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
- イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
- ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の範囲内
- ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
- ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 16) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 17) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうものとします。
- <日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>
- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 5) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条

- 第8項第3号八に掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
 - 7) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期間が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - 8) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
 - 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
 - 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
- < 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド >
- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。
 - 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 - 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
 - 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
 - 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
 - 7) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
 - 8) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
 - 9) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期間が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - 10) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
 - 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価

総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

< 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 >

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

< 日本リートインデックスJ-REITマザーファンド >

- 1) 投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する

特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。

- 2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
- 3) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- 4) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

< 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

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

< 日本債券インデックスマザーファンド >

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

< 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド >

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

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

- ・投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・当ファンドは、主に株式、不動産投信および債券を実質的な投資対象としますので、株式、不動産投信および債券の価格の下落や、株式、不動産投信および債券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。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

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。

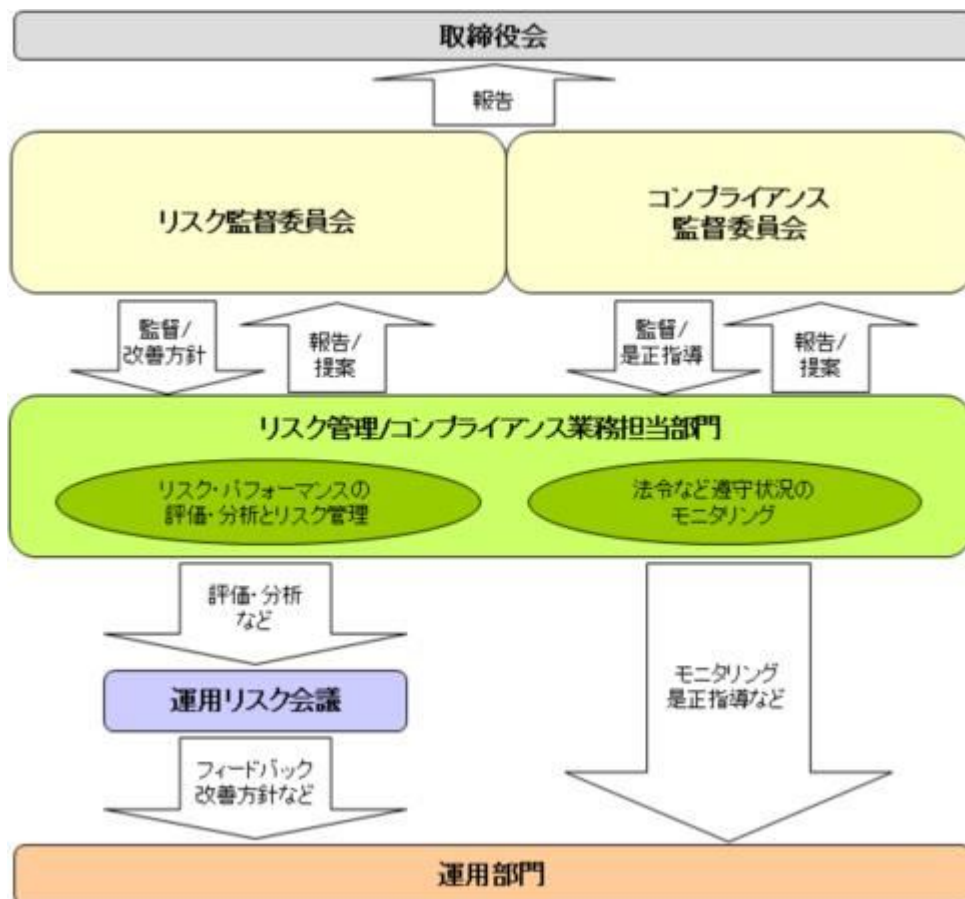
信用リスク

- ・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。
 - ・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
 - ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。
- 為替変動リスク
- ・外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
 - ・「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」は原則として為替ヘッジを行ないませんが、為替ヘッジを行なうにあたっては、円の金利が為替ヘッジを行なう通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替および金利の動向によっては、為替ヘッジに伴うヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。
 - ・一般に新興国の通貨は、先進国の通貨に比べて為替変動が大きくなる場合があります。
- カントリー・リスク
- ・投資対象国における非常事態など（金融危機、財政上の理由による国自体のデフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）を含む市況動向や資金動向などによっては、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあり、投資方針に従った運用ができない場合があります。
 - ・一般に新興国は、情報の開示などが先進国に比べて充分でない、あるいは正確な情報の入手が遅延する場合があります。
 - ・ファンドの投資対象資産が上場または取引されている諸国の税制は各国によって異なります。また、それらの諸国における税制が一方的に変更されたり、新たな税制が適用されたりすることもあります。以上のような要因は、ファンドの信託財産の価値に影響を与える可能性があります。

<その他の留意事項>

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

(2) リスク管理体制



全社的なリスク管理

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

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2024年8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との平均騰落率、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	6.8%	13.7%	20.4%	10.7%	-1.4%	5.1%	6.7%
最大値	8.4%	42.1%	59.8%	62.7%	4.4%	15.3%	21.5%
最小値	6.2%	-10.4%	-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9月から2024年8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・ディバースファイド(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。

※上記各指数の著作権等の知的財産権その他一切の権利は、各指数の算出元または公表元に帰属します。

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・ディバースファイド(円ヘッジなし、円ベース)

当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象に

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、2023年2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。

した指数です。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料
ありません。
信託財産留保額
ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.1089%（税抜0.099%）の率を乗じて得た額とします。

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。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

純資産総額	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
500億円以下の部分	0.099%	0.029%	0.050%	0.020%
500億円超の部分	0.099%	0.031%	0.050%	0.018%

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0.03%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諸費用の合計額とみなして、信託財産から支弁を受けることができます。（以下「見積方式」といいます。）ただし、委託会社は、信託財産の規模などを考慮して、信託の設定時または中に、かかる諸費用の見積率を見直し、年率0.03%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。
 ファンドおよび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。
 ファンドおよび主要投資対象である各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まれます。）。

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。

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

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

< 投資対象とするマザーファンドに係る費用 >

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

* 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「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」および「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱い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。

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

少額投資非課税制度（NISA）をご利用の場合、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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）

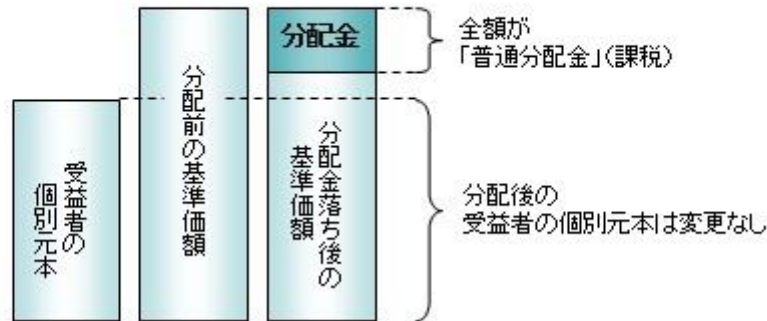
1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

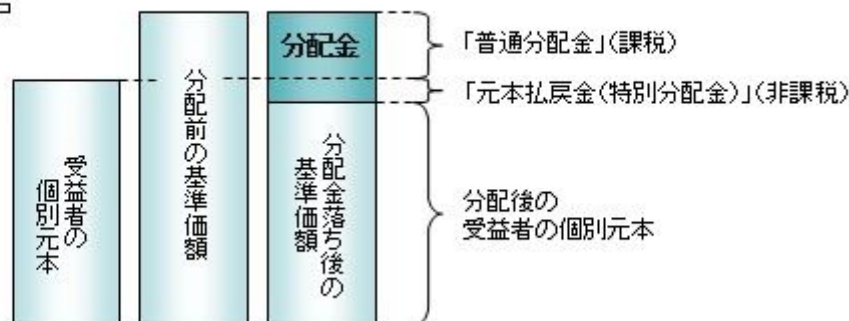
- イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
- ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<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11月7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:2023年2月10日~2024年2月7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
0.18%	0.11%	0.07%

※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。

※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】

【Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)】

以下の運用状況は2024年 8月30日現在です。

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

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	660,917,537	99.74
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		1,731,816	0.26
合計(純資産総額)		662,649,353	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	297,277,978	1.3129	390,311,136	1.3244	393,714,954	59.42
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	17,701,369	6.0582	107,239,153	6.3918	113,143,610	17.07
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	23,358,028	3.2374	75,621,064	3.5313	82,484,204	12.45
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	35,292,732	1.3314	46,989,736	1.3214	46,635,816	7.04
日本	親投資信託受益証券	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	4,831,270	2.6718	12,908,251	2.7687	13,376,337	2.02
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	2,197,340	2.6983	5,929,106	2.8146	6,184,633	0.93
日本	親投資信託受益証券	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	2,131,245	2.4570	5,236,604	2.5234	5,377,983	0.81

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.74
合計	99.74

【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 (2024年 2月 7日)	336	336	1.0526	1.0526
2023年 8月末日	205		1.0260	
9月末日	218		0.9978	
10月末日	249		0.9794	
11月末日	265		1.0248	
12月末日	267		1.0541	
2024年 1月末日	315		1.0536	
2月末日	361		1.0593	
3月末日	420		1.0773	
4月末日	481		1.0655	
5月末日	525		1.0693	
6月末日	586		1.0944	
7月末日	613		1.0896	
8月末日	662		1.0921	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2023年 2月10日～2024年 2月 7日	0.0000
当中間期	2024年 2月 8日～2024年 8月 7日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2023年 2月10日～2024年 2月 7日	5.26
当中間期	2024年 2月 8日～2024年 8月 7日	2.17

(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	2023年 2月10日～2024年 2月 7日	487,437,224	167,938,424
当中間期	2024年 2月 8日～2024年 8月 7日	399,431,357	142,501,828

(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)

日本株式インデックストップIXマザーファンド

以下の運用状況は2024年 8月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	61,732,738,300	99.72
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		172,380,753	0.28
合計（純資産総額）		61,905,119,053	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	135,775,000	0.22

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	859,200	2,605.42	2,238,576,864	2,759.50	2,370,962,400	3.83
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	113,200	12,275.93	1,389,635,276	14,200.00	1,607,440,000	2.60
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	969,400	1,243.89	1,205,826,966	1,528.00	1,481,243,200	2.39
日本	株式	日立製作所	電気機器	392,300	1,855.88	728,061,724	3,572.00	1,401,295,600	2.26
日本	株式	キーエンス	電気機器	16,200	53,404.08	865,146,096	69,610.00	1,127,682,000	1.82
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	119,700	4,514.91	540,434,727	9,047.00	1,082,925,900	1.75

日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	111,500	7,247.84	808,134,160	9,550.00	1,064,825,000	1.72
日本	株式	三菱商事	卸売業	328,400	2,347.85	771,033,940	3,013.00	989,469,200	1.60
日本	株式	信越化学工業	化学	145,200	4,390.96	637,567,392	6,422.00	932,474,400	1.51
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	114,900	5,461.52	627,528,648	7,706.00	885,419,400	1.43
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	34,200	20,115.10	687,936,420	25,805.00	882,531,000	1.43
日本	株式	第一三共	医薬品	141,200	4,124.65	582,400,580	6,108.00	862,449,600	1.39
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	155,400	3,460.66	537,786,564	5,506.00	855,632,400	1.38
日本	株式	任天堂	その他製品	102,000	6,257.67	638,282,340	7,902.00	806,004,000	1.30
日本	株式	三井物産	卸売業	256,200	2,693.31	690,026,022	3,123.00	800,112,600	1.29
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4,821,700	171.65	827,644,805	155.70	750,738,690	1.21
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	80,000	6,196.60	495,728,000	8,405.00	672,400,000	1.09
日本	株式	HOYA	精密機器	31,800	14,779.73	469,995,414	20,595.00	654,921,000	1.06
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	214,900	2,526.58	542,962,042	3,009.00	646,634,100	1.04
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	143,500	4,317.47	619,556,945	4,333.00	621,785,500	1.00
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	382,900	1,583.17	606,195,793	1,588.00	608,045,200	0.98
日本	株式	KDDI	情報・通信業	119,200	4,451.69	530,641,448	4,911.00	585,391,200	0.95
日本	株式	三菱重工業	機械	285,400	835.39	238,420,306	1,942.50	554,389,500	0.90
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	259,100	1,697.79	439,898,191	2,038.00	528,045,800	0.85
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	9,600	35,286.66	338,751,936	46,650.00	447,840,000	0.72
日本	株式	村田製作所	電気機器	144,400	2,523.72	364,425,168	3,033.00	437,965,200	0.71
日本	株式	三菱電機	電気機器	178,800	1,768.30	316,172,040	2,441.00	436,450,800	0.71
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	96,700	3,498.83	338,336,861	4,203.00	406,430,100	0.66
日本	株式	キャノン	電気機器	80,600	3,683.97	296,927,982	5,017.00	404,370,200	0.65
日本	株式	富士通	電気機器	150,200	1,743.07	261,809,114	2,677.50	402,160,500	0.65

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.29
		建設業	2.14
		食料品	3.15
		繊維製品	0.37
		パルプ・紙	0.15
		化学	5.68
		医薬品	5.09
		石油・石炭製品	0.55
		ゴム製品	0.60
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.86
		非鉄金属	0.77
		金属製品	0.49
		機械	5.33
電気機器	17.50		

	輸送用機器	7.49
	精密機器	2.41
	その他製品	2.46
	電気・ガス業	1.43
	陸運業	2.32
	海運業	0.81
	空運業	0.37
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	7.45
	卸売業	7.29
	小売業	4.29
	銀行業	7.55
	証券、商品先物取引業	0.87
	保険業	3.12
	その他金融業	1.20
	不動産業	2.05
	サービス業	4.76
合 計		99.72

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2024年09月	買建	5	日本円	124,478,250	135,775,000	0.22

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

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 8月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	294,291,794,518	70.45
	カナダ	13,582,015,637	3.25
	ドイツ	9,683,241,465	2.32
	イタリア	2,323,557,157	0.56
	フランス	11,582,695,376	2.77
	オランダ	7,728,591,803	1.85
	スペイン	2,900,051,226	0.69
	ベルギー	882,032,752	0.21
	オーストリア	203,921,586	0.05
	ルクセンブルク	161,270,712	0.04

	フィンランド	1,117,544,956	0.27
	アイルランド	7,739,007,467	1.85
	ポルトガル	161,322,808	0.04
	イギリス	15,774,159,761	3.78
	スイス	12,724,672,267	3.05
	スウェーデン	3,598,924,693	0.86
	ノルウェー	638,351,866	0.15
	デンマーク	4,133,472,376	0.99
	ケイマン	488,938,668	0.12
	オーストラリア	7,554,035,152	1.81
	バミューダ	439,039,228	0.11
	ニュージーランド	267,806,533	0.06
	香港	1,607,683,444	0.38
	シンガポール	1,149,957,181	0.28
	イスラエル	859,541,677	0.21
	ジャージー	636,730,379	0.15
	アラブ首長国連邦	0	0.00
	マン島	29,961,869	0.01
	小計	402,260,322,557	96.30
投資証券	アメリカ	7,097,786,895	1.70
	カナダ	15,556,571	0.00
	フランス	139,333,301	0.03
	ベルギー	29,591,200	0.01
	イギリス	139,154,808	0.03
	オーストラリア	503,424,041	0.12
	香港	71,180,444	0.02
	シンガポール	93,325,285	0.02
	小計	8,089,352,545	1.94
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		7,375,265,833	1.77
合計（純資産総額）		417,724,940,935	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	6,295,542,000	1.51
	買建	ドイツ	1,134,487,284	0.27

(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		6,609,800,705	1.58

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	644,894	25,078.88	16,173,223,594	33,273.59	21,457,939,839	5.14
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,098,930	6,746.78	7,414,244,182	17,027.03	18,711,516,276	4.48
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	310,234	50,225.46	15,581,647,372	59,819.77	18,558,128,388	4.44
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	411,760	18,310.07	7,539,357,122	24,922.97	10,262,284,598	2.46
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	96,310	45,142.94	4,347,716,800	75,038.25	7,226,934,435	1.73
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	259,170	18,525.59	4,801,277,671	23,425.74	6,071,250,072	1.45
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	224,200	18,648.95	4,181,094,719	23,660.32	5,304,643,744	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	35,494	87,195.62	3,094,921,556	136,140.95	4,832,187,234	1.16
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	193,600	12,986.82	2,514,249,012	22,723.46	4,399,262,630	1.05
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	126,690	20,864.25	2,643,292,886	32,176.00	4,076,378,454	0.98
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	57,695	49,639.65	2,863,960,068	67,819.97	3,912,873,515	0.94
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	126,145	30,729.92	3,876,426,117	29,869.34	3,767,868,399	0.90
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	40,480	76,693.50	3,104,552,885	85,659.33	3,467,489,921	0.83
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	197,699	15,683.90	3,100,692,077	17,105.22	3,381,685,680	0.81
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	143,390	15,167.67	2,174,893,130	19,836.52	2,844,358,889	0.68
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	69,752	34,671.00	2,418,371,892	39,721.53	2,770,656,579	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	36,700	56,622.74	2,078,054,708	69,619.84	2,555,048,128	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	103,549	21,915.28	2,269,305,578	24,620.34	2,549,412,001	0.61
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	105,971	21,985.97	2,329,876,054	23,780.50	2,520,043,789	0.60
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	19,469	82,163.80	1,599,647,175	128,384.02	2,499,508,563	0.60
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	17,612	93,276.51	1,642,786,069	132,042.11	2,325,525,817	0.56
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	43,705	41,471.23	1,812,500,528	53,150.28	2,322,933,337	0.56

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	77,776	21,330.26	1,658,982,736	28,262.06	2,198,110,290	0.53
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	194,426	7,940.70	1,543,879,005	11,065.61	2,151,443,456	0.52
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	19,065	61,145.64	1,165,741,676	100,271.10	1,911,668,598	0.46
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	111,253	15,212.91	1,692,482,545	17,008.20	1,892,214,165	0.45
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	180,342	8,195.65	1,478,020,363	10,432.83	1,881,479,231	0.45
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	117,690	16,781.27	1,974,988,809	15,563.52	1,831,671,140	0.44
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	313,269	3,829.11	1,199,544,227	5,816.61	1,822,165,478	0.44
イギリス	株式	ASTRAZENECA PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	68,352	20,231.53	1,382,866,010	25,313.51	1,730,229,582	0.41

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	4.28
		素材	3.57
		資本財	6.91
		商業・専門サービス	1.60
		運輸	1.58
		自動車・自動車部品	1.54
		耐久消費財・アパレル	1.29
		消費者サービス	1.83
		メディア・娯楽	6.12
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.54
		生活必需品流通・小売り	1.77
		食品・飲料・タバコ	3.18
		家庭用品・パーソナル用品	1.58
		ヘルスケア機器・サービス	4.16
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.15
		銀行	5.57
		金融サービス	6.67
		保険	3.09
		ソフトウェア・サービス	9.44
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.60
電気通信サービス	1.13		
公益事業	2.64		
半導体・半導体製造装置	8.77		
不動産管理・開発	0.28		
投資証券			1.94
合計			98.23

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 EMINI2409	買建	155	米ドル	42,157,312.5	6,104,378,850	43,477,500	6,295,542,000	1.51
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2409	買建	155	ユーロ	6,835,820	1,096,738,961	7,071,100	1,134,487,284	0.27

(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	39,200,000.00	5,847,402,080	5,643,444,070	1.35
	ユーロ	買建	6,050,000.00	990,060,075	966,356,635	0.23

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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 8月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	191,677,335	0.16
	メキシコ	2,150,190,533	1.76
	ブラジル	5,122,433,597	4.19
	チリ	499,893,082	0.41
	コロンビア	115,026,300	0.09
	ペルー	332,492,425	0.27
	オランダ	74,985,839	0.06
	ルクセンブルク	133,851,658	0.11
	ギリシャ	581,666,395	0.48
	イギリス	190,783,690	0.16
	トルコ	795,533,560	0.65
	チェコ	147,418,937	0.12
	キプロス	0	0.00
	ハンガリー	281,164,264	0.23
	ポーランド	951,563,743	0.78
	ロシア	10,598	0.00
	ケイマン	9,893,394,571	8.09
	バミューダ	191,805,074	0.16
香港	1,354,629,477	1.11	
シンガポール	26,809,973	0.02	
マレーシア	1,757,166,387	1.44	

	タイ	1,679,770,106	1.37
	フィリピン	651,455,875	0.53
	インドネシア	2,004,583,426	1.64
	韓国	13,202,902,955	10.80
	台湾	20,937,171,164	17.13
	中国	16,087,351,179	13.16
	インド	22,619,883,749	18.51
	カタール	908,374,313	0.74
	エジプト	71,081,741	0.06
	南アフリカ	3,311,813,817	2.71
	アラブ首長国連邦	1,333,670,816	1.09
	クウェート	846,602,769	0.69
	サウジアラビア	4,611,604,683	3.77
	小計	113,058,764,031	92.50
投資証券	メキシコ	100,925,450	0.08
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		9,065,198,132	7.42
合計（純資産総額）		122,224,887,613	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	9,192,992,896	7.52

(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		173,657,760	0.14

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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	2,524,355	3,807.69	9,611,963,745	4,274.71	10,790,893,892	8.83
中国	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	678,350	7,082.64	4,804,509,395	7,012.03	4,756,611,907	3.89
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	490,470	8,492.52	4,165,326,510	8,036.40	3,941,613,108	3.22
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	1,597,300	1,532.79	2,448,327,513	1,467.95	2,344,770,112	1.92
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	312,232	4,932.08	1,539,955,756	5,292.81	1,652,587,462	1.35
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	340,998	2,480.30	845,777,876	3,364.02	1,147,127,161	0.94
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	533,187	1,958.25	1,044,115,686	2,126.10	1,133,612,080	0.93
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	522,785	2,257.07	1,179,965,265	2,148.54	1,123,229,189	0.92

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	1,281,212	772.89	990,243,737	836.35	1,071,550,561	0.88
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	56,190	20,096.11	1,129,200,769	18,429.42	1,035,549,110	0.85
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	9,735,920	103.24	1,005,225,952	104.54	1,017,881,674	0.83
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	156,432	5,235.31	818,970,925	5,666.37	886,402,374	0.73
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費財・サービス流通・小売り	61,370	20,443.94	1,254,645,105	13,527.21	830,165,246	0.68
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	288,593	2,510.77	724,591,483	2,851.07	822,800,865	0.67
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	92,739	6,762.00	627,101,841	7,850.53	728,050,487	0.60
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	202,432	3,101.20	627,782,783	3,405.06	689,294,118	0.56
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	231,155	2,279.22	526,854,486	2,724.66	629,820,169	0.52
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA - H	銀行	6,575,575	83.00	545,824,672	85.79	564,140,936	0.46
ケイマン	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,562,800	371.02	579,843,496	350.60	547,920,180	0.45
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	5,634,900	89.30	503,196,570	96.11	541,598,413	0.44
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	82,570	7,004.70	578,378,079	6,526.85	538,922,830	0.44
中国	株式	BANK OF CHINA LTD - H	銀行	8,182,000	68.52	560,657,641	65.73	537,866,680	0.44
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	17,930	32,795.84	588,029,492	29,287.51	525,125,126	0.43
ブラジル	株式	VALE SA	素材	342,206	1,656.90	567,003,536	1,524.74	521,776,997	0.43
サウジアラビア	株式	SAUDI ARABIAN OIL CO	エネルギー	442,339	1,116.88	494,041,927	1,080.26	477,844,446	0.39
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	231,590	1,962.80	454,566,474	2,045.19	473,646,942	0.39
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	464,960	987.35	459,081,120	1,011.26	470,199,491	0.38
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	196,975	2,915.49	574,278,643	2,356.53	464,178,088	0.38
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	241,223	2,377.81	573,583,839	1,921.99	463,629,400	0.38
インド	株式	MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	自動車・自動車部品	96,330	4,022.99	387,535,355	4,798.22	462,212,918	0.38

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	4.85
		素材	6.19
		資本財	4.51
		商業・専門サービス	0.04
		運輸	1.78
		自動車・自動車部品	3.57
		耐久消費財・アパレル	1.00

	消費者サービス	2.25
	メディア・娯楽	5.62
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.37
	生活必需品流通・小売り	1.20
	食品・飲料・タバコ	2.89
	家庭用品・パーソナル用品	0.73
	ヘルスケア機器・サービス	0.87
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.48
	銀行	15.70
	金融サービス	2.65
	保険	2.67
	ソフトウェア・サービス	2.53
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.17
	電気通信サービス	2.61
	公益事業	2.81
	半導体・半導体製造装置	11.75
	不動産管理・開発	1.23
投資証券		0.08
合計		92.58

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	MINMSCIE2409	買建	1,156	米ドル	62,684,030	9,076,647,544	63,487,520	9,192,992,896	7.52

(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	1,200,000.00	173,652,000	173,657,760	0.14

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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 8月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	61,418,669,400	98.40
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		997,578,288	1.60
合計(純資産総額)		62,416,247,688	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	7,049	579,075.53	4,081,903,410	656,000	4,624,144,000	7.41
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	6,206	507,122.99	3,147,205,275	587,000	3,642,922,000	5.84
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	19,539	140,328.63	2,741,881,101	147,700	2,885,910,300	4.62
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	30,440	89,894.59	2,736,391,319	92,400	2,812,656,000	4.51
日本	投資証券	KDX不動産投資法人 投資証券	16,904	152,517.54	2,578,156,496	161,600	2,731,686,400	4.38
日本	投資証券	GLP投資法人 投資証券	20,295	129,910.95	2,636,542,730	133,600	2,711,412,000	4.34
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	10,526	250,131.41	2,632,883,221	257,400	2,709,392,400	4.34
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	33,291	67,740.86	2,255,160,970	64,600	2,150,598,600	3.45
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	9,061	244,696.9	2,217,198,610	235,900	2,137,489,900	3.42
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,938	320,030.52	1,900,341,227	331,000	1,965,478,000	3.15
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	13,516	142,209.02	1,922,097,114	143,900	1,944,952,400	3.12
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	12,039	157,599.19	1,897,336,648	151,700	1,826,316,300	2.93
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	22,197	78,915.57	1,751,688,907	74,800	1,660,335,600	2.66
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	18,156	77,414.68	1,405,540,930	84,000	1,525,104,000	2.44
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	2,086	640,045.02	1,335,133,911	659,000	1,374,674,000	2.20
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	11,063	122,117.45	1,350,985,349	124,200	1,374,024,600	2.20
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	4,132	327,013.5	1,351,219,782	329,500	1,361,494,000	2.18
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	7,741	146,805.59	1,136,422,072	146,500	1,134,056,500	1.82
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	2,520	431,037.02	1,086,213,290	439,500	1,107,540,000	1.77
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	4,059	264,917.42	1,075,299,807	261,900	1,063,052,100	1.70
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,937	366,484.16	1,076,363,977	344,500	1,011,796,500	1.62
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	7,412	131,705.25	976,199,313	134,000	993,208,000	1.59
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	3,059	314,434.44	961,854,951	320,000	978,880,000	1.57
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,242	444,973.33	997,630,205	428,500	960,697,000	1.54
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	8,924	102,897.53	918,257,557	104,000	928,096,000	1.49
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	7,105	129,903.61	922,965,149	129,800	922,229,000	1.48
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	2,086	375,526.74	783,348,779	378,000	788,508,000	1.26
日本	投資証券	森トラストリート投資法人 投資証券	11,647	68,705.37	800,211,444	66,300	772,196,100	1.24
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	2,503	279,675.42	700,027,576	307,000	768,421,000	1.23
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,339	143,703.28	767,231,811	141,200	753,866,800	1.21

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.40
合計	98.40

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2024年 8月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	44,079,837,503	78.23
	カナダ	816,280,736	1.45
	ドイツ	18,667,098	0.03
	イタリア	6,566,413	0.01
	フランス	956,947,229	1.70
	オランダ	97,869,743	0.17
	スペイン	260,473,135	0.46
	ベルギー	548,562,985	0.97
	アイルランド	18,227,758	0.03
	イギリス	2,601,669,968	4.62
	オーストラリア	4,049,936,031	7.19
	ニュージーランド	67,379,948	0.12
	香港	526,312,325	0.93
	シンガポール	1,771,900,453	3.14
	韓国	104,541,784	0.19
	イスラエル	61,448,535	0.11
	ガーンジー	123,922,328	0.22
	小計	56,110,543,972	99.59
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		233,594,633	0.41
合計（純資産総額）		56,344,138,605	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	238,817	16,259.59	3,883,066,982	18,147.78	4,333,999,331	7.69
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	24,488	110,953.00	2,717,017,064	118,553.55	2,903,139,381	5.15

アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	154,308	15,047.61	2,321,967,530	17,455.63	2,693,544,897	4.78
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	40,807	41,014.59	1,673,682,782	49,481.05	2,019,173,452	3.58
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	84,103	21,550.58	1,812,468,766	23,964.39	2,015,477,933	3.58
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	224,930	7,726.52	1,737,927,943	8,890.72	1,999,789,650	3.55
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	83,742	21,708.41	1,817,906,172	21,647.59	1,812,813,319	3.22
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	445,956	3,521.19	1,570,299,732	3,259.34	1,453,525,975	2.58
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	54,628	22,671.33	1,238,489,743	25,418.19	1,388,544,993	2.46
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	269,495	4,094.94	1,103,566,934	4,787.08	1,290,096,281	2.29
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	75,646	12,745.29	964,130,661	16,216.15	1,226,687,034	2.18
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	36,654	29,233.67	1,071,531,013	32,312.11	1,184,368,446	2.10
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	89,049	9,659.60	860,178,433	10,720.99	954,693,617	1.69
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	104,486	7,254.47	757,991,597	8,850.17	924,719,489	1.64
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	148,523	5,140.39	763,467,629	5,244.65	778,952,043	1.38
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	16,581	40,326.80	668,658,671	43,157.64	715,596,829	1.27
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	30,157	20,173.53	608,373,325	23,327.28	703,480,783	1.25
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	40,600	16,843.13	683,831,322	17,060.33	692,649,642	1.23
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	32,188	16,889.47	543,638,325	19,248.26	619,563,122	1.10
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	181,762	2,845.32	517,171,054	3,204.42	582,442,515	1.03
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	172,244	2,715.00	467,642,460	3,331.84	573,890,827	1.02
イギリス	投資証券	SEGO PLC	345,087	1,733.46	598,195,546	1,640.40	566,081,197	1.00
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	70,286	6,285.76	441,801,489	7,425.34	521,897,728	0.93
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	48,293	9,081.85	438,590,072	10,415.46	502,994,003	0.89
アメリカ	投資証券	UDR INC	78,246	5,832.54	456,373,237	6,387.12	499,767,217	0.89
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	27,496	15,644.19	430,152,703	17,947.95	493,497,108	0.88
アメリカ	投資証券	MP CAREY INC	56,569	8,121.83	459,443,915	8,576.50	485,164,255	0.86
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	83,049	5,131.71	426,183,550	5,667.47	470,677,882	0.84
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	181,998	2,580.33	469,615,992	2,555.72	465,135,929	0.83
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,347,296	307.13	413,798,793	335.68	452,260,860	0.80

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.59
合計	99.59

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2024年 8月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	48,398,699,790	88.48
地方債証券	日本	1,811,366,010	3.31

特殊債券	日本	2,095,123,531	3.83
社債券	日本	2,221,929,449	4.06
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		175,404,633	0.32
合計（純資産総額）		54,702,523,413	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	700,000,000	100.47	703,297,000	100.01	700,084,000	0.300	2025/12/20	1.28
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	700,000,000	99.87	699,090,000	99.47	696,297,000	0.100	2026/9/20	1.27
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	680,000,000	99.54	676,919,600	99.23	674,818,400	0.100	2027/6/20	1.23
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	660,000,000	99.78	658,548,000	99.39	656,007,000	0.100	2026/12/20	1.20
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	645,000,000	99.94	644,658,150	99.56	642,174,900	0.100	2026/6/20	1.17
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	630,000,000	100.00	630,000,000	99.66	627,864,300	0.100	2026/3/20	1.15
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	610,000,000	100.65	613,965,000	100.13	610,793,000	0.400	2025/9/20	1.12
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	590,000,000	99.24	585,521,900	99.05	584,424,500	0.100	2027/12/20	1.07
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	580,000,000	96.68	560,784,600	97.45	565,215,800	0.100	2030/9/20	1.03
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	560,000,000	97.61	546,638,400	97.93	548,436,000	0.100	2029/12/20	1.00
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	540,000,000	99.06	534,967,200	98.95	534,335,400	0.100	2028/3/20	0.98
日本	国債証券	第372回利付国債(10年)	500,000,000	101.12	505,611,000	100.00	500,000,000	0.800	2033/9/20	0.91
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	500,000,000	99.40	497,005,000	99.15	495,775,000	0.100	2027/9/20	0.91
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	500,000,000	95.57	477,875,000	96.76	483,830,000	0.100	2031/6/20	0.88
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	500,000,000	95.18	475,940,000	96.48	482,435,000	0.100	2031/9/20	0.88
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	490,000,000	97.43	477,418,100	98.20	481,180,000	0.500	2032/12/20	0.88
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	480,000,000	96.49	463,182,700	96.83	464,788,800	0.400	2033/6/20	0.85
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	480,000,000	95.67	459,225,600	96.69	464,126,400	0.200	2032/3/20	0.85
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	460,000,000	99.67	458,482,000	99.31	456,867,400	0.100	2027/3/20	0.84
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	460,000,000	96.30	443,016,800	97.26	447,396,000	0.100	2030/12/20	0.82
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	450,000,000	95.06	427,781,400	96.08	432,360,000	0.200	2032/9/20	0.79
日本	国債証券	第373回利付国債(10年)	440,000,000	98.23	432,217,700	97.93	430,892,000	0.600	2033/12/20	0.79
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	435,000,000	98.87	430,084,500	98.82	429,875,700	0.100	2028/6/20	0.79
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	420,000,000	98.67	414,414,000	98.66	414,397,200	0.100	2028/9/20	0.76

日本	国債証券	第370回利付国債（10年）	420,000,000	96.87	406,854,000	97.95	411,402,600	0.500	2033/3/20	0.75
日本	国債証券	第359回利付国債（10年）	420,000,000	97.02	407,488,200	97.63	410,071,200	0.100	2030/6/20	0.75
日本	国債証券	第374回利付国債（10年）	410,000,000	98.03	401,941,600	99.42	407,646,600	0.800	2034/3/20	0.75
日本	国債証券	第367回利付国債（10年）	420,000,000	95.37	400,583,400	96.37	404,770,800	0.200	2032/6/20	0.74
日本	国債証券	第365回利付国債（10年）	410,000,000	95.19	390,290,800	96.20	394,424,100	0.100	2031/12/20	0.72
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	400,000,000	98.48	393,944,000	98.52	394,096,000	0.100	2028/12/20	0.72

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	88.48
地方債証券	3.31
特殊債券	3.83
社債券	4.06
合計	99.68

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

以下の運用状況は2024年 8月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	10,717,190,858	45.95
	カナダ	456,673,532	1.96
	メキシコ	158,287,227	0.68
	ドイツ	1,381,613,533	5.92
	イタリア	1,567,138,072	6.72
	フランス	1,713,138,481	7.34
	オランダ	306,219,181	1.31
	スペイン	1,008,925,743	4.33
	ベルギー	366,318,631	1.57
	オーストリア	249,030,558	1.07
	フィンランド	94,392,547	0.40
	アイルランド	122,403,695	0.52
	イギリス	1,226,238,102	5.26
	スウェーデン	57,777,870	0.25
	ノルウェー	44,093,993	0.19
	デンマーク	73,003,337	0.31
ポーランド	111,765,587	0.48	

	オーストラリア	282,993,549	1.21
	ニュージーランド	40,803,175	0.17
	シンガポール	94,665,821	0.41
	マレーシア	278,801,248	1.20
	中国	2,311,156,533	9.91
	イスラエル	46,352,760	0.20
	小計	22,708,984,033	97.36
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		616,012,387	2.64
合計（純資産総額）		23,324,996,420	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		22,936,731,278	98.34

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（％）	償還期限	投資比率（％）
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	13,677.37	437,675,955	14,141.18	452,517,839	2.250	2025/11/15	1.94
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	13,272.36	424,715,776	13,912.10	445,187,484	2.000	2026/11/15	1.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,100,000	13,311.40	279,539,528	13,914.65	292,207,805	1.625	2026/5/15	1.25
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,200,000	12,772.37	280,992,319	13,281.43	292,191,515	0.500	2027/4/30	1.25
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,100,000	11,791.06	247,612,344	12,892.57	270,744,014	1.500	2030/2/15	1.16
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,620,000	13,689.39	221,768,151	14,155.17	229,313,757	2.000	2025/8/15	0.98
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,740,000	12,184.92	212,017,608	13,106.09	228,046,038	0.625	2027/11/30	0.98
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	13,408.69	214,539,156	13,973.76	223,580,236	1.625	2026/2/15	0.96
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	12,872.74	205,963,925	13,651.06	218,417,015	2.375	2029/5/15	0.94
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	13,874.10	208,111,527	14,190.11	212,851,656	2.625	2025/12/31	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	13,211.85	198,177,841	14,023.82	210,357,331	2.875	2028/8/15	0.90
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	13,276.35	199,145,250	13,949.14	209,237,231	2.375	2027/5/15	0.90
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	10,994.04	186,898,703	12,182.99	207,110,901	0.625	2030/5/15	0.89
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	13,132.67	196,990,191	13,805.76	207,086,516	0.375	2025/11/30	0.89
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	14,825.09	163,076,078	14,793.34	162,726,819	4.125	2031/7/31	0.70
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	12,738.80	152,865,649	13,050.37	156,604,501	1.000	2028/7/31	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	13,301.22	146,313,493	13,946.88	153,415,788	2.250	2027/2/15	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	13,142.85	144,571,447	13,869.68	152,566,507	2.250	2027/8/15	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,150,000	12,270.35	141,109,048	13,204.78	151,855,083	1.250	2028/6/30	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	12,160.92	133,770,193	13,084.31	143,927,479	0.500	2027/10/31	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,270,000	9,658.04	122,657,161	11,305.14	143,575,331	2.875	2052/5/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	15,100.14	135,901,315	15,874.26	142,868,382	5.375	2031/2/15	0.61
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	950,000	14,610.44	138,799,212	14,864.63	141,214,058	1.500	2031/5/25	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	950,000	13,981.30	132,822,371	14,672.87	139,392,299	4.000	2030/2/28	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	13,366.34	133,663,432	13,729.12	137,291,251	0.500	2026/2/28	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	12,800.65	128,006,531	13,558.59	135,585,942	1.125	2027/2/28	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	12,906.60	129,066,032	13,383.53	133,835,310	1.875	2029/2/28	0.57

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	12,344.76	123,447,647	13,254.57	132,545,721	1.250	2028/4/30	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	13,315.80	119,842,272	14,501.48	130,513,395	3.875	2033/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	11,471.43	114,714,325	12,687.24	126,872,457	1.875	2032/2/15	0.54

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.36
合計	97.36

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	74,472,000.00	10,759,809,933	10,743,241,092	46.06
	加ドル	売建	4,309,000.00	485,642,371	461,071,073	1.98
	メキシコペソ	売建	22,257,000.00	186,406,656	160,152,520	0.69
	ユーロ	売建	43,017,000.00	6,786,025,512	6,885,183,135	29.52
	英ポンド	売建	6,503,000.00	1,275,322,640	1,235,407,153	5.30
	スウェーデンクローナ	売建	4,132,000.00	61,064,702	58,412,389	0.25
	ノルウェークローネ	売建	3,312,000.00	48,165,417	45,520,985	0.20
	デンマーククローネ	売建	3,603,000.00	81,509,166	77,206,429	0.33
	ポーランドズロチ	売建	3,056,000.00	115,308,687	113,454,357	0.49
	豪ドル	売建	2,916,000.00	305,641,884	285,354,053	1.22
	ニュージーランドドル	売建	460,000.00	40,966,767	41,312,192	0.18
	シンガポールドル	売建	893,000.00	103,261,751	98,914,247	0.42
	マレーシアリングット	売建	10,463,000.00	345,425,482	350,272,989	1.50
	中国元	売建	114,649,000.00	2,431,295,999	2,332,774,072	10.00
	イスラエルシュケル	売建	1,235,000.00	48,345,183	48,454,592	0.21

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報

運用実績

2024年8月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 10,921円
純資産総額…………… 6.62億円

※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)

2024年2月	設定来累計
0円	0円

主要な資産の状況

資産構成比率(マザーファンドの組入比率)

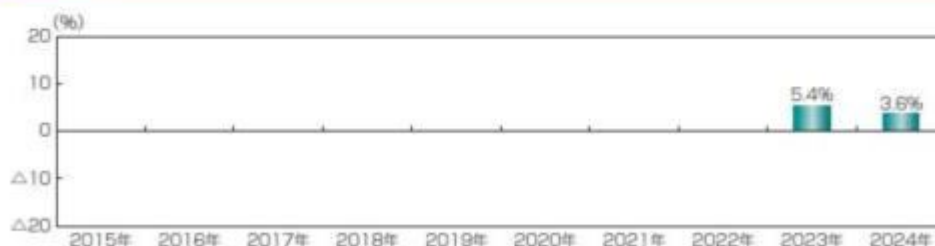
資産	比率	資産別比率
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)	17.1%	20.0%
海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)	2.0%	
日本株式インデックストPIX	0.9%	
海外リートインデックス(ヘッジなし)	12.4%	13.3%
日本リートインデックスJ-REIT	0.8%	
海外債券インデックス(ヘッジあり)	59.4%	66.5%
日本債券インデックス	7.0%	
現金その他	0.3%	

通貨別エクスポージャー

通貨	比率
アメリカドル	22.9%
ユーロ	2.0%
イギリスポンド	1.3%
オーストラリアドル	1.2%
カナダドル	0.7%
その他	71.9%

※比率は当ファンドの純資産総額比です。
※端数処理の関係で合計が100%とまらない場合があります。

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。

※2023年は、設定時から2023年末までの騰落率です。

※2024年は、2024年8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します。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、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。

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します。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5営業日目からお支払いします。
- (9) 受付の中止および取消
・委託会社は、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。

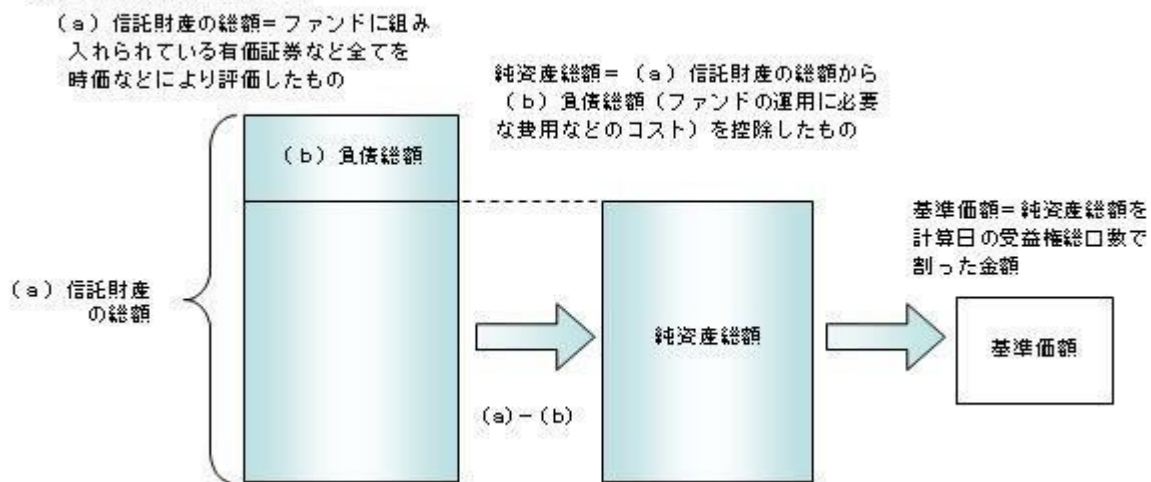
3【資産管理等の概要】

（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（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額算出の流れ >



有価証券などの評価基準

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

< 主な資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

国内上場不動産投信

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

海外上場不動産投信

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

公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。

- ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

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

- ・価格情報会社の提供する価額

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

* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

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（2023年2月10日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年2月8日から翌年2月7日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 受益者の解約により純資産総額が10億円を下回ることとなった場合
 - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。（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。

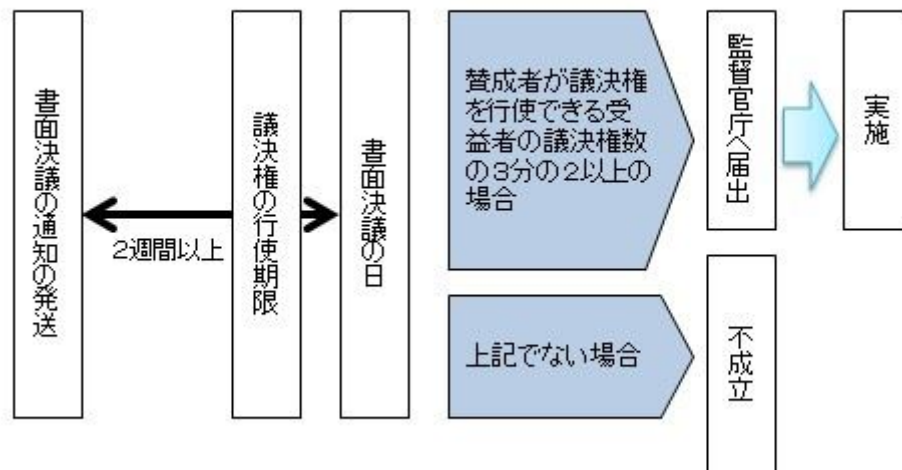
信託約款の変更など

 - 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、原則として知っている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

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

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、収益分配金および信託終了による償還金について、民法第166条第1項第1号または第2号に規定する期間が経過する日までにその支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、2023年 2月10日から2024年 2月 7日までであります。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（2023年 2月10日から2024年 2月 7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】

【Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期 2024年 2月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		3,093,348
親投資信託受益証券		334,608,174
流動資産合計		337,701,522
資産合計		337,701,522
負債の部		
流動負債		
未払解約金		1,183,928
未払受託者報酬		27,297
未払委託者報酬		108,072
その他未払費用		71,462
流動負債合計		1,390,759
負債合計		1,390,759
純資産の部		
元本等		
元本		319,498,800
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		16,811,963
（分配準備積立金）		9,388,329
元本等合計		336,310,763
純資産合計		336,310,763
負債純資産合計		337,701,522

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期 自 2023年 2月10日 至 2024年 2月 7日
営業収益	
有価証券売買等損益	11,975,064
営業収益合計	11,975,064
営業費用	
支払利息	322
受託者報酬	35,627
委託者報酬	141,241
その他費用	73,079
営業費用合計	250,269
営業利益又は営業損失（ ）	11,724,795
経常利益又は経常損失（ ）	11,724,795
当期純利益又は当期純損失（ ）	11,724,795
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（ ）	2,336,466
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,347,850
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	9,347,850
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,924,216
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,924,216
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（ ）	16,811,963

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		第1期 2024年 2月 7日現在
1.	期首元本額	10,000,000円
	期中追加設定元本額	477,437,224円
	期中一部解約元本額	167,938,424円
2.	受益権の総数	319,498,800口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

		第1期 自 2023年 2月10日 至 2024年 2月 7日
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	4,051,490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	5,336,839円
C	信託約款に定める収益調整金	7,423,634円
D	信託約款に定める分配準備積立金	0円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	16,811,963円
F	分配対象収益(1万口当たり)	526円
G	分配金額	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1期 自 2023年 2月10日 至 2024年 2月 7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。	
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。	
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。	

金融商品の時価等に関する事項

		第1期 2024年 2月 7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。	
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。	
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。	

(有価証券に関する注記)

第1期(2024年 2月 7日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	10,599,662
合計	10,599,662

(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1期 2024年 2月 7日現在

1口当たり純資産額	1.0526円
(1万口当たり純資産額)	(10,526円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI - KOKUSA I (ヘッジなし) マザーファンド	10,005,042	57,587,020	
	日本債券インデックスマザーファンド	18,651,516	25,026,604	
	海外債券インデックス(ヘッジあり) マザーファンド	149,526,443	197,539,383	
	日本株式インデックストップIXマザーファンド	1,245,112	3,254,473	
	日本リートインデックスJ - REITマザーファンド	1,205,746	2,961,071	
	海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド	13,203,549	41,374,641	
	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	2,706,692	6,864,982	
合計		196,544,100	334,608,174	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(参考)

日本株式インデックストップIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年 2月 7日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	116,511,544
株式	56,368,493,750
派生商品評価勘定	961,700
未収配当金	78,446,646
流動資産合計	56,564,413,640
資産合計	56,564,413,640
負債の部	
流動負債	
前受金	65,000
未払解約金	34,627,040
未払利息	8

2024年 2月 7日現在

流動負債合計	34,692,048
負債合計	34,692,048
純資産の部	
元本等	
元本	21,627,627,655
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	34,902,093,937
元本等合計	56,529,721,592
純資産合計	56,529,721,592
負債純資産合計	56,564,413,640

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	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。

(貸借対照表に関する注記)

		2024年 2月 7日現在
1.	期首	2023年 2月10日
	期首元本額	22,734,797,694円
	期首からの追加設定元本額	1,965,790,973円
	期首からの一部解約元本額	3,072,961,012円
	元本の内訳	
	DCインデックスバランス（株式20）	720,627,179円
	DCインデックスバランス（株式40）	2,006,343,878円
	DCインデックスバランス（株式60）	4,391,302,375円
	DCインデックスバランス（株式80）	5,418,426,275円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,830,560,657円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,484,497,509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）	454,670,687円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	1,245,112円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	725,924円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	342,931円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,643,072,775円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	198,577,410円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	593,241,634円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	928,346,391円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	955,646,918円
	計	21,627,627,655円
2.	受益権の総数	21,627,627,655口
3.	担保資産	
	デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。	
	株式	832,594,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2023年 2月10日 至 2024年 2月 7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。

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。
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。

金融商品の時価等に関する事項

	2024年 2月 7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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

(2024年 2月 7日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	7,109,103,555
合計	7,109,103,555

(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)

(2024年 2月 7日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	151,945,000	-	152,910,000	965,000
合計		151,945,000	-	152,910,000	965,000

(注) 1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2024年 2月 7日現在
1口当たり純資産額	2.6138円
(1万口当たり純資産額)	(26,138円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	800	4,105.00	3,284,000	
ニッスイ	22,000	901.80	19,839,600	
マルハニチロ	3,300	2,998.00	9,893,400	
雪国まいたけ	2,200	965.00	2,123,000	
カネコ種苗	700	1,432.00	1,002,400	
サカタのタネ	2,500	3,500.00	8,750,000	
ホクト	1,300	1,781.00	2,315,300	
ホクリヨウ	100	1,051.00	105,100	
住石ホールディングス	2,700	1,795.00	4,846,500	
日鉄鉱業	700	5,150.00	3,605,000	
三井松島ホールディングス	1,500	2,794.00	4,191,000	
I N P E X	80,700	2,024.50	163,377,150	
石油資源開発	2,600	6,030.00	15,678,000	
K & O エナジーグループ	800	2,286.00	1,828,800	
ショーボンドホールディングス	3,000	6,521.00	19,563,000	
ミライト・ワン	7,100	1,970.50	13,990,550	
日本アクア	1,300	1,037.00	1,348,100	
キャンディル	1,000	585.00	585,000	
ダイセキ環境ソリューション	500	1,036.00	518,000	
第一カッター興業	1,300	1,470.00	1,911,000	
安藤・間	12,900	1,237.00	15,957,300	
東急建設	7,400	830.00	6,142,000	
コムシスホールディングス	6,900	3,199.00	22,073,100	
ビーアールホールディングス	4,700	372.00	1,748,400	
高松コンストラクショングループ	1,500	2,968.00	4,452,000	
東建コーポレーション	500	9,560.00	4,780,000	
ソネック	500	946.00	473,000	
ヤマウラ	1,400	1,579.00	2,210,600	
オリエンタル白石	9,600	360.00	3,456,000	
大成建設	14,300	5,592.00	79,965,600	
大林組	54,600	1,431.00	78,132,600	
清水建設	43,100	1,048.00	45,168,800	
飛鳥建設	1,400	1,511.00	2,115,400	
長谷工コーポレーション	14,200	1,918.00	27,235,600	
松井建設	1,200	850.00	1,020,000	
鹿島建設	34,000	2,774.00	94,316,000	
不動テトラ	1,200	2,265.00	2,718,000	
大末建設	100	1,449.00	144,900	
鉄建建設	1,300	2,218.00	2,883,400	

西松建設	2,900	4,458.00	12,928,200
三井住友建設	10,000	413.00	4,130,000
大豊建設	500	3,835.00	1,917,500
奥村組	2,500	5,270.00	13,175,000
東鉄工業	2,000	2,988.00	5,976,000
イチケン	400	2,409.00	963,600
浅沼組	1,200	4,285.00	5,142,000
戸田建設	20,400	957.10	19,524,840
熊谷組	2,500	3,940.00	9,850,000
北野建設	100	3,100.00	310,000
植木組	100	1,757.00	175,700
矢作建設工業	2,000	1,458.00	2,916,000
ピーエス三菱	2,300	1,008.00	2,318,400
日本ハウスホールディングス	2,300	303.00	696,900
新日本建設	2,500	1,274.00	3,185,000
東亜道路工業	600	6,870.00	4,122,000
日本道路	1,700	2,085.00	3,544,500
東亜建設工業	1,300	3,785.00	4,920,500
日本国土開発	3,500	529.00	1,851,500
若築建設	700	3,075.00	2,152,500
東洋建設	4,100	1,257.00	5,153,700
五洋建設	21,100	810.40	17,099,440
福田組	500	5,390.00	2,695,000
住友林業	13,300	4,329.00	57,575,700
巴コーポレーション	1,900	612.00	1,162,800
大和ハウス工業	42,300	4,400.00	186,120,000
ライト工業	3,400	2,060.00	7,004,000
積水ハウス	46,400	3,263.00	151,403,200
日特建設	1,900	1,213.00	2,304,700
北陸電気工事	800	1,273.00	1,018,400
ユアテック	3,200	1,374.00	4,396,800
日本リーテック	1,100	1,319.00	1,450,900
四電工	800	3,920.00	3,136,000
中電工	2,200	2,880.00	6,336,000
関電工	9,800	1,617.00	15,846,600
きんでん	10,700	2,664.50	28,510,150
東京エネシス	1,200	1,151.00	1,381,200
トーエネック	400	5,400.00	2,160,000
住友電設	1,700	3,195.00	5,431,500
日本電設工業	2,800	2,090.00	5,852,000
エクシオグループ	7,600	3,306.00	25,125,600
新日本空調	1,100	2,679.00	2,946,900

九電工	3,400	5,818.00	19,781,200
三機工業	3,500	1,878.00	6,573,000
日揮ホールディングス	15,000	1,746.00	26,190,000
中外炉工業	700	2,664.00	1,864,800
ヤマト	400	993.00	397,200
太平電業	1,000	4,425.00	4,425,000
高砂熱学工業	4,200	3,655.00	15,351,000
三晃金属工業	200	4,925.00	985,000
朝日工業社	900	3,190.00	2,871,000
明星工業	2,800	1,136.00	3,180,800
大気社	1,800	4,485.00	8,073,000
ダイダン	1,900	1,718.00	3,264,200
日比谷総合設備	1,300	2,665.00	3,464,500
テスホールディングス	4,300	447.00	1,922,100
インフロニア・ホールディングス	17,800	1,536.00	27,340,800
東洋エンジニアリング	1,800	809.00	1,456,200
レイズネクスト	2,500	1,575.00	3,937,500
ニッポン	4,700	2,294.00	10,781,800
日清製粉グループ本社	14,300	2,087.00	29,844,100
日東富士製粉	400	5,210.00	2,084,000
昭和産業	1,600	3,325.00	5,320,000
鳥越製粉	100	708.00	70,800
中部飼料	1,700	1,205.00	2,048,500
フィード・ワン	2,500	988.00	2,470,000
東洋精糖	300	2,320.00	696,000
日本甜菜製糖	700	2,154.00	1,507,800
D M三井製糖ホールディングス	1,700	3,270.00	5,559,000
塩水港精糖	2,100	304.00	638,400
ウェルネオシュガー	800	2,313.00	1,850,400
森永製菓	6,700	2,830.00	18,961,000
中村屋	300	3,130.00	939,000
江崎グリコ	4,300	4,260.00	18,318,000
名糖産業	500	1,760.00	880,000
井村屋グループ	1,100	2,468.00	2,714,800
不二家	900	2,461.00	2,214,900
山崎製パン	10,300	3,571.00	36,781,300
モロゾフ	600	4,010.00	2,406,000
亀田製菓	800	4,540.00	3,632,000
寿スピリッツ	7,500	1,925.00	14,437,500
カルビー	7,100	3,146.00	22,336,600
森永乳業	5,500	2,991.50	16,453,250
六甲バター	700	1,324.00	926,800

ヤクルト本社	22,000	3,140.00	69,080,000
明治ホールディングス	18,800	3,615.00	67,962,000
雪印メグミルク	3,800	2,304.00	8,755,200
プリマハム	2,100	2,327.00	4,886,700
日本ハム	6,600	5,218.00	34,438,800
林兼産業	300	589.00	176,700
丸大食品	1,100	1,689.00	1,857,900
S Foods	1,800	3,230.00	5,814,000
柿安本店	400	2,590.00	1,036,000
伊藤ハム米久ホールディングス	2,400	4,215.00	10,116,000
サッポロホールディングス	5,000	6,705.00	33,525,000
アサヒグループホールディングス	35,500	5,600.00	198,800,000
キリンホールディングス	63,800	2,126.00	135,638,800
宝ホールディングス	10,600	1,229.50	13,032,700
オエノンホールディングス	5,000	369.00	1,845,000
養命酒製造	400	1,876.00	750,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,700	1,992.00	23,306,400
ライフドリンク カンパニー	300	5,980.00	1,794,000
サントリー食品インターナショナル	10,800	4,922.00	53,157,600
ダイドーグループホールディングス	1,600	2,911.00	4,657,600
伊藤園	5,300	4,234.00	22,440,200
キーコーヒー	1,500	2,061.00	3,091,500
ユニカフェ	400	905.00	362,000
ジャパンフーズ	100	1,408.00	140,800
日清オイリオグループ	2,200	4,610.00	10,142,000
不二製油グループ本社	3,600	2,358.00	8,488,800
J - オイルミルズ	1,600	2,086.00	3,337,600
キッコーマン	10,200	9,072.00	92,534,400
味の素	36,400	5,658.00	205,951,200
ブルドックソース	600	2,110.00	1,266,000
キューピー	8,300	2,627.50	21,808,250
ハウス食品グループ本社	5,300	3,142.00	16,652,600
カゴメ	6,700	3,638.00	24,374,600
アリアケジャパン	1,500	4,610.00	6,915,000
エバラ食品工業	500	2,941.00	1,470,500
やまみ	200	4,085.00	817,000
ニチレイ	7,100	3,750.00	26,625,000
東洋水産	7,800	8,053.00	62,813,400
イトアンドホールディングス	800	2,137.00	1,709,600
大冷	300	1,945.00	583,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	300	1,172.00	351,600
日清食品ホールディングス	16,200	4,733.00	76,674,600

永谷園ホールディングス	900	2,269.00	2,042,100
フジッコ	1,400	1,966.00	2,752,400
ロック・フィールド	1,600	1,615.00	2,584,000
日本たばこ産業	93,200	3,939.00	367,114,800
ケンコーマヨネーズ	700	1,827.00	1,278,900
わらべや日洋ホールディングス	900	2,841.00	2,556,900
なとり	800	2,177.00	1,741,600
イフジ産業	400	1,414.00	565,600
ファーマフーズ	2,800	997.00	2,791,600
ユーグレナ	8,600	658.00	5,658,800
紀文食品	1,000	1,172.00	1,172,000
ピククルスホールディングス	1,200	1,295.00	1,554,000
理研ビタミン	1,500	2,322.00	3,483,000
片倉工業	1,400	1,787.00	2,501,800
グンゼ	1,100	5,560.00	6,116,000
東洋紡	6,400	1,114.00	7,129,600
ユニチカ	3,900	165.00	643,500
富士紡ホールディングス	600	4,280.00	2,568,000
倉敷紡績	1,000	3,060.00	3,060,000
シキボウ	800	1,202.00	961,600
日本毛織	4,200	1,404.00	5,896,800
ダイドーリミテッド	3,000	585.00	1,755,000
帝国繊維	1,700	2,150.00	3,655,000
帝人	14,700	1,364.00	20,050,800
東レ	104,300	746.50	77,859,950
住江織物	100	2,416.00	241,600
セーレン	3,100	2,458.00	7,619,800
小松マテーレ	2,000	784.00	1,568,000
ワコールホールディングス	3,100	3,474.00	10,769,400
ホギメディカル	2,100	3,395.00	7,129,500
クラウディアホールディングス	1,500	406.00	609,000
T S Iホールディングス	4,600	680.00	3,128,000
マツオカコーポレーション	200	1,710.00	342,000
ワールド	2,500	1,990.00	4,975,000
三陽商会	600	2,833.00	1,699,800
オンワードホールディングス	9,900	542.00	5,365,800
ルックホールディングス	500	2,688.00	1,344,000
ゴールドウイン	2,900	9,427.00	27,338,300
デサント	2,800	3,300.00	9,240,000
特種東海製紙	800	3,940.00	3,152,000
王子ホールディングス	65,100	576.20	37,510,620
日本製紙	8,600	1,376.00	11,833,600

三菱製紙	700	619.00	433,300	
北越コーポレーション	7,600	1,373.00	10,434,800	
中越パルプ工業	400	2,008.00	803,200	
大王製紙	6,600	1,143.00	7,543,800	
レンゴー	14,700	1,030.00	15,141,000	
トモク	900	2,295.00	2,065,500	
ザ・パック	1,300	3,380.00	4,394,000	
北の達人コーポレーション	8,300	232.00	1,925,600	
クラレ	22,600	1,553.00	35,097,800	
旭化成	105,500	1,038.50	109,561,750	
レゾナック・ホールディングス	15,000	2,952.50	44,287,500	
住友化学	114,800	307.50	35,301,000	
住友精化	700	4,980.00	3,486,000	
日産化学	7,400	6,142.00	45,450,800	
ラサ工業	800	2,281.00	1,824,800	
クレハ	3,300	2,825.00	9,322,500	
多木化学	500	3,170.00	1,585,000	
テイカ	1,200	1,414.00	1,696,800	
石原産業	2,400	1,567.00	3,760,800	
日本曹達	1,900	5,770.00	10,963,000	
東ソー	20,700	1,913.50	39,609,450	
トクヤマ	4,900	2,258.50	11,066,650	
セントラル硝子	1,900	2,911.00	5,530,900	
東亜合成	7,300	1,539.50	11,238,350	
大阪ソーダ	1,100	10,890.00	11,979,000	
関東電化工業	2,700	909.00	2,454,300	
デンカ	5,500	2,441.00	13,425,500	
信越化学工業	141,500	5,828.00	824,662,000	代用有価証券 24,000株
日本カーバイド工業	500	1,562.00	781,000	
堺化学工業	900	1,924.00	1,731,600	
第一稀元素化学工業	1,400	971.00	1,359,400	
エア・ウォーター	14,800	2,034.00	30,103,200	
日本酸素ホールディングス	15,100	4,148.00	62,634,800	
日本化学工業	400	1,965.00	786,000	
東邦アセチレン	500	375.00	187,500	
日本パーカラライジング	6,800	1,234.00	8,391,200	
高圧ガス工業	2,200	864.00	1,900,800	
四国化成ホールディングス	2,200	1,759.00	3,869,800	
戸田工業	900	1,617.00	1,455,300	
ステラ ケミファ	700	3,290.00	2,303,000	
保土谷化学工業	400	3,585.00	1,434,000	
日本触媒	2,200	5,583.00	12,282,600	

大日精化工業	1,000	2,736.00	2,736,000
カネカ	3,900	3,575.00	13,942,500
三菱瓦斯化学	11,600	2,356.00	27,329,600
三井化学	12,900	4,150.00	53,535,000
J S R	16,900	3,980.00	67,262,000
東京応化工業	7,400	3,519.00	26,040,600
大阪有機化学工業	1,200	3,005.00	3,606,000
三菱ケミカルグループ	114,100	860.30	98,160,230
K Hネオケム	2,600	2,370.00	6,162,000
ダイセル	20,200	1,446.00	29,209,200
住友ベークライト	2,200	7,469.00	16,431,800
積水化学工業	31,400	2,060.00	64,684,000
日本ゼオン	10,400	1,281.50	13,327,600
アイカ工業	4,100	3,480.00	14,268,000
U B E	7,300	2,527.50	18,450,750
積水樹脂	2,500	2,576.00	6,440,000
タキロンシーアイ	3,500	622.00	2,177,000
旭有機材	1,200	3,805.00	4,566,000
ニチバン	1,100	1,762.00	1,938,200
リケンテクノス	3,200	981.00	3,139,200
大倉工業	900	3,000.00	2,700,000
積水化成成品工業	1,700	458.00	778,600
群栄化学工業	300	3,500.00	1,050,000
タイガースポリマー	100	982.00	98,200
ミライアル	100	1,520.00	152,000
ダイキョーニシカワ	3,000	741.00	2,223,000
森六ホールディングス	700	2,868.00	2,007,600
恵和	1,500	1,429.00	2,143,500
日本化薬	11,700	1,274.50	14,911,650
カーリットホールディングス	1,500	978.00	1,467,000
日本精化	1,000	2,831.00	2,831,000
扶桑化学工業	1,800	4,590.00	8,262,000
トリケミカル研究所	1,800	3,795.00	6,831,000
A D E K A	5,400	2,876.50	15,533,100
日油	4,800	7,100.00	34,080,000
ハリマ化成グループ	700	896.00	627,200
花王	35,300	5,748.00	202,904,400
第一工業製薬	400	2,966.00	1,186,400
石原ケミカル	700	1,898.00	1,328,600
ニイタカ	100	1,892.00	189,200
三洋化成工業	900	4,180.00	3,762,000
大日本塗料	2,200	1,156.00	2,543,200

日本ペイントホールディングス	83,100	1,164.00	96,728,400
関西ペイント	15,400	2,345.00	36,113,000
中国塗料	3,500	1,947.00	6,814,500
日本特殊塗料	400	1,360.00	544,000
藤倉化成	1,300	469.00	609,700
太陽ホールディングス	2,700	3,060.00	8,262,000
D I C	6,000	2,801.50	16,809,000
サカタインクス	3,300	1,421.00	4,689,300
a r t i e n c e	3,300	2,772.00	9,147,600
T & K T O K A	1,300	1,407.00	1,829,100
富士フィルムホールディングス	29,000	9,832.00	285,128,000
資生堂	32,700	4,220.00	137,994,000
ライオン	20,400	1,304.50	26,611,800
高砂香料工業	1,100	3,635.00	3,998,500
マンダム	3,300	1,315.00	4,339,500
ミルボン	2,200	3,482.00	7,660,400
ファンケル	7,100	2,217.00	15,740,700
コーセー	3,200	9,384.00	30,028,800
コタ	1,900	1,569.00	2,981,100
ポーラ・オルビスホールディングス	8,300	1,538.00	12,765,400
ノエビアホールディングス	1,600	5,180.00	8,288,000
新日本製薬	1,400	1,786.00	2,500,400
I - n e	700	2,352.00	1,646,400
アクシージア	1,600	847.00	1,355,200
エステー	1,500	1,529.00	2,293,500
アグロ カネショウ	500	1,319.00	659,500
コニシ	4,500	1,319.00	5,935,500
長谷川香料	2,900	3,315.00	9,613,500
小林製薬	4,600	6,360.00	29,256,000
荒川化学工業	1,000	1,122.00	1,122,000
メック	1,300	4,345.00	5,648,500
日本高純度化学	300	2,691.00	807,300
タカラバイオ	4,500	1,228.00	5,526,000
J C U	1,800	3,795.00	6,831,000
新田ゼラチン	400	758.00	303,200
O A T アグリオ	1,000	1,899.00	1,899,000
デクセリアルズ	4,000	5,364.00	21,456,000
アース製薬	1,400	4,590.00	6,426,000
北興化学工業	1,400	1,051.00	1,471,400
大成ラミック	400	3,090.00	1,236,000
クミアイ化学工業	6,800	842.00	5,725,600
日本農薬	2,500	683.00	1,707,500

アキレス	700	1,566.00	1,096,200
有沢製作所	2,500	1,123.00	2,807,500
日東電工	10,000	12,860.00	128,600,000
レック	1,800	1,044.00	1,879,200
三光合成	1,700	668.00	1,135,600
藤森工業	1,200	4,005.00	4,806,000
前澤化成工業	800	1,605.00	1,284,000
未来工業	500	4,895.00	2,447,500
J S P	1,100	2,136.00	2,349,600
エフピコ	3,200	2,948.00	9,433,600
天馬	1,000	2,308.00	2,308,000
信越ポリマー	3,300	1,610.00	5,313,000
東リ	1,700	399.00	678,300
ニフコ	4,600	3,792.00	17,443,200
バルカー	1,400	4,240.00	5,936,000
ユニ・チャーム	32,800	5,255.00	172,364,000
協和キリン	19,000	2,268.00	43,092,000
武田薬品工業	138,300	4,219.00	583,487,700
アステラス製薬	137,100	1,621.50	222,307,650
住友ファーマ	10,100	345.00	3,484,500
塩野義製薬	19,700	7,049.00	138,865,300
日本新薬	4,200	5,110.00	21,462,000
中外製薬	48,900	5,193.00	253,937,700
科研製薬	2,600	3,511.00	9,128,600
エーザイ	19,000	6,521.00	123,899,000
ロート製薬	15,200	3,018.00	45,873,600
小野薬品工業	33,300	2,517.50	83,832,750
久光製薬	3,400	4,164.00	14,157,600
持田製薬	1,700	3,170.00	5,389,000
参天製薬	28,700	1,433.50	41,141,450
扶桑薬品工業	500	2,212.00	1,106,000
ツムラ	5,000	2,933.50	14,667,500
キッセイ薬品工業	2,500	3,160.00	7,900,000
生化学工業	2,200	773.00	1,700,600
栄研化学	3,000	1,939.00	5,817,000
鳥居薬品	700	3,675.00	2,572,500
J C R ファーマ	5,700	1,000.00	5,700,000
東和薬品	2,300	2,667.00	6,134,100
富士製薬工業	1,400	1,975.00	2,765,000
ゼリア新薬工業	2,400	2,211.00	5,306,400
そーせいグループ	4,700	1,430.00	6,721,000
第一三共	136,100	4,512.00	614,083,200

杏林製薬	3,300	1,764.00	5,821,200
大幸薬品	1,900	306.00	581,400
ダイト	1,000	1,976.00	1,976,000
大塚ホールディングス	32,500	5,630.00	182,975,000
大正製薬ホールディングス	3,400	8,598.00	29,233,200
ペプチドリーム	7,900	1,301.50	10,281,850
セルソース	1,100	1,308.00	1,438,800
あすか製薬ホールディングス	1,800	1,902.00	3,423,600
サワイグループホールディングス	3,600	5,695.00	20,502,000
日本コークス工業	14,700	128.00	1,881,600
ニチレキ	2,200	2,445.00	5,379,000
ユシロ化学工業	800	2,068.00	1,654,400
ビーピー・カストロール	800	866.00	692,800
富士石油	3,600	370.00	1,332,000
MORESCO	600	1,436.00	861,600
出光興産	86,500	814.60	70,462,900
ENEOSホールディングス	246,600	594.70	146,653,020
コスモエネルギーホールディングス	4,600	6,035.00	27,761,000
横浜ゴム	7,800	3,545.00	27,651,000
TOYO TIRE	9,200	2,556.00	23,515,200
ブリヂストン	45,800	6,341.00	290,417,800
住友ゴム工業	15,000	1,740.00	26,100,000
藤倉コンポジット	1,400	1,441.00	2,017,400
オカモト	800	4,875.00	3,900,000
フコク	700	1,497.00	1,047,900
ニッタ	1,700	3,695.00	6,281,500
住友理工	2,300	1,202.00	2,764,600
三ツ星ベルト	1,800	4,775.00	8,595,000
バンドー化学	2,200	1,760.00	3,872,000
日東紡績	1,900	5,020.00	9,538,000
AGC	13,900	5,677.00	78,910,300
日本板硝子	7,200	608.00	4,377,600
石塚硝子	100	3,510.00	351,000
日本山村硝子	700	1,462.00	1,023,400
日本電気硝子	6,200	3,523.00	21,842,600
オハラ	500	1,155.00	577,500
住友大阪セメント	2,500	3,745.00	9,362,500
太平洋セメント	9,100	3,113.00	28,328,300
日本ヒューム	1,100	904.00	994,400
日本コンクリート工業	2,200	473.00	1,040,600
三谷セキサン	800	5,240.00	4,192,000
アジアパイルホールディングス	2,700	812.00	2,192,400

東海カーボン	14,200	1,031.00	14,640,200
日本カーボン	800	4,420.00	3,536,000
東洋炭素	1,000	5,020.00	5,020,000
ノリタケカンパニーリミテド	800	7,890.00	6,312,000
TOTO	10,300	3,743.00	38,552,900
日本碍子	18,100	1,860.00	33,666,000
日本特殊陶業	13,100	4,229.00	55,399,900
ダントーホールディングス	200	948.00	189,600
MARUWA	600	30,700.00	18,420,000
品川リフラクトリーズ	2,300	2,039.00	4,689,700
黒崎播磨	400	12,890.00	5,156,000
ヨータイ	1,300	1,459.00	1,896,700
東京窯業	500	517.00	258,500
フジインコーポレーテッド	4,300	3,375.00	14,512,500
エーアンドエーマテリアル	500	1,385.00	692,500
ニチアス	4,000	3,440.00	13,760,000
ニチハ	1,900	3,305.00	6,279,500
日本製鉄	72,000	3,565.00	256,680,000
神戸製鋼所	32,400	2,068.00	67,003,200
合同製鐵	1,000	5,860.00	5,860,000
JFEホールディングス	44,800	2,320.50	103,958,400
東京製鐵	4,800	1,741.00	8,356,800
共英製鋼	1,800	2,142.00	3,855,600
大和工業	3,100	8,469.00	26,253,900
東京鐵鋼	800	5,380.00	4,304,000
大阪製鐵	600	2,208.00	1,324,800
淀川製鋼所	1,800	3,940.00	7,092,000
中部鋼鈹	1,400	2,439.00	3,414,600
丸一鋼管	4,900	3,821.00	18,722,900
モリ工業	400	4,885.00	1,954,000
大同特殊鋼	9,700	1,678.50	16,281,450
日本高周波鋼業	1,600	554.00	886,400
日本冶金工業	1,400	4,260.00	5,964,000
山陽特殊製鋼	1,500	2,209.00	3,313,500
愛知製鋼	900	3,465.00	3,118,500
大平洋金属	1,100	1,358.00	1,493,800
新日本電工	6,900	283.00	1,952,700
栗本鐵工所	700	3,670.00	2,569,000
三菱製鋼	1,000	1,671.00	1,671,000
日亜鋼業	200	333.00	66,600
日本精線	400	5,510.00	2,204,000
エンビプロ・ホールディングス	1,300	591.00	768,300

シンニッタン	300	274.00	82,200
新家工業	200	3,205.00	641,000
大紀アルミニウム工業所	2,000	1,229.00	2,458,000
日本軽金属ホールディングス	4,500	1,722.00	7,749,000
三井金属鉱業	4,600	4,864.00	22,374,400
東邦亜鉛	900	1,119.00	1,007,100
三菱マテリアル	11,400	2,771.00	31,589,400
住友金属鉱山	18,600	4,004.00	74,474,400
D O W Aホールディングス	3,900	5,084.00	19,827,600
古河機械金属	2,500	1,920.00	4,800,000
エス・サイエンス	24,400	22.00	536,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	3,200	2,791.00	8,931,200
東邦チタニウム	3,300	1,860.00	6,138,000
U A C J	2,200	4,145.00	9,119,000
C Kサンエツ	400	3,850.00	1,540,000
古河電気工業	5,200	2,759.50	14,349,400
住友電気工業	59,900	2,073.50	124,202,650
フジクラ	18,800	1,242.00	23,349,600
S W C C	2,000	3,120.00	6,240,000
タツタ電線	2,800	688.00	1,926,400
カナレ電気	400	1,691.00	676,400
平河ヒューテック	900	1,366.00	1,229,400
リョービ	1,500	2,761.00	4,141,500
アーレスティ	600	768.00	460,800
A R Eホールディングス	6,300	1,939.00	12,215,700
稲葉製作所	800	1,517.00	1,213,600
宮地エンジニアリンググループ	900	3,510.00	3,159,000
トーカロ	5,100	1,529.00	7,797,900
S U M C O	28,900	2,260.00	65,314,000
川田テクノロジーズ	400	7,590.00	3,036,000
R S Technologies	1,300	2,802.00	3,642,600
ジェイテックコーポレーション	300	2,034.00	610,200
信和	400	762.00	304,800
東洋製罐グループホールディングス	9,100	2,404.00	21,876,400
ホッカンホールディングス	600	1,852.00	1,111,200
コロナ	800	953.00	762,400
横河ブリッジホールディングス	2,700	2,847.00	7,686,900
三和ホールディングス	16,300	2,358.50	38,443,550
文化シャッター	4,500	1,488.00	6,696,000
三協立山	1,600	913.00	1,460,800
アルインコ	1,200	1,043.00	1,251,600
東洋シャッター	800	731.00	584,800

LIXIL	25,000	1,960.00	49,000,000
日本フィルコン	200	549.00	109,800
ノーリツ	2,500	1,577.00	3,942,500
長府製作所	1,500	2,105.00	3,157,500
リンナイ	7,700	3,249.00	25,017,300
ダイニチ工業	100	705.00	70,500
日東精工	2,000	547.00	1,094,000
三洋工業	300	3,285.00	985,500
岡部	2,500	797.00	1,992,500
ジーテクト	1,900	2,113.00	4,014,700
東プレ	2,700	2,235.00	6,034,500
高周波熱錬	2,100	1,058.00	2,221,800
東京製綱	1,400	1,358.00	1,901,200
サンコール	1,000	480.00	480,000
パイオラックス	1,900	2,664.00	5,061,600
エイチワン	1,300	898.00	1,167,400
日本発條	14,000	1,240.00	17,360,000
中央発條	900	747.00	672,300
立川ブラインド工業	800	1,482.00	1,185,600
三益半導体工業	1,400	3,205.00	4,487,000
日本ドライケミカル	500	2,912.00	1,456,000
日本製鋼所	4,300	2,345.50	10,085,650
三浦工業	6,600	2,793.50	18,437,100
タクマ	5,200	1,728.00	8,985,600
ツガミ	3,900	1,209.00	4,715,100
オークマ	1,400	6,908.00	9,671,200
芝浦機械	1,600	3,375.00	5,400,000
アマダ	25,000	1,589.00	39,725,000
アイダエンジニアリング	3,200	844.00	2,700,800
F U J I	7,300	2,474.00	18,060,200
牧野フライス製作所	1,700	5,710.00	9,707,000
オーエスジー	6,900	2,003.50	13,824,150
旭ダイヤモンド工業	3,300	866.00	2,857,800
D M G 森精機	9,500	3,272.00	31,084,000
ソディック	3,300	720.00	2,376,000
ディスコ	7,600	42,850.00	325,660,000
日東工器	700	1,974.00	1,381,800
日進工具	1,900	1,032.00	1,960,800
富士ダイス	800	712.00	569,600
リケンN P R	1,600	2,742.00	4,387,200
東洋機械金属	100	718.00	71,800
島精機製作所	2,300	1,404.00	3,229,200

オプトラン	2,500	1,742.00	4,355,000
イワキポンプ	1,200	2,309.00	2,770,800
フリュー	1,800	1,288.00	2,318,400
ヤマシンフィルタ	2,800	361.00	1,010,800
日阪製作所	1,400	997.00	1,395,800
やまびこ	2,400	1,617.00	3,880,800
野村マイクロ・サイエンス	600	13,250.00	7,950,000
平田機工	700	6,990.00	4,893,000
P E G A S U S	1,200	444.00	532,800
マルマエ	500	1,802.00	901,000
タツモ	1,100	3,090.00	3,399,000
ナプテスコ	9,700	2,819.50	27,349,150
三井海洋開発	1,800	2,284.00	4,111,200
レオン自動機	1,900	1,501.00	2,851,900
S M C	4,700	79,080.00	371,676,000
ホソカワミクロン	1,100	4,625.00	5,087,500
ユニオンツール	600	3,275.00	1,965,000
瑞光	1,100	1,864.00	2,050,400
オイレス工業	2,000	2,078.00	4,156,000
日精エー・エス・ビー機械	600	4,195.00	2,517,000
サトーホールディングス	2,100	2,124.00	4,460,400
技研製作所	1,300	2,057.00	2,674,100
日本エアテック	800	1,223.00	978,400
日精樹脂工業	900	1,168.00	1,051,200
オカダアイヨン	500	2,724.00	1,362,000
ワイエイシイホールディングス	500	2,325.00	1,162,500
小松製作所	73,800	4,299.00	317,266,200
住友重機械工業	9,300	3,933.00	36,576,900
日立建機	6,400	4,227.00	27,052,800
日工	2,000	761.00	1,522,000
巴工業	600	3,630.00	2,178,000
井関農機	1,200	1,192.00	1,430,400
T O W A	1,700	7,730.00	13,141,000
丸山製作所	100	2,776.00	277,600
北川鉄工所	500	1,490.00	745,000
ローツェ	900	18,220.00	16,398,000
タカキタ	900	497.00	447,300
クボタ	82,400	2,217.50	182,722,000
荏原実業	1,000	3,210.00	3,210,000
三菱化工機	500	3,685.00	1,842,500
月島ホールディングス	1,900	1,358.00	2,580,200
帝国電機製作所	1,200	2,886.00	3,463,200

新東工業	3,000	1,114.00	3,342,000
澁谷工業	1,400	2,481.00	3,473,400
アイチ コーポレーション	2,600	1,106.00	2,875,600
小森コーポレーション	3,500	1,279.00	4,476,500
鶴見製作所	1,300	3,550.00	4,615,000
酒井重工業	200	6,810.00	1,362,000
荏原製作所	6,400	9,487.00	60,716,800
石井鐵工所	200	2,708.00	541,600
西島製作所	1,500	2,495.00	3,742,500
北越工業	1,800	2,453.00	4,415,400
ダイキン工業	18,800	21,165.00	397,902,000
オルガノ	2,000	6,430.00	12,860,000
トーヨーカネツ	500	4,275.00	2,137,500
栗田工業	8,800	5,499.00	48,391,200
椿本チエイン	2,200	4,665.00	10,263,000
木村化工機	1,300	728.00	946,400
アネスト岩田	2,700	1,299.00	3,507,300
ダイフク	26,700	2,867.50	76,562,250
サムコ	500	4,710.00	2,355,000
加藤製作所	300	1,520.00	456,000
タダノ	8,700	1,175.50	10,226,850
フジテック	3,600	3,650.00	13,140,000
C K D	4,300	2,519.00	10,831,700
平和	4,800	2,194.00	10,531,200
理想科学工業	1,200	3,020.00	3,624,000
S A N K Y O	3,700	9,000.00	33,300,000
日本金銭機械	2,100	1,444.00	3,032,400
マースグループホールディングス	1,000	2,705.00	2,705,000
フクシマガリレイ	1,100	5,110.00	5,621,000
オーイズミ	1,300	450.00	585,000
ダイコク電機	1,000	3,590.00	3,590,000
竹内製作所	3,000	5,080.00	15,240,000
アマノ	4,500	3,664.00	16,488,000
J U K I	1,900	461.00	875,900
ジャノメ	1,200	719.00	862,800
マックス	2,200	3,140.00	6,908,000
グローリー	3,600	2,952.00	10,627,200
新晃工業	1,700	2,936.00	4,991,200
大和冷機工業	2,400	1,526.00	3,662,400
セガサミーホールディングス	14,500	2,184.00	31,668,000
T P R	1,800	2,104.00	3,787,200
ツバキ・ナカシマ	2,600	746.00	1,939,600

ホシザキ	9,200	5,377.00	49,468,400	
大豊工業	1,100	831.00	914,100	
日本精工	28,700	797.30	22,882,510	
NTN	32,500	283.40	9,210,500	
ジェイテクト	13,700	1,392.50	19,077,250	
不二越	1,100	3,390.00	3,729,000	
日本トムソン	3,800	594.00	2,257,200	
THK	8,900	2,690.50	23,945,450	
ユーシン精機	1,300	687.00	893,100	
前澤給装工業	1,000	1,360.00	1,360,000	
イーグル工業	1,600	1,720.00	2,752,000	
前澤工業	1,200	1,082.00	1,298,400	
日本ピラー工業	1,500	4,640.00	6,960,000	
キッツ	5,300	1,221.00	6,471,300	
マキタ	17,900	3,808.00	68,163,200	
三井E & S	8,700	753.00	6,551,100	
日立造船	14,500	1,007.00	14,601,500	
三菱重工業	27,500	10,360.00	284,900,000	
IHI	11,600	2,754.50	31,952,200	
スター精密	3,200	1,732.00	5,542,400	
日清紡ホールディングス	11,500	1,244.50	14,311,750	
イビデン	8,200	7,222.00	59,220,400	
コニカミノルタ	34,100	482.10	16,439,610	
ブラザー工業	20,900	2,637.50	55,123,750	
ミネベアミツミ	27,400	2,916.50	79,912,100	
日立製作所	75,600	11,720.00	886,032,000	代用有価証券 12,000株
三菱電機	175,000	2,015.00	352,625,000	
富士電機	9,600	8,090.00	77,664,000	
東洋電機製造	100	1,048.00	104,800	
安川電機	17,000	5,316.00	90,372,000	
シンフォニアテクノロジー	1,900	2,204.00	4,187,600	
明電舎	2,800	2,776.00	7,772,800	
山洋電気	700	5,820.00	4,074,000	
デンヨー	1,100	2,285.00	2,513,500	
PHCホールディングス	2,600	1,506.00	3,915,600	
KOKUSAI ELECTRIC	6,300	3,980.00	25,074,000	
ソシオネクスト	11,700	3,673.00	42,974,100	
東芝テック	1,900	3,210.00	6,099,000	
芝浦メカトロニクス	1,000	7,610.00	7,610,000	
マブチモーター	7,700	2,537.00	19,534,900	
ニデック	34,700	5,469.00	189,774,300	
トレックス・セミコンダクター	600	1,718.00	1,030,800	

東光高岳	900	2,373.00	2,135,700
ダブル・スコープ	4,000	726.00	2,904,000
ダイヘン	1,600	6,470.00	10,352,000
ヤーマン	3,000	1,004.00	3,012,000
JVCケンウッド	13,400	657.00	8,803,800
ミマキエンジニアリング	2,000	960.00	1,920,000
I - P E X	900	1,756.00	1,580,400
大崎電気工業	2,900	678.00	1,966,200
オムロン	12,000	5,542.00	66,504,000
日東工業	2,100	4,270.00	8,967,000
I D E C	2,300	2,783.00	6,400,900
正興電機製作所	600	1,117.00	670,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6,000	2,575.50	15,453,000
サクサホールディングス	400	2,835.00	1,134,000
メルコホールディングス	500	3,250.00	1,625,000
テクノメディカ	700	1,910.00	1,337,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	100	698.00	69,800
日本電気	20,600	9,464.00	194,958,400
富士通	14,500	22,995.00	333,427,500
沖電気工業	6,800	1,076.00	7,316,800
電気興業	500	2,369.00	1,184,500
サンケン電気	1,400	7,800.00	10,920,000
アイホン	800	2,867.00	2,293,600
ルネサスエレクトロニクス	102,900	2,374.00	244,284,600
セイコーエプソン	20,100	2,367.00	47,576,700
ワコム	11,500	743.00	8,544,500
アルバック	3,400	7,559.00	25,700,600
アクセル	900	2,278.00	2,050,200
E I Z O	1,100	4,950.00	5,445,000
日本信号	3,500	955.00	3,342,500
京三製作所	2,700	465.00	1,255,500
能美防災	2,000	2,302.00	4,604,000
ホーチキ	1,500	2,126.00	3,189,000
星和電機	1,000	480.00	480,000
エレコム	4,100	1,687.00	6,916,700
パナソニック ホールディングス	185,600	1,430.50	265,500,800
シャープ	26,200	862.10	22,587,020
アンリツ	11,000	1,164.50	12,809,500
富士通ゼネラル	4,300	2,100.00	9,030,000
ソニーグループ	110,200	14,300.00	1,575,860,000
T D K	25,000	7,599.00	189,975,000
帝国通信工業	700	1,949.00	1,364,300

タムラ製作所	5,600	541.00	3,029,600
アルプスアルパイン	13,800	1,070.00	14,766,000
日本電波工業	2,300	1,196.00	2,750,800
鈴木	900	1,250.00	1,125,000
メイコー	1,500	4,580.00	6,870,000
日本トリム	600	3,310.00	1,986,000
ローランド ディー・ジー・	900	3,890.00	3,501,000
フォスター電機	900	1,131.00	1,017,900
S M K	300	2,500.00	750,000
ヨコオ	1,200	1,428.00	1,713,600
ホシデン	3,500	1,795.00	6,282,500
ヒロセ電機	2,300	16,240.00	37,352,000
日本航空電子工業	3,700	2,457.00	9,090,900
T O A	1,500	1,125.00	1,687,500
マクセル	3,400	1,570.00	5,338,000
古野電気	2,400	2,034.00	4,881,600
スミダコーポレーション	2,500	1,158.00	2,895,000
アイコム	600	3,595.00	2,157,000
リオン	800	2,543.00	2,034,400
横河電機	17,200	2,923.00	50,275,600
新電元工業	500	3,150.00	1,575,000
アズビル	10,800	4,603.00	49,712,400
東亜ディーケーケー	800	947.00	757,600
日本光電工業	6,700	3,987.00	26,712,900
チノー	800	2,395.00	1,916,000
共和電業	500	423.00	211,500
日本電子材料	900	1,912.00	1,720,800
堀場製作所	3,000	12,365.00	37,095,000
アドバンテスト	44,700	6,115.00	273,340,500
エスベック	1,200	2,554.00	3,064,800
キーエンス	15,600	64,180.00	1,001,208,000
日置電機	900	6,540.00	5,886,000
シスメックス	13,400	7,613.00	102,014,200
日本マイクロニクス	2,900	4,180.00	12,122,000
メガチップス	1,200	4,750.00	5,700,000
O B A R A G R O U P	900	3,940.00	3,546,000
原田工業	1,100	752.00	827,200
コーセル	2,000	1,462.00	2,924,000
イリソ電子工業	1,400	3,045.00	4,263,000
オプテックスグループ	2,700	1,760.00	4,752,000
千代田インテグレ	600	2,737.00	1,642,200
レーザーテック	7,200	39,920.00	287,424,000

スタンレー電気	9,900	2,659.50	26,329,050
ウシオ電機	7,800	2,057.00	16,044,600
岡谷電機産業	1,600	286.00	457,600
ハリオス テクノ ホールディング	300	532.00	159,600
エノモト	100	1,623.00	162,300
日本セラミック	1,200	2,645.00	3,174,000
遠藤照明	700	1,527.00	1,068,900
古河電池	1,000	939.00	939,000
山一電機	1,400	2,196.00	3,074,400
図研	1,400	4,075.00	5,705,000
日本電子	3,900	6,649.00	25,931,100
カシオ計算機	11,100	1,260.50	13,991,550
ファナック	75,900	3,945.00	299,425,500
日本シイエムケイ	2,700	752.00	2,030,400
エンプラス	400	10,890.00	4,356,000
大真空	1,900	878.00	1,668,200
ローム	28,800	2,662.00	76,665,600
浜松ホトニクス	12,500	5,636.00	70,450,000
三井ハイテック	1,500	7,394.00	11,091,000
新光電気工業	5,500	5,450.00	29,975,000
京セラ	97,000	2,077.50	201,517,500
太陽誘電	7,500	3,431.00	25,732,500
村田製作所	141,900	2,989.50	424,210,050
双葉電子工業	2,200	506.00	1,113,200
ニチコン	4,400	1,260.00	5,544,000
日本ケミコン	1,300	1,402.00	1,822,600
K O A	2,200	1,457.00	3,205,400
市光工業	3,600	602.00	2,167,200
小糸製作所	16,100	2,018.00	32,489,800
ミツバ	2,700	1,128.00	3,045,600
S C R E E Nホールディングス	5,400	16,345.00	88,263,000
キャノン電子	2,000	2,081.00	4,162,000
キャノン	77,600	4,087.00	317,151,200
リコー	38,900	1,269.50	49,383,550
象印マホービン	4,100	1,421.00	5,826,100
東京エレクトロン	33,000	28,480.00	939,840,000
イノテック	900	1,868.00	1,681,200
トヨタ紡織	6,600	2,361.50	15,585,900
芦森工業	100	2,400.00	240,000
ユニプレス	2,600	1,109.00	2,883,400
豊田自動織機	13,300	13,515.00	179,749,500
モリタホールディングス	2,800	1,541.00	4,314,800

三櫻工業	2,200	889.00	1,955,800	
デンソー	128,600	2,522.50	324,393,500	
東海理化電機製作所	4,400	2,298.00	10,111,200	
川崎重工業	12,600	3,507.00	44,188,200	
名村造船所	4,300	1,350.00	5,805,000	
日本車輛製造	600	2,286.00	1,371,600	
三菱ロジスネクスト	3,200	1,564.00	5,004,800	
日産自動車	210,400	614.10	129,206,640	
いすゞ自動車	45,400	2,044.00	92,797,600	
トヨタ自動車	855,400	3,260.00	2,788,604,000	代用有価証券 45,000株
日野自動車	23,000	466.00	10,718,000	
三菱自動車工業	61,500	455.70	28,025,550	
エフテック	200	687.00	137,400	
レシップホールディングス	1,500	671.00	1,006,500	
武蔵精密工業	3,700	1,719.00	6,360,300	
日産車体	1,500	981.00	1,471,500	
新明和工業	4,500	1,166.00	5,247,000	
極東開発工業	2,500	2,397.00	5,992,500	
トピー工業	1,200	2,930.00	3,516,000	
ティラド	300	3,775.00	1,132,500	
タチエス	2,900	1,980.00	5,742,000	
N O K	5,900	2,052.00	12,106,800	
フタバ産業	5,100	979.00	4,992,900	
カヤバ	1,600	5,040.00	8,064,000	
大同メタル工業	2,700	571.00	1,541,700	
プレス工業	6,200	673.00	4,172,600	
ミクニ	600	501.00	300,600	
太平洋工業	3,500	1,496.00	5,236,000	
アイシン	12,000	5,278.00	63,336,000	
マツダ	51,700	1,902.00	98,333,400	
今仙電機製作所	200	750.00	150,000	
本田技研工業	379,600	1,710.50	649,305,800	
スズキ	28,600	7,235.00	206,921,000	
S U B A R U	48,300	3,095.00	149,488,500	
安永	400	682.00	272,800	
ヤマハ発動機	67,500	1,419.50	95,816,250	
T B K	400	423.00	169,200	
エクセディ	2,500	2,875.00	7,187,500	
豊田合成	4,400	2,953.00	12,993,200	
愛三工業	2,600	1,458.00	3,790,800	
日本プラスト	300	605.00	181,500	
ヨロズ	1,300	998.00	1,297,400	

エフ・シー・シー	2,700	2,090.00	5,643,000
シマノ	6,300	21,075.00	132,772,500
テイ・エス テック	5,400	1,934.00	10,443,600
ジャムコ	1,300	1,520.00	1,976,000
テルモ	43,600	5,073.00	221,182,800
日機装	3,300	1,126.00	3,715,800
日本エム・ディ・エム	1,000	728.00	728,000
島津製作所	20,700	3,862.00	79,943,400
JMS	800	522.00	417,600
長野計器	1,300	2,297.00	2,986,100
ブイ・テクノロジー	600	2,690.00	1,614,000
東京計器	900	1,857.00	1,671,300
愛知時計電機	800	2,588.00	2,070,400
インターアクション	900	1,125.00	1,012,500
オーバル	300	544.00	163,200
東京精密	3,200	9,486.00	30,355,200
マニー	6,500	2,055.00	13,357,500
ニコン	22,300	1,509.50	33,661,850
トプコン	7,300	1,716.50	12,530,450
オリンパス	96,000	2,145.00	205,920,000
理研計器	1,200	7,930.00	9,516,000
タムロン	1,000	5,730.00	5,730,000
HOYA	30,700	18,400.00	564,880,000
ノーリツ鋼機	1,300	3,280.00	4,264,000
A & Dホロンホールディングス	2,600	2,120.00	5,512,000
朝日インテック	19,100	2,891.00	55,218,100
シチズン時計	14,100	973.00	13,719,300
大研医器	1,600	541.00	865,600
メニコン	5,500	2,127.50	11,701,250
シンシア	600	586.00	351,600
松風	600	2,685.00	1,611,000
セイコーグループ	2,100	2,688.00	5,644,800
ニプロ	12,700	1,201.50	15,259,050
スノーピーク	1,500	851.00	1,276,500
パラマウントベッドホールディングス	3,300	2,665.00	8,794,500
トランザクション	1,300	2,464.00	3,203,200
粧美堂	200	777.00	155,400
ニホンフラッシュ	1,100	957.00	1,052,700
前田工織	1,400	3,125.00	4,375,000
アートネイチャー	1,800	797.00	1,434,600
フルヤ金属	400	9,340.00	3,736,000
バンダイナムコホールディングス	42,600	3,026.00	128,907,600

アイフィスジャパン	500	603.00	301,500	
SHOEI	3,800	1,952.00	7,417,600	
フランスベッドホールディングス	2,100	1,392.00	2,923,200	
パイロットコーポレーション	2,300	4,006.00	9,213,800	
萩原工業	1,300	1,489.00	1,935,700	
フジシールインターナショナル	3,200	1,740.00	5,568,000	
タカラトミー	7,200	2,379.50	17,132,400	
広済堂ホールディングス	4,400	739.00	3,251,600	
プロネクサス	1,800	1,271.00	2,287,800	
TOPPANホールディングス	19,000	3,940.00	74,860,000	
大日本印刷	17,000	4,185.00	71,145,000	
共同印刷	300	3,400.00	1,020,000	
NISSHA	2,300	1,580.00	3,634,000	
TAKARA & COMPANY	1,000	2,832.00	2,832,000	
アシックス	13,400	4,700.00	62,980,000	
ツツミ	200	2,175.00	435,000	
ローランド	1,300	4,830.00	6,279,000	
小松ウオール工業	500	3,235.00	1,617,500	
ヤマハ	9,700	3,437.00	33,338,900	
河合楽器製作所	500	3,505.00	1,752,500	
クリナップ	1,000	776.00	776,000	
ピジョン	10,100	1,606.50	16,225,650	
キングジム	1,000	871.00	871,000	
リンテック	2,900	2,793.00	8,099,700	
イトーキ	3,300	1,564.00	5,161,200	
任天堂	98,400	8,369.00	823,509,600	代用有価証券 18,000株
三菱鉛筆	2,200	1,971.00	4,336,200	
タカラスタANDARD	3,100	1,881.00	5,831,100	
コクヨ	6,500	2,363.50	15,362,750	
ナカバヤシ	800	540.00	432,000	
グローブライド	1,600	2,080.00	3,328,000	
オカムラ	4,800	2,177.00	10,449,600	
美津濃	1,600	4,410.00	7,056,000	
東京電力ホールディングス	140,700	762.90	107,340,030	
中部電力	57,500	1,962.50	112,843,750	
関西電力	60,300	1,913.50	115,384,050	
中国電力	26,500	988.40	26,192,600	
北陸電力	14,900	710.90	10,592,410	
東北電力	41,500	1,004.50	41,686,750	
四国電力	14,000	1,034.00	14,476,000	
九州電力	36,400	1,155.50	42,060,200	
北海道電力	15,400	636.50	9,802,100	

沖縄電力	3,300	1,093.00	3,606,900
電源開発	12,900	2,569.50	33,146,550
イーレックス	1,900	769.00	1,461,100
レノバ	3,400	1,223.00	4,158,200
東京瓦斯	33,000	3,305.00	109,065,000
大阪瓦斯	31,700	3,101.00	98,301,700
東邦瓦斯	6,800	2,987.50	20,315,000
北海道瓦斯	1,200	2,298.00	2,757,600
広島ガス	4,200	394.00	1,654,800
西部ガスホールディングス	1,800	1,897.00	3,414,600
静岡ガス	3,600	1,020.00	3,672,000
メタウォーター	1,900	2,130.00	4,047,000
SBSホールディングス	1,600	2,474.00	3,958,400
東武鉄道	17,000	3,915.00	66,555,000
相鉄ホールディングス	5,400	2,832.50	15,295,500
東急	43,300	1,719.50	74,454,350
京浜急行電鉄	19,000	1,295.00	24,605,000
小田急電鉄	25,900	2,205.50	57,122,450
京王電鉄	7,500	4,188.00	31,410,000
京成電鉄	10,000	6,900.00	69,000,000
富士急行	2,000	4,365.00	8,730,000
東日本旅客鉄道	28,700	9,000.00	258,300,000
西日本旅客鉄道	18,500	6,415.00	118,677,500
東海旅客鉄道	60,100	3,772.00	226,697,200
西武ホールディングス	18,700	2,120.00	39,644,000
鴻池運輸	2,700	1,907.00	5,148,900
西日本鉄道	4,000	2,462.00	9,848,000
ハマキョウレックス	1,400	4,015.00	5,621,000
サカイ引越センター	1,800	2,643.00	4,757,400
近鉄グループホールディングス	15,700	4,501.00	70,665,700
阪急阪神ホールディングス	20,700	4,560.00	94,392,000
南海電気鉄道	7,000	2,978.00	20,846,000
京阪ホールディングス	8,500	3,589.00	30,506,500
神戸電鉄	300	2,877.00	863,100
名古屋鉄道	15,900	2,262.00	35,965,800
山陽電気鉄道	1,300	2,187.00	2,843,100
アルプス物流	1,000	1,889.00	1,889,000
ヤマトホールディングス	20,000	2,416.00	48,320,000
山九	4,000	5,386.00	21,544,000
丸全昭和運輸	1,000	4,150.00	4,150,000
センコーグループホールディングス	8,500	1,128.00	9,588,000
トナミホールディングス	300	4,645.00	1,393,500

ニッコンホールディングス	5,100	3,189.00	16,263,900
福山通運	1,700	4,270.00	7,259,000
セイノーホールディングス	8,500	2,159.50	18,355,750
エスライングループ本社	300	869.00	260,700
神奈川中央交通	300	3,110.00	933,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	4,400	1,522.00	6,696,800
C & F ロジホールディングス	1,300	1,755.00	2,281,500
九州旅客鉄道	11,100	3,373.00	37,440,300
S Gホールディングス	26,400	1,880.50	49,645,200
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	5,200	8,668.00	45,073,600
日本郵船	44,600	4,895.00	218,317,000
商船三井	33,800	5,285.00	178,633,000
川崎汽船	12,500	7,025.00	87,812,500
N Sユナイテッド海運	900	5,090.00	4,581,000
飯野海運	5,800	1,349.00	7,824,200
乾汽船	1,400	1,074.00	1,503,600
日本航空	38,200	2,792.50	106,673,500
A N Aホールディングス	42,300	3,242.00	137,136,600
パスコ	100	1,879.00	187,900
トランコム	500	6,960.00	3,480,000
日新	1,200	2,694.00	3,232,800
三菱倉庫	3,700	4,415.00	16,335,500
三井倉庫ホールディングス	1,500	4,770.00	7,155,000
住友倉庫	4,200	2,517.00	10,571,400
澁澤倉庫	600	3,125.00	1,875,000
日本トランスシティ	2,500	633.00	1,582,500
ケイヒン	200	1,932.00	386,400
中央倉庫	600	1,162.00	697,200
川西倉庫	300	1,126.00	337,800
安田倉庫	600	1,211.00	726,600
ファイズホールディングス	400	1,324.00	529,600
上組	7,200	3,392.00	24,422,400
サンリツ	100	787.00	78,700
キムラユニティー	500	1,623.00	811,500
キューソー流通システム	100	915.00	91,500
エーアイティー	1,300	1,854.00	2,410,200
内外トランスライン	800	2,417.00	1,933,600
日本コンセプト	900	1,756.00	1,580,400
N E C ネットズエスアイ	6,100	2,329.00	14,206,900
クロスキャット	1,500	1,174.00	1,761,000
システナ	24,700	288.00	7,113,600
デジタルアーツ	1,000	4,220.00	4,220,000

日鉄ソリューションズ	2,700	4,975.00	13,432,500
キューブシステム	1,100	1,139.00	1,252,900
コア	900	1,792.00	1,612,800
手間いらず	100	2,678.00	267,800
ラクーンホールディングス	1,400	692.00	968,800
ソリトンシステムズ	1,200	1,410.00	1,692,000
ソフトクリエイイトホールディングス	1,500	1,788.00	2,682,000
T I S	17,100	3,409.00	58,293,900
グリー	5,500	579.00	3,184,500
コーエーテクモホールディングス	10,000	1,796.50	17,965,000
三菱総合研究所	800	4,910.00	3,928,000
電算	200	1,497.00	299,400
A G S	200	911.00	182,200
ファインデックス	1,700	1,015.00	1,725,500
K L a b	500	359.00	179,500
ポルトゥウィンホールディングス	1,200	485.00	582,000
ネクソン	35,100	2,890.50	101,456,550
アイスタイル	3,200	409.00	1,308,800
エムアップホールディングス	2,300	998.00	2,295,400
エニグモ	500	350.00	175,000
テクノスジャパン	1,300	638.00	829,400
コロプラ	5,000	627.00	3,135,000
ブロードリーフ	5,800	628.00	3,642,400
クロス・マーケティンググループ	300	574.00	172,200
デジタルハーツホールディングス	300	1,044.00	313,200
メディアドゥ	800	1,244.00	995,200
じげん	5,200	520.00	2,704,000
サイバーリンクス	200	809.00	161,800
フィックスターズ	2,000	1,599.00	3,198,000
C A R T A H O L D I N G S	300	1,556.00	466,800
オブティム	2,000	915.00	1,830,000
S H I F T	1,000	27,485.00	27,485,000
ティーガイア	1,700	2,035.00	3,459,500
セック	200	5,100.00	1,020,000
テクマトリックス	3,000	1,901.00	5,703,000
プロシップ	1,100	1,407.00	1,547,700
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,200	2,486.50	10,443,300
G M O ペイメントゲートウェイ	3,100	8,814.00	27,323,400
システムリサーチ	700	3,425.00	2,397,500
インターネットイニシアティブ	7,500	2,827.50	21,206,250
さくらインターネット	1,600	3,785.00	6,056,000
G M O グローバルサイン・ホールディングス	500	2,749.00	1,374,500

S R Aホールディングス	700	3,880.00	2,716,000
システムインテグレータ	900	434.00	390,600
朝日ネット	2,200	629.00	1,383,800
e B A S E	2,700	711.00	1,919,700
アバントグループ	2,200	1,369.00	3,011,800
アドソル日進	900	1,597.00	1,437,300
フリービット	1,000	1,431.00	1,431,000
コムチュア	2,500	1,833.00	4,582,500
アステリア	100	629.00	62,900
アイル	800	3,230.00	2,584,000
マークラインズ	1,000	3,000.00	3,000,000
メディカル・データ・ビジョン	2,700	634.00	1,711,800
g u m i	800	399.00	319,200
モバイルファクトリー	600	726.00	435,600
テラスカイ	200	1,527.00	305,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,100	1,778.00	1,955,800
P C Iホールディングス	400	1,014.00	405,600
ネオジャパン	1,000	1,055.00	1,055,000
P R T I M E S	600	2,146.00	1,287,600
ラクス	7,400	2,384.50	17,645,300
ランドコンピュータ	800	887.00	709,600
ダブルスタンダード	800	1,642.00	1,313,600
オープンドア	100	942.00	94,200
アカツキ	500	2,504.00	1,252,000
ベネフィットジャパン	300	1,245.00	373,500
U b i c o mホールディングス	700	1,602.00	1,121,400
カナミックネットワーク	3,000	424.00	1,272,000
ノムラシステムコーポレーション	1,600	114.00	182,400
チェンジホールディングス	3,600	1,374.00	4,946,400
シンクロ・フード	1,100	654.00	719,400
オークネット	800	2,127.00	1,701,600
エイトレッド	300	1,416.00	424,800
マクロミル	3,500	775.00	2,712,500
ビーグリー	200	1,275.00	255,000
オロ	700	2,865.00	2,005,500
ユーザーローカル	900	2,084.00	1,875,600
マネーフォワード	3,300	5,736.00	18,928,800
S u n A s t e r i s k	1,600	961.00	1,537,600
プラスアルファ・コンサルティング	1,100	2,440.00	2,684,000
電算システムホールディングス	800	2,957.00	2,365,600
A p p i e r G r o u p	4,900	1,710.00	8,379,000
ビジョナル	1,200	9,180.00	11,016,000

ソルクシーズ	900	404.00	363,600
プロトコーポレーション	1,700	1,364.00	2,318,800
ハイマックス	700	1,402.00	981,400
野村総合研究所	34,600	4,230.00	146,358,000
C Eホールディングス	300	608.00	182,400
日本システム技術	700	3,255.00	2,278,500
インテージホールディングス	1,800	1,720.00	3,096,000
東邦システムサイエンス	800	1,254.00	1,003,200
ソースネクスト	2,700	144.00	388,800
インフォコム	2,000	2,201.00	4,402,000
シンプレクス・ホールディングス	2,400	2,515.00	6,036,000
HEROZ	200	1,568.00	313,600
ラクスル	3,700	1,063.00	3,933,100
メルカリ	7,800	2,437.50	19,012,500
I P S	600	2,027.00	1,216,200
システムサポート	800	1,903.00	1,522,400
東海ソフト	100	1,167.00	116,700
ウイングアーク1st	1,600	2,852.00	4,563,200
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	600	1,164.00	698,400
サーバーワークス	200	4,040.00	808,000
東名	200	2,281.00	456,200
トピラシステムズ	500	871.00	435,500
S a n s a n	4,600	1,409.00	6,481,400
L i n k - U	200	634.00	126,800
ギフトィ	800	1,540.00	1,232,000
メドレー	2,100	4,615.00	9,691,500
ベース	700	3,195.00	2,236,500
J M D C	2,500	3,676.00	9,190,000
フォーカスシステムズ	1,200	1,049.00	1,258,800
クレスコ	1,500	1,967.00	2,950,500
フジ・メディア・ホールディングス	14,600	1,965.50	28,696,300
オービック	5,200	22,435.00	116,662,000
ジャストシステム	2,300	2,954.00	6,794,200
T D C ソフト	1,500	2,123.00	3,184,500
L I N E ヤフー	223,000	433.30	96,625,900
トレンドマイクロ	7,300	8,258.00	60,283,400
I Dホールディングス	1,300	1,695.00	2,203,500
日本オラクル	3,000	11,275.00	33,825,000
アルファシステムズ	400	3,140.00	1,256,000
フューチャー	3,500	1,703.00	5,960,500
C A C H o l d i n g s	900	1,795.00	1,615,500
S Bテクノロジー	800	2,196.00	1,756,800

オービックビジネスコンサルタント	2,200	7,062.00	15,536,400	
アイティフォー	2,300	1,209.00	2,780,700	
東計電算	500	3,680.00	1,840,000	
エクスネット	100	1,105.00	110,500	
大塚商会	7,800	5,983.00	46,667,400	
サイボウズ	2,300	2,253.00	5,181,900	
電通総研	2,000	5,430.00	10,860,000	
A C C E S S	600	840.00	504,000	
デジタルガレージ	2,200	3,515.00	7,733,000	
E Mシステムズ	2,600	682.00	1,773,200	
ウェザーニューズ	500	5,110.00	2,555,000	
C I J	2,600	685.00	1,781,000	
ビジネスエンジニアリング	400	4,455.00	1,782,000	
WOWOW	600	1,160.00	696,000	
スカラ	500	760.00	380,000	
インテリジェント ウェイブ	600	1,124.00	674,400	
A N Y C O L O R	1,800	3,380.00	6,084,000	
I M A G I C A G R O U P	1,800	695.00	1,251,000	
ネットワンシステムズ	6,500	2,704.50	17,579,250	
アルゴグラフィックス	1,400	4,150.00	5,810,000	
マーベラス	2,600	741.00	1,926,600	
エイベックス	2,200	1,409.00	3,099,800	
B I P R O G Y	5,200	4,495.00	23,374,000	
都築電気	1,000	2,421.00	2,421,000	
T B Sホールディングス	7,700	4,040.00	31,108,000	
日本テレビホールディングス	13,400	2,241.50	30,036,100	
朝日放送グループホールディングス	600	702.00	421,200	
テレビ朝日ホールディングス	3,400	2,205.00	7,497,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	11,200	833.00	9,329,600	
テレビ東京ホールディングス	1,000	3,315.00	3,315,000	
ビジョン	2,700	1,134.00	3,061,800	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	1,800	4,185.00	7,533,000	
日本通信	17,100	237.00	4,052,700	
クロップス	200	1,020.00	204,000	
日本電信電話	4,651,000	183.40	852,993,400	代用有価証券 700,000株
K D D I	120,900	4,599.00	556,019,100	
ソフトバンク	251,800	1,944.50	489,625,100	
光通信	1,600	26,025.00	41,640,000	
エムティーアイ	400	614.00	245,600	
G M Oインターネットグループ	5,800	2,615.00	15,167,000	
ファイバーゲート	700	936.00	655,200	
K A D O K A W A	8,000	3,238.00	25,904,000	

学研ホールディングス	2,500	1,010.00	2,525,000
ゼンリン	2,000	854.00	1,708,000
アイネット	1,000	1,925.00	1,925,000
松竹	700	10,205.00	7,143,500
東宝	8,700	4,734.00	41,185,800
東映	500	20,130.00	10,065,000
NTTデータグループ	40,700	2,088.50	85,001,950
ピー・シー・エー	600	1,578.00	946,800
ビジネスブレイン太田昭和	800	2,240.00	1,792,000
D T S	3,300	3,645.00	12,028,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,200	6,218.00	44,769,600
シーイーシー	2,000	1,659.00	3,318,000
カブコン	14,100	5,634.00	79,439,400
アイ・エス・ピー	1,100	1,572.00	1,729,200
ジャステック	1,100	1,326.00	1,458,600
S C S K	11,000	2,651.50	29,166,500
N S W	800	2,966.00	2,372,800
アイネス	900	1,484.00	1,335,600
T K C	2,500	3,790.00	9,475,000
富士ソフト	3,200	6,400.00	20,480,000
N S D	5,600	2,684.00	15,030,400
コナミグループ	5,900	9,237.00	54,498,300
福井コンピュータホールディングス	1,100	2,554.00	2,809,400
J B C Cホールディングス	1,100	3,930.00	4,323,000
ミロク情報サービス	1,500	1,952.00	2,928,000
ソフトバンクグループ	77,200	6,618.00	510,909,600
高千穂交易	400	3,985.00	1,594,000
オルバヘルスケアホールディングス	400	1,873.00	749,200
伊藤忠食品	300	7,830.00	2,349,000
エレマテック	1,600	1,807.00	2,891,200
あらた	2,600	3,105.00	8,073,000
トーメンデバイス	200	5,330.00	1,066,000
東京エレクトロン デバイス	1,700	6,530.00	11,101,000
円谷フィールズホールディングス	3,100	1,786.00	5,536,600
双日	18,300	3,722.00	68,112,600
アルフレッサ ホールディングス	16,400	2,394.50	39,269,800
横浜冷凍	3,900	1,110.00	4,329,000
神栄	400	1,712.00	684,800
ラサ商事	900	1,686.00	1,517,400
アルコニックス	1,900	1,401.00	2,661,900
神戸物産	12,800	3,708.00	47,462,400
あい ホールディングス	2,700	2,461.00	6,644,700

ディーブイエックス	300	1,072.00	321,600
ダイワボウホールディングス	7,400	3,144.00	23,265,600
マクニカホールディングス	4,000	8,065.00	32,260,000
ラクト・ジャパン	800	2,252.00	1,801,600
グリムス	1,000	2,054.00	2,054,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,200	1,195.00	2,629,000
八洲電機	1,600	1,294.00	2,070,400
メディアスホールディングス	700	745.00	521,500
レスターホールディングス	1,300	3,025.00	3,932,500
ジオリーブグループ	400	1,334.00	533,600
大光	1,300	639.00	830,700
O C H Iホールディングス	400	1,600.00	640,000
T O K A Iホールディングス	9,200	1,005.00	9,246,000
三洋貿易	2,000	1,286.00	2,572,000
ビューティガレージ	900	2,147.00	1,932,300
ウイン・パートナーズ	1,400	1,260.00	1,764,000
シップヘルスケアホールディングス	6,000	2,218.00	13,308,000
明治電機工業	900	1,462.00	1,315,800
デリカフーズホールディングス	900	594.00	534,600
スターティアホールディングス	600	1,579.00	947,400
コメダホールディングス	4,200	2,767.00	11,621,400
アセンテック	1,700	570.00	969,000
フルサト・マルカホールディングス	1,300	2,471.00	3,212,300
ヤマエグループホールディングス	1,000	3,105.00	3,105,000
小野建	1,700	1,850.00	3,145,000
南陽	300	2,216.00	664,800
佐島電機	700	2,324.00	1,626,800
エコートレーディング	200	1,233.00	246,600
伯東	1,000	5,820.00	5,820,000
コンドーテック	1,400	1,210.00	1,694,000
ナガイレーベン	2,100	2,344.00	4,922,400
三菱食品	1,500	5,080.00	7,620,000
松田産業	1,300	2,646.00	3,439,800
第一興商	6,400	2,008.00	12,851,200
メディバルホールディングス	16,900	2,372.50	40,095,250
S P K	900	2,012.00	1,810,800
萩原電気ホールディングス	700	5,150.00	3,605,000
アズワン	2,600	5,497.00	14,292,200
スズデン	800	2,245.00	1,796,000
シモジマ	1,300	1,296.00	1,684,800
ドウシシャ	1,600	2,123.00	3,396,800
高速	1,200	2,356.00	2,827,200

たけびし	800	2,010.00	1,608,000
リックス	400	3,570.00	1,428,000
丸文	1,600	1,544.00	2,470,400
ハピネット	1,500	2,841.00	4,261,500
橋本総業ホールディングス	900	1,298.00	1,168,200
日本ライフライン	5,100	1,311.00	6,686,100
タカショー	500	497.00	248,500
I D O M	5,100	903.00	4,605,300
進和	800	2,435.00	1,948,000
エスケイジャパン	500	710.00	355,000
ダイトロン	800	3,080.00	2,464,000
シークス	2,100	1,561.00	3,278,100
田中商事	300	829.00	248,700
オーハシテクニカ	500	1,865.00	932,500
白銅	600	2,465.00	1,479,000
ダイコー通産	200	1,208.00	241,600
伊藤忠商事	108,800	6,736.00	732,876,800
丸紅	137,300	2,386.00	327,597,800
高島	800	1,354.00	1,083,200
長瀬産業	7,300	2,406.50	17,567,450
蝶理	1,100	2,951.00	3,246,100
豊田通商	14,500	9,300.00	134,850,000
三共生興	1,600	779.00	1,246,400
兼松	7,000	2,326.00	16,282,000
三井物産	124,300	5,840.00	725,912,000
日本紙パルプ商事	900	5,070.00	4,563,000
カメイ	1,500	1,921.00	2,881,500
東都水産	100	6,400.00	640,000
O U G ホールディングス	300	2,435.00	730,500
スターゼン	1,300	2,725.00	3,542,500
山善	5,000	1,257.00	6,285,000
椿本興業	400	6,820.00	2,728,000
住友商事	100,000	3,357.00	335,700,000
内田洋行	700	7,830.00	5,481,000
三菱商事	326,900	2,782.00	909,435,800
第一実業	1,600	1,870.00	2,992,000
キヤノンマーケティングジャパン	3,800	4,334.00	16,469,200
西華産業	800	3,210.00	2,568,000
佐藤商事	1,400	1,699.00	2,378,600
菱洋エレクトロ	1,700	3,865.00	6,570,500
東京産業	800	749.00	599,200
ユアサ商事	1,400	4,965.00	6,951,000

神鋼商事	400	6,750.00	2,700,000
阪和興業	3,000	5,390.00	16,170,000
正栄食品工業	1,000	4,575.00	4,575,000
カナデン	1,000	1,500.00	1,500,000
R Y O D E N	1,200	2,632.00	3,158,400
岩谷産業	3,800	6,992.00	26,569,600
ナイス	400	1,587.00	634,800
ニチモウ	400	2,251.00	900,400
極東貿易	800	2,224.00	1,779,200
アステナホールディングス	2,500	472.00	1,180,000
三愛オブリ	4,100	1,730.00	7,093,000
稲畑産業	3,400	3,160.00	10,744,000
G S I クレオス	700	2,387.00	1,670,900
明和産業	1,500	718.00	1,077,000
ワキタ	2,400	1,596.00	3,830,400
東邦ホールディングス	4,600	3,187.00	14,660,200
サンゲツ	4,000	3,260.00	13,040,000
ミツウロコグループホールディングス	2,300	1,634.00	3,758,200
シナネンホールディングス	300	4,100.00	1,230,000
伊藤忠エネクス	4,300	1,558.00	6,699,400
サンリオ	4,700	6,269.00	29,464,300
サンワテクノス	1,000	2,256.00	2,256,000
リョーサン	1,100	4,995.00	5,494,500
新光商事	2,300	1,215.00	2,794,500
トーヨー	800	2,944.00	2,355,200
三信電気	700	2,317.00	1,621,900
東陽テクニカ	1,400	1,451.00	2,031,400
モスフードサービス	2,300	3,440.00	7,912,000
加賀電子	1,500	6,790.00	10,185,000
ソーダニッカ	1,000	1,177.00	1,177,000
立花エレテック	1,200	3,120.00	3,744,000
フォーバル	1,100	1,382.00	1,520,200
P A L T A C	2,300	4,386.00	10,087,800
三谷産業	2,300	387.00	890,100
西本W i s m e t t a cホールディングス	400	6,390.00	2,556,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	2,243.00	224,300
コア商事ホールディングス	2,100	745.00	1,564,500
K P P グループホールディングス	4,800	718.00	3,446,400
ヤマタネ	800	2,455.00	1,964,000
丸紅建材リース	100	2,859.00	285,900
泉州電業	900	3,785.00	3,406,500
トラスコ中山	3,300	2,432.00	8,025,600

オートバックスセブン	5,800	1,625.00	9,425,000
モリト	900	1,416.00	1,274,400
加藤産業	2,100	4,655.00	9,775,500
イエローハット	2,700	1,883.00	5,084,100
J Kホールディングス	1,500	1,035.00	1,552,500
日伝	1,000	2,724.00	2,724,000
杉本商事	600	2,252.00	1,351,200
因幡電機産業	4,300	3,500.00	15,050,000
東テク	600	6,570.00	3,942,000
ミスミグループ本社	24,800	2,321.50	57,573,200
蔵王産業	200	2,570.00	514,000
スズケン	6,200	4,617.00	28,625,400
ジェコス	800	1,192.00	953,600
グローセル	1,800	748.00	1,346,400
ローソン	3,600	10,270.00	36,972,000
サンエー	1,300	4,580.00	5,954,000
カワチ薬品	1,300	2,713.00	3,526,900
エービーシー・マート	7,300	2,608.00	19,038,400
ハードオフコーポレーション	800	1,835.00	1,468,000
アスクル	4,100	1,980.00	8,118,000
ゲオホールディングス	1,900	2,379.00	4,520,100
アダストリア	2,100	3,615.00	7,591,500
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	700	763.00	534,100
くら寿司	1,800	3,940.00	7,092,000
キャンドゥ	400	2,687.00	1,074,800
パルグループホールディングス	3,400	2,283.00	7,762,200
エディオン	6,600	1,539.00	10,157,400
サーラコーポレーション	3,600	803.00	2,890,800
ハローズ	800	4,295.00	3,436,000
フジオフードグループ本社	1,300	1,438.00	1,869,400
あみやき亭	400	4,505.00	1,802,000
大黒天物産	500	8,770.00	4,385,000
ハニーズホールディングス	1,700	1,696.00	2,883,200
ファーマライズホールディングス	300	654.00	196,200
アルペン	1,400	2,008.00	2,811,200
ハブ	200	732.00	146,400
クオールホールディングス	2,400	1,627.00	3,904,800
ジーンズホールディングス	1,000	4,130.00	4,130,000
ビックカメラ	8,400	1,345.00	11,298,000
D C Mホールディングス	8,900	1,373.00	12,219,700
Monotaro	23,700	1,381.50	32,741,550
東京一番フーズ	200	532.00	106,400

J・フロント リテイリング	18,600	1,503.50	27,965,100
ドトール・日レスホールディングス	3,000	2,149.00	6,447,000
マツキヨココカラ&カンパニー	30,200	2,777.50	83,880,500
ブロンコピリー	1,000	3,335.00	3,335,000
Z O Z O	10,600	3,367.00	35,690,200
トレジャー・ファクトリー	1,400	1,449.00	2,028,600
物語コーポレーション	2,800	5,280.00	14,784,000
三越伊勢丹ホールディングス	27,500	1,957.50	53,831,250
H a m e e	900	1,093.00	983,700
ウエルシアホールディングス	8,800	2,621.50	23,069,200
クリエイティブSDホールディングス	2,400	3,230.00	7,752,000
丸善C H Iホールディングス	1,300	326.00	423,800
ティーライフ	200	1,409.00	281,800
シュッピン	1,900	1,013.00	1,924,700
オイシックス・ラ・大地	2,300	1,374.00	3,160,200
ネクステージ	4,000	2,388.00	9,552,000
ジョイフル本田	4,900	1,942.00	9,515,800
鳥貴族ホールディングス	700	3,685.00	2,579,500
ホットランド	1,400	2,021.00	2,829,400
すかいらーくホールディングス	22,300	2,373.00	52,917,900
S F Pホールディングス	700	2,125.00	1,487,500
綿半ホールディングス	1,500	1,480.00	2,220,000
ヨシックスホールディングス	500	2,962.00	1,481,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,900	1,001.00	3,903,900
ゴルフダイジェスト・オンライン	300	620.00	186,000
B E E N O S	900	1,444.00	1,299,600
あさひ	1,800	1,305.00	2,349,000
日本調剤	1,300	1,460.00	1,898,000
コスモス薬品	1,400	16,000.00	22,400,000
トーエル	600	793.00	475,800
セブン&アイ・ホールディングス	56,900	6,074.00	345,610,600
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	11,400	1,092.00	12,448,800
ツルハホールディングス	3,500	11,005.00	38,517,500
サンマルクホールディングス	1,100	2,240.00	2,464,000
トリドールホールディングス	4,500	4,498.00	20,241,000
T O K Y O B A S E	200	309.00	61,800
ウイルプラスホールディングス	300	1,029.00	308,700
J Mホールディングス	1,500	2,356.00	3,534,000
アレンザホールディングス	1,500	1,164.00	1,746,000
串カツ田中ホールディングス	800	1,970.00	1,576,000
パロックジャパンリミテッド	900	819.00	737,100

クスリのアオキホールディングス	5,000	3,139.00	15,695,000
力の源ホールディングス	1,300	1,456.00	1,892,800
FOOD & LIFE COMPANIE	8,900	2,855.50	25,413,950
メディカルシステムネットワーク	2,800	579.00	1,621,200
一家ホールディングス	700	704.00	492,800
ノジマ	4,900	1,608.00	7,879,200
カップ・クリエイト	2,100	1,725.00	3,622,500
良品計画	18,100	2,113.00	38,245,300
パリミキホールディングス	300	491.00	147,300
アドヴァングループ	2,000	1,062.00	2,124,000
アルビス	600	2,669.00	1,601,400
ハウス オブ ローゼ	200	1,619.00	323,800
G - 7ホールディングス	2,200	1,389.00	3,055,800
イオン北海道	5,000	931.00	4,655,000
コジマ	2,200	734.00	1,614,800
コーナン商事	2,100	3,960.00	8,316,000
エコス	800	2,515.00	2,012,000
ワタミ	1,800	1,013.00	1,823,400
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	33,500	3,305.00	110,717,500
西松屋チェーン	3,400	2,134.00	7,255,600
ゼンショーホールディングス	8,400	7,361.00	61,832,400
サイゼリヤ	2,300	4,885.00	11,235,500
V Tホールディングス	6,800	532.00	3,617,600
魚力	600	2,416.00	1,449,600
フジ・コーポレーション	1,100	1,769.00	1,945,900
ユナイテッドアローズ	2,200	1,960.00	4,312,000
ハイデイ日高	2,600	2,860.00	7,436,000
コロワイド	6,800	2,316.50	15,752,200
壱番屋	1,300	6,290.00	8,177,000
スギホールディングス	3,400	6,981.00	23,735,400
薬王堂ホールディングス	900	2,564.00	2,307,600
スクロール	2,700	968.00	2,613,600
ヨンドシーホールディングス	1,300	1,971.00	2,562,300
木曽路	2,300	2,614.00	6,012,200
S R Sホールディングス	2,200	1,171.00	2,576,200
千趣会	1,100	276.00	303,600
リテールパートナーズ	2,200	1,737.00	3,821,400
上新電機	1,400	2,376.00	3,326,400
日本瓦斯	8,900	2,386.50	21,239,850
ロイヤルホールディングス	3,000	2,548.00	7,644,000
いなげや	1,000	1,274.00	1,274,000
チヨダ	1,000	895.00	895,000

ライフコーポレーション	1,900	3,765.00	7,153,500
リンガーハット	1,800	2,403.00	4,325,400
MrMaxHD	2,600	630.00	1,638,000
AOKIホールディングス	3,200	1,188.00	3,801,600
オークワ	1,700	902.00	1,533,400
コメリ	2,500	3,260.00	8,150,000
青山商事	3,200	1,821.00	5,827,200
しまむら	1,900	16,125.00	30,637,500
はせがわ	700	361.00	252,700
高島屋	11,200	2,202.00	24,662,400
松屋	2,800	968.00	2,710,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,300	1,818.00	13,271,400
近鉄百貨店	800	2,570.00	2,056,000
丸井グループ	11,000	2,436.00	26,796,000
アクシアル リテイリング	1,200	3,925.00	4,710,000
イオン	55,900	3,583.00	200,289,700
イズミ	3,000	3,487.00	10,461,000
平和堂	2,600	2,214.00	5,756,400
フジ	2,200	1,955.00	4,301,000
ヤオコー	1,900	8,553.00	16,250,700
ゼビオホールディングス	1,800	1,004.00	1,807,200
ケーズホールディングス	11,100	1,302.00	14,452,200
日産東京販売ホールディングス	400	494.00	197,600
シルバーライフ	500	837.00	418,500
Genky DrugStores	800	6,430.00	5,144,000
ナルミヤ・インターナショナル	400	1,212.00	484,800
ブックオフグループホールディングス	1,400	1,245.00	1,743,000
ギフトホールディングス	900	2,810.00	2,529,000
アインホールディングス	2,300	4,733.00	10,885,900
元気寿司	1,100	3,560.00	3,916,000
ヤマダホールディングス	49,700	444.80	22,106,560
アーケランズ	5,000	1,668.00	8,340,000
ニトリホールディングス	6,000	19,695.00	118,170,000
ケーユーホールディングス	1,000	1,199.00	1,199,000
吉野家ホールディングス	6,200	3,282.00	20,348,400
松屋フーズホールディングス	700	5,610.00	3,927,000
サガミホールディングス	2,200	1,546.00	3,401,200
関西フードマーケット	1,300	1,529.00	1,987,700
王将フードサービス	1,200	7,780.00	9,336,000
ミニストップ	700	1,613.00	1,129,100
アークス	3,000	2,914.00	8,742,000
パローホールディングス	3,200	2,528.00	8,089,600

ベルク	900	6,540.00	5,886,000	
大庄	500	1,340.00	670,000	
ファーストリテイリング	7,400	38,750.00	286,750,000	
サンドラッグ	5,700	4,479.00	25,530,300	
サクスパー ホールディングス	1,000	844.00	844,000	
やまや	200	3,295.00	659,000	
ペルーナ	4,000	617.00	2,468,000	
いよぎんホールディングス	18,300	1,019.00	18,647,700	
しずおかフィナンシャルグループ	34,200	1,404.50	48,033,900	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	12,900	1,077.50	13,899,750	
楽天銀行	5,500	2,333.00	12,831,500	
京都フィナンシャルグループ	19,400	2,436.00	47,258,400	
島根銀行	100	518.00	51,800	
じもとホールディングス	500	563.00	281,500	
めぶきフィナンシャルグループ	76,300	433.10	33,045,530	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	4,180.00	8,360,000	
九州フィナンシャルグループ	29,700	958.50	28,467,450	
ゆうちょ銀行	168,500	1,503.50	253,339,750	
富山第一銀行	4,700	849.00	3,990,300	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	82,400	699.70	57,655,280	
西日本フィナンシャルホールディングス	8,600	1,708.00	14,688,800	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,907.00	2,669,800	
第四北越フィナンシャルグループ	2,400	4,045.00	9,708,000	
ひろぎんホールディングス	21,900	983.00	21,527,700	
おきなわフィナンシャルグループ	1,300	2,482.00	3,226,600	
十六フィナンシャルグループ	2,000	4,175.00	8,350,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,600	4,250.00	6,800,000	
プロクレアホールディングス	1,700	1,841.00	3,129,700	
あいちフィナンシャルグループ	2,500	2,597.00	6,492,500	
あおぞら銀行	11,000	2,183.50	24,018,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	934,300	1,404.00	1,311,757,200	代用有価証券 90,000株
りそなホールディングス	178,800	813.60	145,471,680	
三井住友トラスト・ホールディングス	55,400	2,901.50	160,743,100	
三井住友フィナンシャルグループ	109,100	7,687.00	838,651,700	
千葉銀行	42,800	1,092.00	46,737,600	
群馬銀行	29,800	764.60	22,785,080	
武蔵野銀行	2,200	2,715.00	5,973,000	
千葉興業銀行	2,700	851.00	2,297,700	
筑波銀行	6,200	242.00	1,500,400	
七十七銀行	4,500	3,675.00	16,537,500	
秋田銀行	1,000	2,046.00	2,046,000	
山形銀行	1,600	1,123.00	1,796,800	

岩手銀行	900	2,495.00	2,245,500
東邦銀行	12,300	310.00	3,813,000
東北銀行	400	1,234.00	493,600
ふくおかフィナンシャルグループ	13,400	3,698.00	49,553,200
スルガ銀行	13,300	806.00	10,719,800
八十二銀行	33,000	793.80	26,195,400
山梨中央銀行	1,700	1,715.00	2,915,500
大垣共立銀行	2,900	1,956.00	5,672,400
福井銀行	1,300	1,733.00	2,252,900
清水銀行	600	1,567.00	940,200
滋賀銀行	2,500	3,835.00	9,587,500
南都銀行	2,300	2,626.00	6,039,800
百五銀行	14,400	561.00	8,078,400
紀陽銀行	5,400	1,732.00	9,352,800
ほくほくフィナンシャルグループ	9,500	1,588.50	15,090,750
山陰合同銀行	9,600	1,017.00	9,763,200
鳥取銀行	300	1,403.00	420,900
百十四銀行	1,500	2,725.00	4,087,500
四国銀行	2,200	1,059.00	2,329,800
阿波銀行	2,100	2,391.00	5,021,100
大分銀行	900	2,658.00	2,392,200
宮崎銀行	900	2,742.00	2,467,800
佐賀銀行	900	1,936.00	1,742,400
琉球銀行	3,300	1,141.00	3,765,300
セブン銀行	49,400	303.10	14,973,140
みずほフィナンシャルグループ	207,100	2,720.00	563,312,000
高知銀行	100	936.00	93,600
山口フィナンシャルグループ	15,100	1,435.50	21,676,050
名古屋銀行	1,000	5,650.00	5,650,000
北洋銀行	22,800	377.00	8,595,600
大光銀行	200	1,396.00	279,200
愛媛銀行	2,100	1,039.00	2,181,900
トマト銀行	300	1,210.00	363,000
京葉銀行	6,300	709.00	4,466,700
栃木銀行	7,100	306.00	2,172,600
北日本銀行	600	2,231.00	1,338,600
東和銀行	2,600	657.00	1,708,200
福島銀行	200	232.00	46,400
大東銀行	300	746.00	223,800
トモニホールディングス	14,700	391.00	5,747,700
フィデアホールディングス	1,500	1,582.00	2,373,000
池田泉州ホールディングス	21,500	345.00	7,417,500

F P G	5,600	1,776.00	9,945,600
ジャパンインベストメントアドバイザー	2,200	945.00	2,079,000
マーキュリアホールディングス	100	715.00	71,500
S B Iホールディングス	22,400	3,775.00	84,560,000
ジャフコ グループ	4,500	1,732.00	7,794,000
大和証券グループ本社	119,000	1,007.50	119,892,500
野村ホールディングス	258,600	807.70	208,871,220
岡三証券グループ	13,100	705.00	9,235,500
丸三証券	4,800	922.00	4,425,600
東洋証券	3,500	331.00	1,158,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	17,700	570.00	10,089,000
水戸証券	4,100	451.00	1,849,100
いちよし証券	2,800	748.00	2,094,400
松井証券	8,500	850.00	7,225,000
マネックスグループ	14,800	730.00	10,804,000
極東証券	2,000	998.00	1,996,000
岩井コスモホールディングス	1,800	2,113.00	3,803,400
アイザワ証券グループ	2,000	1,210.00	2,420,000
マネーパートナーズグループ	700	298.00	208,600
スパークス・グループ	2,200	1,772.00	3,898,400
かんぽ生命保険	15,500	2,735.00	42,392,500
F P パートナー	400	6,500.00	2,600,000
S O M P Oホールディングス	23,100	7,695.00	177,754,500
アニコム ホールディングス	5,900	583.00	3,439,700
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	34,300	5,991.00	205,491,300
第一生命ホールディングス	75,000	3,065.00	229,875,000
東京海上ホールディングス	151,600	3,878.00	587,904,800
T & Dホールディングス	41,200	2,334.50	96,181,400
アドバンスクリエイト	600	1,029.00	617,400
全国保証	4,000	5,481.00	21,924,000
あんしん保証	2,600	250.00	650,000
ジェイリース	800	2,331.00	1,864,800
イントラスト	1,000	785.00	785,000
日本モーゲージサービス	1,100	533.00	586,300
S B I アルヒ	1,200	909.00	1,090,800
プレミアグループ	2,900	1,686.00	4,889,400
ネットプロテクションズホールディングス	2,500	156.00	390,000
クレディセゾン	9,600	2,721.00	26,121,600
芙蓉総合リース	1,400	13,525.00	18,935,000
みずほリース	2,600	5,480.00	14,248,000
東京センチュリー	11,200	1,631.00	18,267,200
日本証券金融	5,200	1,562.00	8,122,400

アイフル	23,100	384.00	8,870,400
リコーリース	1,400	5,050.00	7,070,000
イオンフィナンシャルサービス	8,400	1,338.50	11,243,400
アコム	27,900	362.80	10,122,120
ジャックス	1,700	5,520.00	9,384,000
オリエントコーポレーション	5,100	1,065.00	5,431,500
オリックス	93,400	2,877.00	268,711,800
三菱HCキャピタル	68,100	1,045.50	71,198,550
日本取引所グループ	40,000	3,325.00	133,000,000
イー・ギャランティ	2,800	1,849.00	5,177,200
アサックス	600	719.00	431,400
NECキャピタルソリューション	600	3,605.00	2,163,000
大東建託	5,600	16,985.00	95,116,000
いちご	18,200	386.00	7,025,200
日本駐車場開発	16,900	179.00	3,025,100
スター・マイカ・ホールディングス	2,500	545.00	1,362,500
SREホールディングス	400	3,320.00	1,328,000
ヒューリック	36,100	1,594.00	57,543,400
野村不動産ホールディングス	8,600	3,739.00	32,155,400
三重交通グループホールディングス	3,800	610.00	2,318,000
サムティ	2,500	2,502.00	6,255,000
ディア・ライフ	3,100	980.00	3,038,000
コーセーアールイー	700	913.00	639,100
地主	1,400	2,262.00	3,166,800
プレサンスコーポレーション	2,600	1,704.00	4,430,400
THEグローバル社	1,400	386.00	540,400
JPMC	1,500	1,144.00	1,716,000
サンセイランディック	500	1,102.00	551,000
エストラスト	400	645.00	258,000
フージャースホールディングス	2,800	1,143.00	3,200,400
オープンハウスグループ	5,700	4,681.00	26,681,700
東急不動産ホールディングス	45,800	995.00	45,571,000
飯田グループホールディングス	14,500	2,139.50	31,022,750
イーランド	200	1,587.00	317,400
ムゲンエステート	900	1,151.00	1,035,900
ビーロッド	1,200	1,052.00	1,262,400
ファーストブラザーズ	300	1,256.00	376,800
And Doホールディングス	1,500	1,118.00	1,677,000
シーアールイー	1,000	1,388.00	1,388,000
ケイアイスター不動産	900	3,410.00	3,069,000
アグレ都市デザイン	400	1,620.00	648,000
グッドコムアセット	1,000	788.00	788,000

ジェイ・エス・ビー	900	2,711.00	2,439,900
ロードスターキャピタル	1,300	1,944.00	2,527,200
テンポイノベーション	700	936.00	655,200
グローバル・リンク・マネジメント	400	2,481.00	992,400
フェイスネットワーク	500	1,581.00	790,500
霞ヶ関キャピタル	500	11,680.00	5,840,000
パーク24	10,200	1,924.50	19,629,900
パラカ	800	2,005.00	1,604,000
ミガロホールディングス	400	1,481.00	592,400
三井不動産	71,000	3,997.00	283,787,000
三菱地所	100,400	2,098.00	210,639,200
平和不動産	2,500	3,770.00	9,425,000
東京建物	13,200	2,222.50	29,337,000
京阪神ビルディング	2,600	1,413.00	3,673,800
住友不動産	22,100	4,771.00	105,439,100
テオオーシー	3,000	669.00	2,007,000
東京楽天地	200	6,710.00	1,342,000
スターツコーポレーション	2,100	3,010.00	6,321,000
フジ住宅	2,200	712.00	1,566,400
空港施設	1,400	617.00	863,800
明和地所	1,400	1,316.00	1,842,400
ゴールドクレスト	900	2,302.00	2,071,800
エスリード	800	3,400.00	2,720,000
日神グループホールディングス	1,500	503.00	754,500
日本エスコン	3,200	988.00	3,161,600
MIRARTHホールディングス	5,900	502.00	2,961,800
イオンモール	7,600	1,853.50	14,086,600
毎日コムネット	600	743.00	445,800
カチタス	4,300	1,784.00	7,671,200
トーセイ	2,600	2,035.00	5,291,000
サンフロンティア不動産	2,600	1,718.00	4,466,800
FJネクストホールディングス	1,900	1,286.00	2,443,400
グランディハウス	700	658.00	460,600
日本空港ビルデング	5,300	5,883.00	31,179,900
明豊ファシリティワークス	800	943.00	754,400
LIFULL	2,500	192.00	480,000
MIXI	3,200	2,509.00	8,028,800
ジェイエイシーリクルートメント	6,300	689.00	4,340,700
日本M&Aセンターホールディングス	26,000	915.60	23,805,600
メンバーズ	100	952.00	95,200
中広	300	413.00	123,900
UTグループ	1,800	2,490.00	4,482,000

アイティメディア	1,100	1,979.00	2,176,900
ケアネット	2,700	707.00	1,908,900
E・Jホールディングス	900	1,673.00	1,505,700
オープンアップグループ	4,900	2,318.00	11,358,200
コシダカホールディングス	5,000	936.00	4,680,000
アルトナー	500	2,203.00	1,101,500
パソナグループ	1,700	2,705.00	4,598,500
CDS	300	1,711.00	513,300
リンクアンドモチベーション	5,200	568.00	2,953,600
エス・エム・エス	5,700	2,461.00	14,027,700
サニーサイドアップグループ	600	595.00	357,000
パーソルホールディングス	163,100	237.80	38,785,180
リニカル	300	520.00	156,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	800	727.00	581,600
学情	900	1,805.00	1,624,500
スタジオアリス	500	2,098.00	1,049,000
シミックホールディングス	500	2,640.00	1,320,000
エプコ	300	944.00	283,200
NJS	200	2,735.00	547,000
総合警備保障	26,700	798.70	21,325,290
カカクコム	10,800	1,790.50	19,337,400
アイロムグループ	700	2,057.00	1,439,900
セントケア・ホールディング	1,500	974.00	1,461,000
ルネサンス	500	929.00	464,500
ディップ	2,600	2,659.00	6,913,400
デジタルホールディングス	300	1,249.00	374,700
新日本科学	1,500	1,557.00	2,335,500
キャリアデザインセンター	300	1,801.00	540,300
ベネフィット・ワン	5,700	2,097.00	11,952,900
エムスリー	31,600	1,977.50	62,489,000
ツカダ・グローバルホールディング	400	428.00	171,200
プラス	500	719.00	359,500
アウトソーシング	10,300	1,740.50	17,927,150
ウェルネット	600	556.00	333,600
ワールドホールディングス	900	3,040.00	2,736,000
ディー・エヌ・エー	5,200	1,528.50	7,948,200
博報堂DYホールディングス	19,700	1,193.50	23,511,950
ぐるなび	400	264.00	105,600
タカミヤ	1,300	487.00	633,100
ファンコミュニケーションズ	2,500	399.00	997,500
ライク	900	1,525.00	1,372,500
エスプール	5,900	307.00	1,811,300

WDBホールディングス	900	2,285.00	2,056,500
ティア	600	484.00	290,400
アドウェイズ	2,700	511.00	1,379,700
バリューコマース	1,700	1,228.00	2,087,600
インフォマート	14,600	389.00	5,679,400
J Pホールディングス	4,900	433.00	2,121,700
プレステージ・インターナショナル	7,500	585.00	4,387,500
アミューズ	600	1,605.00	963,000
ドリームインキュベータ	700	3,035.00	2,124,500
クイック	1,200	2,416.00	2,899,200
電通グループ	15,600	3,962.00	61,807,200
テイクアンドギヴ・ニーズ	100	1,198.00	119,800
ぴあ	600	3,360.00	2,016,000
イオンファンタジー	200	2,449.00	489,800
シーティーエス	2,600	734.00	1,908,400
NEXYZ . Group	500	698.00	349,000
H . U . グループホールディングス	4,300	2,678.00	11,515,400
アルプス技研	1,700	2,894.00	4,919,800
日本空調サービス	2,000	896.00	1,792,000
オリエンタルランド	84,800	5,112.00	433,497,600
ダスキン	3,400	3,455.00	11,747,000
明光ネットワークジャパン	2,000	716.00	1,432,000
ファルコホールディングス	700	2,056.00	1,439,200
ラウンドワン	15,500	686.00	10,633,000
リゾートトラスト	6,800	2,559.00	17,401,200
ビー・エム・エル	1,900	2,856.00	5,426,400
リソー教育	9,800	240.00	2,352,000
早稲田アカデミー	1,100	1,748.00	1,922,800
ユー・エス・エス	17,900	2,688.00	48,115,200
東京個別指導学院	3,100	450.00	1,395,000
サイバーエージェント	34,700	1,023.00	35,498,100
楽天グループ	136,300	635.00	86,550,500
クリーク・アンド・リバー社	1,000	1,998.00	1,998,000
SBIグローバルアセットマネジメント	3,700	695.00	2,571,500
テー・オー・ダブリュー	4,000	343.00	1,372,000
山田コンサルティンググループ	900	1,751.00	1,575,900
セントラルスポーツ	600	2,489.00	1,493,400
フルキャストホールディングス	1,700	1,790.00	3,043,000
エン・ジャパン	2,300	2,741.00	6,304,300
リソルホールディングス	100	6,110.00	611,000
テクノプロ・ホールディングス	9,500	3,365.00	31,967,500
アイ・アールジャパンホールディングス	1,000	1,321.00	1,321,000

KeepEr 技研	1,000	6,520.00	6,520,000
ファーストロジック	700	503.00	352,100
三機サービス	300	1,346.00	403,800
Gunosy	200	730.00	146,000
イー・ガーディアン	900	1,409.00	1,268,100
リブセンス	1,500	243.00	364,500
ジャパンマテリアル	4,900	2,575.00	12,617,500
ベクトル	2,200	1,185.00	2,607,000
チャーム・ケア・コーポレーション	1,600	1,373.00	2,196,800
キャリアリンク	700	2,631.00	1,841,700
I B J	2,000	680.00	1,360,000
アサンテ	800	1,665.00	1,332,000
バリューHR	1,700	1,391.00	2,364,700
M&Aキャピタルパートナーズ	1,300	2,394.00	3,112,200
ライドオンエクスプレスホールディングス	800	1,037.00	829,600
E R Iホールディングス	400	1,875.00	750,000
シグマクス・ホールディングス	2,400	1,684.00	4,041,600
ウィルグループ	1,600	1,192.00	1,907,200
メドピア	800	688.00	550,400
レアジョブ	400	913.00	365,200
リクルートホールディングス	118,600	5,783.00	685,863,800
エラン	2,500	1,059.00	2,647,500
日本郵政	188,300	1,416.00	266,632,800
ベルシステム24ホールディングス	1,800	1,789.00	3,220,200
鎌倉新書	1,800	620.00	1,116,000
一蔵	200	618.00	123,600
エアトリ	1,300	1,819.00	2,364,700
アトラエ	100	665.00	66,500
ストライク	700	4,840.00	3,388,000
ソラスト	4,900	570.00	2,793,000
セラク	900	1,119.00	1,007,100
インソース	3,900	779.00	3,038,100
バイカレント・コンサルティング	11,900	3,129.00	37,235,100
Orchestra Holdings	300	990.00	297,000
アイモバイル	3,300	453.00	1,494,900
MS - Japan	800	1,266.00	1,012,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,300	2,164.00	11,469,200
グリーンズ	500	2,049.00	1,024,500
ウェルビー	900	851.00	765,900
エル・ティー・エス	200	2,863.00	572,600
ミダックホールディングス	1,200	1,691.00	2,029,200
キュービーネットホールディングス	1,000	1,480.00	1,480,000

マネジメントソリューションズ	800	2,816.00	2,252,800
プロレド・パートナーズ	300	355.00	106,500
フロンティア・マネジメント	700	1,555.00	1,088,500
コプロ・ホールディングス	300	1,626.00	487,800
アンビスホールディングス	1,800	2,755.00	4,959,000
カーブスホールディングス	4,500	751.00	3,379,500
フォーラムエンジニアリング	2,600	797.00	2,072,200
Fast Fitness Japan	1,000	1,104.00	1,104,000
ダイレクトマーケティングミックス	2,300	442.00	1,016,600
ポピンズ	300	1,364.00	409,200
LITALICO	1,400	2,167.00	3,033,800
コンフィデンス・インターワークス	200	1,605.00	321,000
アドバンテッジリスクマネジメント	300	455.00	136,500
リログループ	8,200	1,575.50	12,919,100
東祥	300	777.00	233,100
ID&Eホールディングス	800	3,680.00	2,944,000
ビーウィズ	600	1,811.00	1,086,600
TREホールディングス	2,600	1,261.00	3,278,600
人・夢・技術グループ	300	1,896.00	568,800
NISSOホールディングス	1,700	819.00	1,392,300
大栄環境	2,900	2,493.00	7,229,700
日本管財ホールディングス	1,700	2,558.00	4,348,600
M&A総研ホールディングス	800	5,950.00	4,760,000
エイチ・アイ・エス	4,100	1,774.00	7,273,400
ラックランド	400	2,612.00	1,044,800
共立メンテナンス	2,500	6,174.00	15,435,000
イチネンホールディングス	1,500	1,596.00	2,394,000
建設技術研究所	800	6,090.00	4,872,000
スペース	600	945.00	567,000
燦ホールディングス	1,400	1,119.00	1,566,600
スバル興業	500	3,140.00	1,570,000
タナベコンサルティンググループ	100	1,079.00	107,900
ナガワ	400	7,190.00	2,876,000
東京都競馬	1,300	4,580.00	5,954,000
カナモト	2,200	2,880.00	6,336,000
ニシオホールディングス	1,400	3,935.00	5,509,000
トランス・コスモス	2,000	2,950.00	5,900,000
乃村工藝社	6,400	868.00	5,555,200
藤田観光	700	6,700.00	4,690,000
KNT-CTホールディングス	1,300	1,307.00	1,699,100
トーカイ	1,400	2,121.00	2,969,400
白洋舎	300	2,736.00	820,800

セコム	16,300	10,710.00	174,573,000
セントラル警備保障	1,000	2,573.00	2,573,000
丹青社	2,400	807.00	1,936,800
メイテックグループホールディングス	5,900	3,044.00	17,959,600
応用地質	1,200	2,156.00	2,587,200
船井総研ホールディングス	3,500	2,472.00	8,652,000
オオバ	800	1,009.00	807,200
いであ	200	2,130.00	426,000
学究社	800	2,081.00	1,664,800
ベネッセホールディングス	5,400	2,599.00	14,034,600
イオンディライト	1,800	3,755.00	6,759,000
ナック	1,400	542.00	758,800
ダイセキ	3,300	4,035.00	13,315,500
ステップ	700	2,016.00	1,411,200
合 計	23,828,000		56,368,493,750

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

貸借対照表

（単位：円）

2024年 2月 7日現在

資産の部	
流動資産	
預金	137,586,537
コール・ローン	4,453,274,652
株式	346,413,057,477
投資証券	6,834,316,280
派生商品評価勘定	161,253,448
未収入金	11,738,926
未収配当金	173,239,462
差入委託証拠金	546,515,622
流動資産合計	358,730,982,404
資産合計	358,730,982,404
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,130,446
未払解約金	54,697,541
未払利息	312
流動負債合計	61,828,299
負債合計	61,828,299
純資産の部	
元本等	
元本	62,314,238,388
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	296,354,915,717
元本等合計	358,669,154,105

2024年 2月 7日現在

純資産合計	358,669,154,105
負債純資産合計	358,730,982,404

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2024年 2月 7日現在
1.	期首	2023年 2月10日
	期首元本額	61,138,454,902円
	期首からの追加設定元本額	9,412,175,217円
	期首からの一部解約元本額	8,236,391,731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）	34,229,717,179円
	DCインデックスバランス（株式20）	109,912,399円
	DCインデックスバランス（株式40）	305,587,498円
	DCインデックスバランス（株式60）	666,876,506円
	DCインデックスバランス（株式80）	822,166,275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	1,137,936,676円
	日興五大陸株式ファンド	3,399,899,541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）	10,433,802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）	69,164,103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）	5,670,656,329円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	8,786,704,017円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	10,005,042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）	1,096,422,058円
	Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）	401,987,465円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	327,233円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	158,177円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,247,568,070円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	15,074,559円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	44,957,259円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	71,159,877円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	72,251,999円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,145,272,324円
	計	62,314,238,388円
2.	受益権の総数	62,314,238,388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 2023年 2月10日 至 2024年 2月 7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。
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。
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。

金融商品の時価等に関する事項

	2024年 2月 7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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

(2024年 2月 7日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	48,233,947,843
投資証券	1,015,120,280
合計	49,249,068,123

(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)

(2024年 2月 7日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,550,208,672	-	5,658,484,923	108,276,251
	合計	5,550,208,672	-	5,658,484,923	108,276,251

(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)

(2024年 2月 7日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	4,789,977,634	-	4,835,824,965	45,847,331
	米ドル	4,071,506,140	-	4,115,536,940	44,030,800
	ユーロ	718,471,494	-	720,288,025	1,816,531
	売建	18,627,900	-	18,628,480	580
	英ポンド	18,627,900	-	18,628,480	580
	合計	4,808,605,534	-	4,854,453,445	45,846,751

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2024年 2月 7日現在	
1口当たり純資産額	5.7558円
(1万口当たり純資産額)	(57,558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	30.52	389,130.00	
	BAKER HUGHES CO	40,615	29.39	1,193,674.85	
	CHENIERE ENERGY INC	9,500	160.26	1,522,470.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	3,750	76.03	285,112.50	
	CHEVRON CORP	74,761	152.35	11,389,838.35	
	CONOCOPHILLIPS	49,596	111.52	5,530,945.92	
	COTERRA ENERGY INC	32,460	24.32	789,427.20	
	DEVON ENERGY CORPORATION	25,260	41.08	1,037,680.80	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	6,540	151.99	994,014.60	
	EOG RESOURCES INC	23,472	111.88	2,626,047.36	
	EQT CORP	17,050	34.23	583,621.50	

EXXON MOBIL CORP	165,041	102.25	16,875,442.25
HALLIBURTON CO	37,607	34.82	1,309,475.74
HESS CORP	10,870	146.05	1,587,563.50
HF SINCLAIR CORP	5,940	56.50	335,610.00
KINDER MORGAN INC	81,490	16.69	1,360,068.10
MARATHON OIL CORP	28,380	22.53	639,401.40
MARATHON PETROLEUM CORP	16,742	166.64	2,789,886.88
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	28,351	57.57	1,632,167.07
ONEOK INC	24,500	67.94	1,664,530.00
OVINTIV INC	13,280	41.63	552,846.40
PHILLIPS 66	18,855	145.91	2,751,133.05
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,130	228.05	2,082,096.50
SCHLUMBERGER LTD	57,921	48.01	2,780,787.21
TARGA RESOURCES CORP	8,180	86.22	705,279.60
TEXAS PACIFIC LAND CORP	245	1,444.43	353,885.35
VALERO ENERGY CORP	14,682	137.83	2,023,620.06
WILLIAMS COS INC	47,324	34.30	1,623,213.20
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,115	218.05	1,987,525.75
ALBEMARLE CORP	4,750	113.02	536,845.00
AMCOR PLC	65,600	9.18	602,208.00
AVERY DENNISON CORP	3,040	198.44	603,257.60
BALL CORP	12,500	57.25	715,625.00
CELANESE CORP	4,090	147.87	604,788.30
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,820	76.14	595,414.80
CLEVELAND-CLIFFS INC	21,150	19.75	417,712.50
CORTEVA INC	28,172	52.09	1,467,479.48
CROWN HOLDINGS INC	4,565	76.67	349,998.55
DOW INC	31,205	54.04	1,686,318.20
DUPONT DE NEMOURS INC	19,162	65.74	1,259,709.88
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,815	82.61	397,767.15
ECOLAB INC	10,200	199.95	2,039,490.00
FMC CORP	4,840	53.45	258,698.00
FREEPORT-MCMORAN INC	58,548	40.17	2,351,873.16
INTERNATIONAL PAPER CO	13,670	33.14	453,023.80
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,675	80.77	862,219.75
LINDE PLC	20,180	415.56	8,386,000.80
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,570	94.47	998,547.90
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,720	514.51	1,399,467.20
MOSAIC CO/THE	13,580	30.35	412,153.00
NEWMONT CORP	49,002	33.66	1,649,407.32
NUCOR CORP	9,959	181.35	1,806,064.65
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	163.03	583,647.40
PPG INDUSTRIES INC	9,394	139.89	1,314,126.66

RELIANCE STEEL & ALUMINUM	2,770	291.39	807,150.30
RPM INTERNATIONAL INC	4,960	104.87	520,155.20
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,116	307.88	3,114,514.08
STEEL DYNAMICS INC	7,090	120.17	852,005.30
VULCAN MATERIALS CO	5,563	231.58	1,288,279.54
WESTLAKE CORP	1,360	139.36	189,529.60
WESTROCK CO	9,989	38.37	383,277.93
3M CO	23,576	93.76	2,210,485.76
AECOM	4,930	88.59	436,748.70
AERCAP HOLDINGS NV	9,760	77.20	753,472.00
ALLEGION PLC	3,340	126.03	420,940.20
AMETEK INC	10,233	166.08	1,699,496.64
AXON ENTERPRISE INC	3,320	259.46	861,407.20
BOEING CO/THE	23,742	208.58	4,952,106.36
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	5,240	177.95	932,458.00
CARLISLE COS INC	2,250	317.61	714,622.50
CARRIER GLOBAL CORP	33,088	54.31	1,797,009.28
CATERPILLAR INC	21,116	322.72	6,814,555.52
CNH INDUSTRIAL NV	40,400	12.42	501,768.00
CUMMINS INC	6,355	251.54	1,598,536.70
DEERE & CO	11,305	388.90	4,396,514.50
DOVER CORP	5,350	160.82	860,387.00
EATON CORP PLC	16,416	271.12	4,450,705.92
EMERSON ELECTRIC CO	22,490	94.26	2,119,907.40
FASTENAL CO	22,796	69.48	1,583,866.08
FERGUSON PLC	8,440	192.80	1,627,232.00
FORTIVE CORP	14,854	81.55	1,211,343.70
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	5,050	77.68	392,284.00
GENERAL DYNAMICS CORP	9,397	267.69	2,515,482.93
GENERAL ELECTRIC CO	45,057	137.58	6,198,942.06
GRACO INC	8,120	86.85	705,222.00
HEICO CORP	1,800	187.17	336,906.00
HEICO CORP-CLASS A	3,120	147.39	459,856.80
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	27,276	193.64	5,281,724.64
HOWMET AEROSPACE INC	17,943	58.43	1,048,409.49
HUBBELL INC	2,320	350.25	812,580.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,530	266.22	407,316.60
IDEX CORP	3,640	218.89	796,759.60
ILLINOIS TOOL WORKS	12,565	255.69	3,212,744.85
INGERSOLL-RAND INC	16,398	83.24	1,364,969.52
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,570	42.28	277,779.60
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	27,484	53.26	1,463,797.84
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,750	207.71	1,609,752.50

LENNOX INTERNATIONAL INC	1,385	425.28	589,012.80
LOCKHEED MARTIN CORP	9,246	426.95	3,947,579.70
MASCO CORP	9,849	68.78	677,414.22
NORDSON CORP	2,345	253.65	594,809.25
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,784	448.17	2,592,215.28
OTIS WORLDWIDE CORP	17,124	91.94	1,574,380.56
OWENS CORNING	3,550	153.26	544,073.00
PACCAR INC	20,706	104.23	2,158,186.38
PARKER HANNIFIN CORP	5,265	511.55	2,693,310.75
PENTAIR PLC	6,918	73.58	509,026.44
QUANTA SERVICES INC	5,710	206.11	1,176,888.10
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,618	259.98	1,200,587.64
RTX CORP	59,806	92.28	5,518,897.68
SMITH (A.O.) CORP	5,020	78.22	392,664.40
SNAP-ON INC	2,525	293.42	740,885.50
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,806	89.34	518,708.04
TEXTRON INC	7,956	86.09	684,932.04
TORO CO	3,890	92.06	358,113.40
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,066	270.23	2,449,905.18
TRANSDIGM GROUP INC	2,180	1,140.60	2,486,508.00
UNITED RENTALS INC	2,805	654.54	1,835,984.70
VERTIV HOLDINGS CO	13,800	59.12	815,856.00
WABTEC CORP	7,130	134.74	960,696.20
WATSCO INC	1,240	394.37	489,018.80
WW GRAINGER INC	1,847	940.34	1,736,807.98
XYLEM INC	10,898	119.56	1,302,964.88
AUTOMATIC DATA PROCESSING	17,001	250.81	4,264,020.81
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,070	144.05	730,333.50
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,400	198.85	874,940.00
CINTAS CORP	3,592	617.89	2,219,460.88
COPART INC	35,140	50.48	1,773,867.20
DAYFORCE INC	7,010	71.25	499,462.50
EQUIFAX INC	5,024	243.28	1,222,238.72
JACOBS SOLUTIONS INC	4,880	139.91	682,760.80
LEIDOS HOLDINGS INC	4,960	112.16	556,313.60
PAYCHEX INC	13,072	122.19	1,597,267.68
PAYCOM SOFTWARE INC	2,765	197.66	546,529.90
PAYLOCITY HOLDING CORP	1,730	166.18	287,491.40
REPUBLIC SERVICES INC	8,920	173.68	1,549,225.60
ROBERT HALF INC	4,415	80.10	353,641.50
ROLLINS INC	14,385	44.01	633,083.85
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	60.73	514,383.10
TRANSUNION	7,940	67.95	539,523.00

VERALTO CORP	9,343	77.62	725,203.66
VERISK ANALYTICS INC	5,810	248.47	1,443,610.70
WASTE CONNECTIONS INC	10,606	156.94	1,664,505.64
WASTE MANAGEMENT INC	16,834	189.21	3,185,161.14
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,930	74.52	367,383.60
CSX CORP	81,669	37.02	3,023,386.38
DELTA AIR LINES INC	5,705	40.18	229,226.90
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,467	126.01	814,906.67
FEDEX CORP	9,448	241.32	2,279,991.36
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	77,000	3.25	250,250.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,750	211.40	792,750.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,140	60.13	369,198.20
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,745	251.86	2,454,375.70
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,955	425.55	1,683,050.25
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	31.03	169,734.10
U-HAUL HOLDING CO	3,375	63.85	215,493.75
UBER TECHNOLOGIES INC	76,170	70.47	5,367,699.90
UNION PACIFIC CORP	25,226	249.87	6,303,220.62
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	29,977	145.92	4,374,243.84
APTIV PLC	12,290	84.19	1,034,695.10
BORGWARNER INC	9,120	34.07	310,718.40
FORD MOTOR COMPANY	159,205	12.07	1,921,604.35
GENERAL MOTORS CORP	57,905	38.03	2,202,127.15
LEAR CORP	2,290	135.19	309,585.10
LUCID GROUP INC	36,360	3.50	127,260.00
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	27,210	15.50	421,755.00
TESLA INC	117,905	185.10	21,824,215.50
DECKERS OUTDOOR CORP	1,220	825.35	1,006,927.00
DR HORTON INC	12,896	143.03	1,844,514.88
GARMIN LTD	7,025	121.81	855,715.25
HASBRO INC	5,188	49.24	255,457.12
LENNAR CORP-CL A	10,040	150.94	1,515,437.60
LULULEMON ATHLETICA INC	4,710	456.54	2,150,303.40
NIKE INC -CL B	50,428	102.61	5,174,417.08
NVR INC	148	7,332.82	1,085,257.36
PULTE GROUP INC	8,850	102.57	907,744.50
VF CORP	12,170	16.95	206,281.50
AIRBNB INC-CLASS A	17,500	144.53	2,529,275.00
BOOKING HOLDINGS INC	1,498	3,644.94	5,460,120.12
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,970	43.38	345,738.60
CARNIVAL CORP	38,787	15.97	619,428.39
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,120	2,487.74	2,786,268.80
DARDEN RESTAURANTS INC	4,853	165.92	805,209.76

DOMINO'S PIZZA INC	1,375	421.58	579,672.50
DOORDASH INC - A	11,010	112.34	1,236,863.40
DRAFTKINGS INC-CL A	20,420	41.74	852,330.80
EXPEDIA GROUP INC	6,032	153.70	927,118.40
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,650	194.62	2,072,703.00
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,680	129.49	217,543.20
LAS VEGAS SANDS CORP	14,390	52.17	750,726.30
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,673	244.76	2,612,323.48
MCDONALD'S CORP	30,131	284.65	8,576,789.15
MGM RESORTS INTERNATIONAL	12,900	44.69	576,501.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,948	120.57	1,199,430.36
STARBUCKS CORP	47,074	95.67	4,503,569.58
VAIL RESORTS INC	1,520	221.45	336,604.00
WYNN RESORTS LTD	4,180	100.06	418,250.80
YUM! BRANDS INC	11,394	127.27	1,450,114.38
ALPHABET INC-CL A	244,580	144.10	35,243,978.00
ALPHABET INC-CL C	215,130	145.41	31,282,053.30
CHARTER COMMUNICATION-A	3,926	290.28	1,139,639.28
COMCAST CORP-CLASS A	170,254	44.42	7,562,682.68
ELECTRONIC ARTS INC	10,834	135.26	1,465,406.84
FOX CORP - CLASS A	13,084	31.62	413,716.08
FOX CORP- CLASS B	5,466	29.34	160,372.44
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,096	32.99	498,017.04
LIBERTY BROADBAND-C	4,850	62.56	303,416.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	7,780	66.10	514,258.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW C	5,726	30.63	175,387.38
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,420	88.84	570,352.80
MATCH GROUP INC	10,912	36.04	393,268.48
META PLATFORMS INC-CLASS A	91,610	454.72	41,656,899.20
NETFLIX INC	18,310	555.88	10,178,162.80
NEWS CORP - CLASS A	14,750	24.68	364,030.00
OMNICOM GROUP	9,397	89.00	836,333.00
PARAMOUNT GLOBAL	22,823	13.99	319,293.77
PINTEREST INC- CLASS A	23,830	41.05	978,221.50
ROBLOX CORP -CLASS A	19,130	40.60	776,678.00
ROKU INC	4,700	93.48	439,356.00
SEA LTD-ADR	14,470	42.39	613,383.30
SIRIUS XM HOLDINGS INC	30,280	5.11	154,730.80
SNAP INC - A	45,300	17.45	790,485.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,240	166.67	1,206,690.80
THE WALT DISNEY CO.	75,332	99.29	7,479,714.28
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	19,370	68.60	1,328,782.00
WARNER BROS DISCOVERY INC	94,890	10.07	955,542.30

AMAZON.COM INC	383,070	169.15	64,796,290.50
AUTOZONE INC	722	2,811.86	2,030,162.92
BATH & BODY WORKS INC	9,270	43.14	399,907.80
BEST BUY CO INC	7,814	74.84	584,799.76
BURLINGTON STORES INC	2,585	194.12	501,800.20
CARMAX INC	5,949	71.83	427,316.67
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,270	156.94	356,253.80
EBAY INC	21,897	42.66	934,126.02
ETSY INC	4,800	74.85	359,280.00
GENUINE PARTS CO	5,751	141.32	812,731.32
GLOBAL-E ONLINE LTD	3,050	39.46	120,353.00
HOME DEPOT INC	41,305	356.25	14,714,906.25
LKQ CORP	10,260	47.12	483,451.20
LOWE'S COS INC	23,772	218.12	5,185,148.64
MERCADOLIBRE INC	1,905	1,710.39	3,258,292.95
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,420	1,051.86	2,545,501.20
POOL CORP	1,540	373.57	575,297.80
ROSS STORES INC	13,762	142.16	1,956,405.92
TJX COMPANIES INC	47,186	97.10	4,581,760.60
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,530	233.79	1,059,068.70
ULTA BEAUTY INC	2,100	502.00	1,054,200.00
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	17,570	21.24	373,186.80
COSTCO WHOLESALE CORP	18,199	710.79	12,935,667.21
DOLLAR GENERAL CORP	9,855	134.31	1,323,625.05
DOLLAR TREE INC	8,986	137.76	1,237,956.29
KROGER CO	30,580	44.99	1,375,794.20
SYSCO CORP	19,996	80.41	1,607,878.36
TARGET CORP	19,070	144.43	2,754,280.10
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	30,782	23.11	711,372.02
WALMART INC	60,882	169.81	10,338,372.42
ALTRIA GROUP INC	72,578	40.60	2,946,666.80
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,143	53.37	1,181,771.91
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,770	56.91	726,740.70
BUNGE GLOBAL SA	5,847	90.03	526,405.41
CAMPBELL SOUP CO	7,885	44.36	349,778.60
CELSIUS HOLDINGS INC	6,050	55.80	337,590.00
COCA-COLA CO/THE	168,402	59.94	10,094,015.88
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	7,710	67.79	522,660.90
CONAGRA BRANDS INC	20,640	28.62	590,716.80
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,560	248.65	1,631,144.00
DARLING INGREDIENTS INC	5,880	42.01	247,018.80
GENERAL MILLS INC	25,189	64.83	1,633,002.87
HERSHEY CO/THE	5,945	194.78	1,157,967.10

HORMEL FOODS CORP	15,290	30.09	460,076.10
JM SMUCKER CO/THE	4,100	132.21	542,061.00
KELLANOVA	11,098	54.43	604,064.14
KEURIG DR PEPPER INC	46,480	31.11	1,445,992.80
KRAFT HEINZ CO/THE	38,121	37.21	1,418,482.41
LAMB WESTON HOLDING INC	6,150	101.06	621,519.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,420	67.05	698,661.00
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,570	61.29	463,965.30
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	55,955	75.25	4,210,613.75
MONSTER BEVERAGE CORP	31,880	56.34	1,796,119.20
PEPSICO INC	56,371	171.42	9,663,116.82
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	64,268	91.66	5,890,804.88
TYSON FOODS INC-CL A	10,906	55.39	604,083.34
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,310	100.16	1,032,649.60
CLOROX COMPANY	5,266	154.77	815,018.82
COLGATE-PALMOLIVE CO	33,160	83.74	2,776,818.40
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,200	146.21	1,345,132.00
KENVUE INC	75,500	20.60	1,555,300.00
KIMBERLY-CLARK CORP	13,663	121.33	1,657,731.79
PROCTER & GAMBLE CO	97,029	158.96	15,423,729.84
ABBOTT LABORATORIES	71,686	114.00	8,172,204.00
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,060	288.44	882,626.40
BAXTER INTERNATIONAL INC	23,599	39.71	937,116.29
BECTON DICKINSON AND CO	11,547	238.68	2,756,037.96
BOSTON SCIENTIFIC CORP	59,988	64.79	3,886,622.52
CARDINAL HEALTH INC	10,305	104.07	1,072,441.35
CENCORA INC	7,014	235.01	1,648,360.14
CENTENE CORP	22,367	74.92	1,675,735.64
CIGNA GROUP/THE	12,190	327.58	3,993,200.20
COOPER COS INC/THE	2,025	374.70	758,767.50
CVS HEALTH CORP	53,288	73.76	3,930,522.88
DAVITA INC	2,108	112.08	236,264.64
DEXCOM INC	15,500	124.92	1,936,260.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	24,120	88.25	2,128,590.00
ELEVANCE HEALTH INC	9,716	493.83	4,798,052.28
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	16,705	81.96	1,369,141.80
HCA HEALTHCARE INC	8,190	306.82	2,512,855.80
HENRY SCHEIN INC	5,280	76.09	401,755.20
HOLOGIC INC	9,858	74.17	731,167.86
HUMANA INC	5,055	366.35	1,851,899.25
IDEXX LABORATORIES INC	3,360	567.00	1,905,120.00
INSULET CORP	2,745	199.63	547,984.35
INTUITIVE SURGICAL INC	14,535	389.69	5,664,144.15

LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,415	222.28	759,086.20
MCKESSON CORP	5,439	506.87	2,756,865.93
MEDTRONIC PLC	55,138	87.74	4,837,808.12
MOLINA HEALTHCARE INC	2,655	357.12	948,153.60
QUEST DIAGNOSTICS	4,386	126.26	553,776.36
RESMED INC	5,830	190.72	1,111,897.60
STERIS PLC	4,240	225.92	957,900.80
STRYKER CORP	14,053	339.77	4,774,787.81
TELEFLEX INC	1,820	252.25	459,095.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	38,150	510.67	19,482,060.50
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,720	162.15	441,048.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	6,870	209.33	1,438,097.10
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,412	127.60	1,073,371.20
ABBVIE INC	72,646	173.29	12,588,825.34
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,750	135.86	1,732,215.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,040	172.18	867,787.20
AMGEN INC	21,961	316.07	6,941,213.27
AVANTOR INC	27,110	23.65	641,151.50
BIO-RAD LABORATORIES-A	950	325.01	308,759.50
BIO-TECHNE CORP	6,730	67.37	453,400.10
BIOGEN INC	5,903	245.55	1,449,481.65
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,380	89.80	752,524.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	86,165	49.26	4,244,487.90
CATALENT INC	6,520	58.46	381,159.20
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,910	220.50	421,155.00
DANAHER CORP	28,879	248.20	7,167,767.80
ELI LILLY & CO	33,239	705.03	23,434,492.17
EXACT SCIENCES CORP	7,370	64.60	476,102.00
GILEAD SCIENCES INC	51,244	77.72	3,982,683.68
ILLUMINA INC	6,275	144.89	909,184.75
INCYTE CORP	7,670	59.63	457,362.10
IQVIA HOLDINGS INC	7,438	215.41	1,602,219.58
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,450	124.71	305,539.50
JOHNSON & JOHNSON	98,991	158.06	15,646,517.46
MERCK & CO. INC.	104,443	126.88	13,251,727.84
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	890	1,212.10	1,078,769.00
MODERNA INC	14,425	100.03	1,442,932.75
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,630	142.96	518,944.80
PFIZER INC	232,440	27.50	6,392,100.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,385	937.81	4,112,296.85
REPLIGEN CORP	2,250	200.52	451,170.00
REVVITY INC	4,910	104.22	511,720.20
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	14,330	30.19	432,622.70

TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43,590	12.25	533,977.50
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	15,879	560.28	8,896,686.12
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,900	214.95	408,405.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10,615	416.13	4,417,219.95
VIATRIS INC	53,899	11.89	640,859.11
WATERS CORP	2,331	330.38	770,115.78
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,960	398.27	1,178,879.20
ZOETIS INC	19,045	196.14	3,735,486.30
BANK OF AMERICA CORP	295,639	33.04	9,767,912.56
CITIGROUP INC	79,457	54.35	4,318,487.95
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,310	31.54	609,037.40
FIFTH THIRD BANCORP	26,459	33.47	885,582.73
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	450	1,483.05	667,372.50
HUNTINGTON BANCSHARES INC	68,620	12.37	848,829.40
JPMORGAN CHASE & CO	120,030	175.10	21,017,253.00
KEYCORP	36,108	13.90	501,901.20
M & T BANK CORP	6,913	132.27	914,382.51
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	16,200	149.29	2,418,498.00
REGIONS FINANCIAL CORP	35,844	17.86	640,173.84
TRUIST FINANCIAL CORP	53,220	36.25	1,929,225.00
US BANCORP	64,141	40.10	2,572,054.10
WELLS FARGO & CO	150,580	48.29	7,271,508.20
ALLY FINANCIAL INC	12,240	35.87	439,048.80
AMERICAN EXPRESS CO	25,944	205.65	5,335,383.60
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,225	388.05	1,639,511.25
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,800	104.47	1,650,626.00
ARES MANAGEMENT CORP-A	7,150	126.99	907,978.50
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	30,612	55.06	1,685,496.72
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	54,025	393.74	21,271,803.50
BLACKROCK INC	6,185	787.98	4,873,656.30
BLACKSTONE INC	29,080	123.56	3,593,124.80
BLOCK INC	23,390	67.00	1,567,130.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15,435	134.35	2,073,692.25
CARLYLE GROUP INC/THE	7,650	40.72	311,508.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,570	180.41	824,473.70
CME GROUP INC	14,740	202.78	2,988,977.20
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	6,900	119.79	826,551.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,750	105.66	1,135,845.00
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,420	32.74	472,110.80
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,590	477.41	759,081.90
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	24,198	61.62	1,491,080.76
FISERV INC	25,304	141.09	3,570,141.36
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,880	286.99	826,531.20

FRANKLIN RESOURCES INC	11,755	26.63	313,035.65
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	49.10	122,750.00
GLOBAL PAYMENTS INC	10,989	135.86	1,492,965.54
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,548	384.99	5,215,844.52
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	24,020	126.33	3,034,446.60
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,200	163.91	524,512.00
KKR & CO INC -A	24,780	93.58	2,318,912.40
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,185	241.50	769,177.50
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,545	221.26	341,846.70
MASTERCARD INC - A	34,745	460.50	16,000,072.50
MOODY'S CORP	7,072	398.05	2,815,009.60
MORGAN STANLEY	51,103	86.10	4,399,968.30
MSCI INC	3,175	582.00	1,847,850.00
NASDAQ INC	15,895	56.32	895,206.40
NORTHERN TRUST CORP	9,930	78.20	776,526.00
PAYPAL HOLDINGS INC	42,267	63.71	2,692,830.57
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,470	111.35	943,134.50
ROBINHOOD MARKETS INC - A	17,810	10.78	191,991.80
S&P GLOBAL INC	13,475	453.29	6,108,082.75
SCHWAB (CHARLES) CORP	62,413	61.89	3,862,740.57
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,375	65.71	287,481.25
STATE STREET CORP	12,947	72.45	938,010.15
SYNCHRONY FINANCIAL	19,010	38.79	737,397.90
T ROWE PRICE GROUP INC	10,315	108.98	1,124,128.70
TOAST INC-CLASS A	12,760	18.41	234,911.60
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,200	97.11	407,862.00
VISA INC-CLASS A SHARES	66,372	276.76	18,369,114.72
AFLAC INC	23,424	76.92	1,801,774.08
ALLSTATE CORP	10,513	157.35	1,654,220.55
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,660	119.71	318,428.60
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	30,345	68.77	2,086,825.65
AON PLC	8,567	300.83	2,577,210.61
ARCH CAPITAL GROUP LTD	16,205	83.30	1,349,876.50
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,610	234.05	2,015,170.50
ASSURANT INC	1,960	168.89	331,024.40
BROWN & BROWN INC	9,090	78.41	712,746.90
CHUBB LTD	16,895	247.67	4,184,384.65
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,350	112.10	823,935.00
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	940	347.49	326,640.60
EVEREST GROUP LTD	1,989	380.63	757,073.07
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	11,071	50.07	554,324.97
GLOBE LIFE INC	3,586	121.19	434,587.34
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,382	89.70	1,110,665.40

LOEWS CORP	7,145	72.81	520,227.45
MARKEL GROUP INC	530	1,407.76	746,112.80
MARSH & MCLENNAN COS	20,318	194.50	3,951,851.00
METLIFE INC	26,335	65.96	1,737,056.60
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,520	78.40	746,368.00
PROGRESSIVE CORP	24,160	180.27	4,355,323.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,962	103.39	1,546,921.18
TRAVELERS COS INC/THE	8,889	213.01	1,893,445.89
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,198	268.45	1,126,953.10
WR BERKLEY CORP	8,091	80.49	651,244.59
ACCENTURE PLC-CL A	25,863	364.70	9,432,236.10
ADOBE INC	18,759	607.14	11,389,339.26
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,030	124.48	750,614.40
ANSYS INC	3,515	336.66	1,183,359.90
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,300	193.32	251,316.00
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	6,850	211.26	1,447,131.00
AUTODESK INC	8,720	253.98	2,214,705.60
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,530	50.94	383,578.20
BILL HOLDINGS INC	3,910	76.70	299,897.00
CADENCE DESIGN SYS INC	11,430	292.80	3,346,704.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,840	162.45	623,808.00
CLOUDFLARE INC-CLASS A	11,830	81.59	965,209.70
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	20,318	78.73	1,599,636.14
CONFLUENT INC-CLASS A	6,870	23.48	161,307.60
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	8,990	302.11	2,715,968.90
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,650	239.86	395,769.00
DATADOG INC-CLASS A	10,880	129.18	1,405,478.40
DOCUSIGN INC	8,320	52.17	434,054.40
DROPBOX INC-CLASS A	11,660	32.70	381,282.00
DYNATRACE INC	9,850	59.58	586,863.00
EPAM SYSTEMS INC	2,280	289.15	659,262.00
FAIR ISAAC CORP	1,120	1,259.81	1,410,987.20
FORTINET INC	26,965	67.48	1,819,598.20
GARTNER INC	3,490	461.70	1,611,333.00
GEN DIGITAL INC	24,365	20.59	501,675.35
GODADDY INC-CLASS A	6,020	109.50	659,190.00
HUBSPOT INC	1,885	605.93	1,142,178.05
INTL BUSINESS MACHINES CORP	37,682	183.41	6,911,255.62
INTUIT INC	11,551	635.30	7,338,350.30
MANHATTAN ASSOCIATES INC	2,350	247.52	581,672.00
MICROSOFT CORP	291,004	405.49	117,999,211.96
MONDAY.COM LTD	980	215.36	211,052.80
MONGODB INC	2,990	443.31	1,325,496.90

OKTA INC	6,340	81.86	518,992.40
ORACLE CORP	67,973	115.30	7,837,286.90
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	76,690	21.87	1,677,210.30
PALO ALTO NETWORKS INC	12,635	341.49	4,314,726.15
PTC INC	5,250	177.11	929,827.50
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,200	545.30	2,290,260.00
SALESFORCE INC	40,146	285.83	11,474,931.18
SERVICENOW INC	8,415	777.45	6,542,241.75
SNOWFLAKE INC-CLASS A	11,660	213.68	2,491,508.80
SPLUNK INC	6,610	153.50	1,014,635.00
SYNOPSYS INC	6,287	542.43	3,410,257.41
TWILIO INC - A	7,225	69.12	499,392.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,830	430.52	787,851.60
UIPATH INC - CLASS A	17,970	23.15	416,005.50
UNITY SOFTWARE INC	9,650	32.05	309,282.50
VERISIGN INC	3,690	198.71	733,239.90
WIX.COM LTD	2,280	129.21	294,598.80
WORKDAY INC-CLASS A	8,580	288.63	2,476,445.40
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	9,630	63.60	612,468.00
ZSCALER INC	3,630	234.73	852,069.90
AMPHENOL CORP-CL A	25,480	102.77	2,618,579.60
APPLE INC	644,914	189.30	122,082,220.20
ARISTA NETWORKS INC	10,420	264.89	2,760,153.80
CDW CORP/DE	5,895	230.50	1,358,797.50
CISCO SYSTEMS INC	166,640	49.98	8,328,667.20
CORNING INC	33,518	32.04	1,073,916.72
DELL TECHNOLOGIES -C	11,022	82.68	911,298.96
F5 INC	2,385	182.47	435,190.95
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	50,105	15.28	765,604.40
HP INC	40,345	28.29	1,141,360.05
JABIL INC	5,590	129.76	725,358.40
JUNIPER NETWORKS INC	13,453	36.99	497,626.47
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,160	155.97	1,116,745.20
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,880	325.38	2,238,614.40
NETAPP INC	8,246	87.60	722,349.60
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,794	86.20	671,842.80
SUPER MICRO COMPUTER INC	1,970	681.59	1,342,732.30
TE CONNECTIVITY LTD	12,995	141.55	1,839,442.25
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,020	434.04	876,760.80
TRIMBLE INC	9,520	51.69	492,088.80
WESTERN DIGITAL CORP	11,688	58.45	683,163.60
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,075	242.49	503,166.75
AT&T INC	295,207	17.61	5,198,595.27

LIBERTY GLOBAL LTD-C	10,361	20.41	211,468.01
T-MOBILE US INC	21,939	161.00	3,532,179.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	173,587	41.10	7,134,425.70
AES CORP	27,958	16.50	461,307.00
ALLIANT ENERGY CORP	12,150	47.76	580,284.00
AMEREN CORPORATION	10,152	68.38	694,193.76
AMERICAN ELECTRIC POWER	22,348	77.23	1,725,936.04
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,705	122.52	944,016.60
ATMOS ENERGY CORP	6,760	111.81	755,835.60
CENTERPOINT ENERGY INC	23,972	27.61	661,866.92
CMS ENERGY CORP	11,090	56.47	626,252.30
CONSOLIDATED EDISON INC	14,236	89.77	1,277,965.72
CONSTELLATION ENERGY	13,168	131.01	1,725,139.68
DOMINION ENERGY INC	33,331	45.09	1,502,894.79
DTE ENERGY COMPANY	8,318	104.21	866,818.78
DUKE ENERGY CORP	31,856	95.06	3,028,231.36
EDISON INTERNATIONAL	16,329	65.13	1,063,507.77
ENERGY CORP	7,967	99.45	792,318.15
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,210	35.55	398,515.50
EVERGY INC	8,720	49.66	433,035.20
EVERSOURCE ENERGY	14,310	53.74	769,019.40
EXELON CORP	43,056	33.91	1,460,028.96
FIRSTENERGY CORP	23,295	35.81	834,193.95
NEXTERA ENERGY INC	84,940	56.23	4,776,176.20
NISOURCE INC	15,610	25.08	391,498.80
NRG ENERGY INC	8,760	53.52	468,835.20
P G & E CORP	85,070	16.24	1,381,536.80
PPL CORP	30,338	25.69	779,383.22
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	19,888	58.98	1,172,994.24
SEMPRA	24,864	69.76	1,734,512.64
SOUTHERN CO	45,075	67.40	3,038,055.00
VISTRA CORP	14,720	43.26	636,787.20
WEC ENERGY GROUP INC	14,270	78.34	1,117,911.80
XCEL ENERGY INC	22,174	58.44	1,295,848.56
ADVANCED MICRO DEVICES	66,714	167.88	11,199,946.32
ANALOG DEVICES INC	20,667	189.71	3,920,736.57
APPLIED MATERIALS INC	34,463	168.70	5,813,908.10
BROADCOM INC	18,300	1,222.65	22,374,495.00
ENPHASE ENERGY INC	5,440	100.51	546,774.40
ENTEGRIS INC	6,650	118.57	788,490.50
FIRST SOLAR INC	4,260	141.11	601,128.60
INTEL CORP	172,282	42.74	7,363,332.68
KLA CORP	5,589	601.62	3,362,454.18

	LAM RESEARCH CORP	5,482	834.62	4,575,386.84	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	6,540	61.55	402,537.00	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	36,844	67.08	2,471,495.52	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,028	83.25	1,833,831.00	
	MICRON TECHNOLOGY INC	45,547	84.60	3,853,276.20	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,820	632.98	1,152,023.60	
	NVIDIA CORP	101,870	682.23	69,498,770.10	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	10,447	223.00	2,329,681.00	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	17,340	76.32	1,323,388.80	
	QORVO INC	4,240	108.61	460,506.40	
	QUALCOMM INC	45,952	144.10	6,621,683.20	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,440	103.05	663,642.00	
	TERADYNE INC	6,190	97.75	605,072.50	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	37,392	158.37	5,921,771.04	
	CBRE GROUP INC - A	12,560	84.19	1,057,426.40	
	COSTAR GROUP INC	16,800	83.88	1,409,184.00	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,500	3.18	128,790.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	6,370	57.06	363,472.20	
米ドル小計		14,014,321		1,765,954,903.59 (261,149,411,142)	
加ドル	ARC RESOURCES LTD	25,510	20.08	512,240.80	
	CAMECO CORP	19,282	64.23	1,238,482.86	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	45,034	82.23	3,703,145.82	
	CENOVUS ENERGY INC	57,213	21.38	1,223,213.94	
	ENBRIDGE INC	87,847	46.74	4,105,968.78	
	IMPERIAL OIL LTD	8,922	77.47	691,187.34	
	KEYERA CORP	8,460	31.52	266,659.20	
	MEG ENERGY CORP	11,500	23.87	274,505.00	
	PARKLAND CORP	6,170	45.78	282,462.60	
	PEMBINA PIPELINE CORP	23,552	45.30	1,066,905.60	
	SUNCOR ENERGY INC	53,489	43.13	2,306,980.57	
	TC ENERGY CORP	41,663	51.29	2,136,895.27	
	TOURMALINE OIL CORP	15,980	54.96	878,260.80	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	21,496	64.46	1,385,632.16	
	BARRICK GOLD CORP	69,624	20.26	1,410,582.24	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	57.35	329,762.50	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	12.52	283,578.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,125	144.16	1,171,300.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	24,510	14.08	345,100.80	
	KINROSS GOLD CORP	46,025	7.34	337,823.50	
	LUNDIN MINING CORP	25,010	11.15	278,861.50	
	NUTRIEN LTD	20,908	67.98	1,421,325.84	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	12,860	17.97	231,094.20	

TECK RESOURCES LTD-CLS B	21,725	52.21	1,134,262.25
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,450	104.03	254,873.50
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,165	63.33	1,213,719.45
CAE INC	12,305	27.30	335,926.50
STANTEC INC	4,100	108.84	446,244.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,260	117.41	382,756.60
WSP GLOBAL INC	5,800	201.51	1,168,758.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	13,800	22.50	310,500.00
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,410	47.60	352,716.00
RB GLOBAL INC	7,560	89.52	676,771.20
THOMSON REUTERS CORP	7,350	201.30	1,479,555.00
AIR CANADA	7,190	18.61	133,805.90
CANADIAN NATL RAILWAY CO	22,438	173.00	3,881,774.00
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	38,511	113.67	4,377,545.37
TFI INTERNATIONAL INC	3,210	182.41	585,536.10
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,668	78.80	840,638.40
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,570	90.22	141,645.40
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,040	45.32	319,052.80
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,998	102.94	1,132,134.12
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,250	145.06	326,385.00
DOLLARAMA INC	12,990	99.54	1,293,024.60
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	30,860	79.19	2,443,803.40
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	34.50	239,775.00
LOBLAW COMPANIES LTD	6,339	134.90	855,131.10
METRO INC	9,570	70.33	673,058.10
WESTON (GEORGE) LTD	2,808	170.52	478,820.16
SAPUTO INC	9,620	28.18	271,091.60
BANK OF MONTREAL	30,681	124.14	3,808,739.34
BANK OF NOVA SCOTIA	47,539	62.97	2,993,530.83
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	37,740	60.52	2,284,024.80
NATIONAL BANK OF CANADA	13,750	101.90	1,401,125.00
ROYAL BANK OF CANADA	57,769	130.73	7,552,141.37
TORONTO-DOMINION BANK	74,780	80.67	6,032,502.60
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	13,859	53.56	742,288.04
BROOKFIELD CORP	57,209	53.49	3,060,109.41
IGM FINANCIAL INC	3,335	36.23	120,827.05
ONEX CORPORATION	2,765	103.79	286,979.35
TMX GROUP LTD	10,850	33.95	368,357.50
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	1,402.91	1,262,619.00
GREAT-WEST LIFECO INC	11,324	44.58	504,823.92
IA FINANCIAL CORP INC	4,075	91.79	374,044.25
INTACT FINANCIAL CORP	7,215	207.76	1,498,988.40
MANULIFE FINANCIAL CORP	71,921	30.01	2,158,349.21

	POWER CORP OF CANADA	20,479	39.11	800,933.69
	SUN LIFE FINANCIAL INC	24,774	70.54	1,747,557.96
	CGI INC	8,030	150.34	1,207,230.20
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	810	3,631.63	2,941,620.30
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,740	118.59	443,526.60
	OPEN TEXT CORP	11,190	55.76	623,954.40
	SHOPIFY INC - CLASS-A	49,910	109.97	5,488,602.70
	BCE INC	3,000	53.46	160,380.00
	QUEBECOR INC -CL B	6,110	32.06	195,886.60
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	13,875	62.87	872,321.25
	TELUS CORP	12,662	23.48	297,303.76
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	7.90	213,932.00
	ALTAGAS LTD	11,170	27.30	304,941.00
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	35.98	195,911.10
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	30.65	139,764.00
	EMERA INC	10,460	48.29	505,113.40
	FORTIS INC	22,635	53.52	1,211,425.20
	HYDRO ONE LTD	13,230	40.03	529,596.90
	NORTHLAND POWER INC	8,600	23.90	205,540.00
	FIRSTSERVICE CORP	1,500	221.49	332,235.00
加ドル小計		1,654,489		104,498,499.00 (11,456,170,445)
ユーロ	PLUXEE FRANCE SA	3,240	27.10	87,804.00
	ENI SPA	100,696	14.60	1,470,362.99
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	18,755	14.43	270,728.42
	NESTE OYJ	16,380	31.65	518,427.00
	OMV AG	5,480	40.02	219,309.60
	REPSOL SA	54,849	13.54	742,929.70
	TENARIS SA	17,895	14.80	264,846.00
	TOTALENERGIES SE	94,867	60.30	5,720,480.10
	AIR LIQUIDE SA	21,539	171.88	3,702,123.32
	AKZO NOBEL	6,937	71.24	494,191.88
	ARCELORMITTAL	20,552	25.47	523,459.44
	ARKEMA	2,215	99.26	219,860.90
	BASF SE	37,045	45.35	1,679,990.75
	COVESTRO AG	7,410	48.25	357,532.50
	DSM-FIRMENICH AG	7,552	93.92	709,283.84
	EVONIK INDUSTRIES AG	8,230	17.59	144,806.85
	HEIDELBERG MATERIALS AG	5,715	86.40	493,776.00
	OCI NV	4,810	27.03	130,014.30
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	13,250	33.67	446,127.50
	STORA ENSO OYJ-R SHS	25,365	11.25	285,483.07
	SYENSQO SA	2,811	84.87	238,569.57

SYMRISE AG	5,790	97.14	562,440.60
UMICORE	7,960	20.75	165,170.00
UPM-KYMMENE OYJ	21,098	29.55	623,445.90
VOESTALPINE AG	4,249	27.36	116,252.64
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,876	36.50	287,474.00
AIRBUS GROUP SE	24,468	151.74	3,712,774.32
ALSTOM	11,635	11.49	133,744.32
BOUYGUES SA	8,460	33.79	285,863.40
BRENTAG SE	6,865	80.52	552,769.80
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	19,106	65.95	1,260,040.70
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	23,136	34.06	788,012.16
DASSAULT AVIATION SA	900	175.20	157,680.00
EIFFAGE	3,250	97.90	318,175.00
FERROVIAL SE	24,155	35.52	857,985.60
GEA GROUP AG	6,020	37.07	223,161.40
IMCD NV	2,120	141.80	300,616.00
KINGSPAN GROUP PLC	5,900	74.44	439,196.00
KNORR-BREMSE AG	2,970	58.34	173,269.80
KONE OYJ-B	13,614	46.20	628,966.80
LEGRAND SA	11,128	91.12	1,013,983.36
LEONARDO SPA	16,300	16.85	274,655.00
METSO CORPORATION	24,200	9.23	223,414.40
MTU AERO ENGINES AG	2,020	216.50	437,330.00
PRYSMIAN SPA	9,565	41.73	399,147.45
RATIONAL AG	230	731.00	168,130.00
RHEINMETALL AG	1,730	333.50	576,955.00
SAFRAN SA	14,450	177.00	2,557,650.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	22,558	193.20	4,358,205.60
SIEMENS AG-REG	31,476	167.38	5,268,452.88
SIEMENS ENERGY AG	21,343	14.24	303,924.32
THALES SA	4,925	136.85	673,986.25
VINCI SA	20,600	118.74	2,446,044.00
WARTSILA OYJ ABP	18,180	13.89	252,520.20
BUREAU VERITAS SA	10,920	24.88	271,689.60
RANDSTAD NV	4,675	53.42	249,738.50
TELEPERFORMANCE	2,240	144.15	322,896.00
WOLTERS KLUWER	10,027	139.15	1,395,257.05
ADP	1,090	126.10	137,449.00
AENA SA	3,750	172.10	645,375.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	7.75	185,261.04
DEUTSCHE POST AG-REG	39,823	44.40	1,768,340.31
GETLINK	17,310	16.09	278,517.90
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,355	97.56	1,302,913.80

BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,210	91.85	202,988.50
CONTINENTAL AG	4,385	74.70	327,559.50
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	4,380	81.22	355,743.60
FERRARI NV	5,459	351.40	1,918,292.60
MERCEDES-BENZ GROUP AG	34,202	63.96	2,187,559.92
MICHELIN (CGDE)	30,986	30.83	955,298.38
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	45.97	260,649.90
RENAULT SA	8,247	35.48	292,644.79
STELLANTIS NV	90,796	21.45	1,947,574.20
VOLKSWAGEN AG	1,151	131.20	151,011.20
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,073	118.04	952,936.92
ADIDAS AG	6,571	176.20	1,157,810.20
HERMES INTERNATIONAL	1,272	2,017.50	2,566,260.00
KERING	3,007	391.70	1,177,841.90
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	11,359	779.50	8,854,340.50
MONCLER SPA	8,080	58.38	471,710.40
PUMA SE	4,200	39.84	167,328.00
SEB SA	987	112.50	111,037.50
ACCOR SA	10,106	36.94	373,315.64
AMADEUS IT GROUP SA	18,350	64.16	1,177,336.00
DELIVERY HERO SE	6,600	17.55	115,843.20
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	38.56	150,384.00
SODEXO SA	3,240	77.38	250,711.20
BOLLORE SE	33,530	6.22	208,724.25
PUBLICIS GROUPE	9,305	92.64	862,015.20
SCOUT24 SE	2,970	66.88	198,633.60
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	36,410	27.28	993,264.80
VIVENDI SE	26,070	10.30	268,521.00
D' IETEREN GROUP	1,050	177.70	186,585.00
INDITEX	43,905	39.07	1,715,368.35
PROSUS NV	62,794	29.40	1,846,143.60
ZALANDO SE	8,260	18.67	154,255.50
CARREFOUR SA	22,633	15.78	357,261.90
HELLOFRESH SE	6,070	13.66	82,946.55
JERONIMO MARTINS	10,585	22.52	238,374.20
KESKO OYJ-B SHS	10,930	17.75	194,007.50
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	40,028	26.03	1,042,128.98
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	36,121	58.14	2,100,074.94
DANONE	25,794	61.94	1,597,680.36
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,850	9.65	191,671.60
HEINEKEN HOLDING NV	4,895	78.65	384,991.75
HEINEKEN NV	12,733	94.78	1,206,833.74
JDE PEET'S NV	6,290	22.98	144,544.20

KERRY GROUP PLC-A	6,460	80.70	521,322.00
LOTUS BAKERIES	20	8,890.00	177,800.00
PERNOD-RICARD SA	8,296	157.15	1,303,716.40
REMY COINTREAU	810	99.48	80,578.80
BEIERSDORF AG	4,375	141.70	619,937.50
HENKEL AG & CO KGAA	4,520	63.62	287,562.40
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,793	71.34	484,612.62
L'OREAL	9,911	453.95	4,499,098.45
AMPLIFON SPA	4,830	31.18	150,599.40
BIOMERIEUX	1,690	97.26	164,369.40
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	103.85	167,198.50
DIASORIN ITALIA SPA	930	85.22	79,254.60
ESSILORLUXOTTICA	12,675	183.84	2,330,172.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	7,613	36.82	280,310.66
FRESENIUS SE & CO KGAA	20,905	25.77	538,721.85
KONINKLIJKE PHILIPS NV	36,772	19.58	720,142.84
SIEMENS HEALTHINEERS AG	13,430	53.46	717,967.80
ARGENX SE	2,315	363.10	840,576.50
BAYER AG-REG	43,824	29.20	1,279,879.92
EUROFINS SCIENTIFIC	5,050	53.92	272,296.00
GRIFOLS SA	12,050	10.55	127,127.50
IPSEN	1,600	106.50	170,400.00
MERCK KGAA	5,150	150.05	772,757.50
ORION OYJ-CLASS B	4,500	42.65	191,925.00
QIAGEN N.V.	10,072	41.50	417,988.00
RECORDATI SPA	3,720	51.10	190,092.00
SANOFI	47,166	87.23	4,114,290.18
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,230	339.50	417,585.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	251.00	271,080.00
UCB SA	4,928	86.70	427,257.60
ABN AMRO BANK NV-CVA	15,170	13.34	202,443.65
AIB GROUP PLC	51,000	3.97	202,674.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	241,763	9.10	2,201,010.35
BANCO BPM SPA	49,000	5.02	246,078.00
BANCO SANTANDER SA	662,389	3.74	2,482,302.77
BANK OF IRELAND GROUP PLC	44,790	8.02	359,215.80
BNP PARIBAS	44,242	55.08	2,436,849.36
CAIXABANK S.A	163,050	3.94	643,558.35
COMMERZBANK AG	40,474	10.74	434,690.76
CREDIT AGRICOLE SA	49,662	13.06	648,883.69
ERSTE GROUP BANK AG	13,018	39.84	518,637.12
FINECOBANK SPA	23,540	12.83	302,135.90
ING GROEP NV-CVA	146,925	12.15	1,785,432.60

INTESA SANPAOLO	658,093	2.90	1,909,785.88
KBC GROEP NV	9,719	58.40	567,589.60
MEDIOBANCA SPA	19,520	11.97	233,752.00
NORDEA BANK ABP	131,132	10.81	1,417,799.18
SOCIETE GENERALE	30,909	22.53	696,379.77
UNICREDIT SPA	68,256	28.77	1,963,725.12
ADYEN NV	865	1,191.00	1,030,215.00
AMUNDI SA	2,140	62.10	132,894.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	80,935	12.28	994,529.28
DEUTSCHE BOERSE AG	7,600	186.65	1,418,540.00
EDENRED	9,626	54.82	527,697.32
EURAZEO SE	1,487	77.30	114,945.10
EURONEXT NV	3,470	80.25	278,467.50
EXOR NV	4,164	92.82	386,502.48
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,452	70.00	241,640.00
NEXI SPA	21,240	7.10	150,888.96
SOFINA	655	218.60	143,183.00
WORLDLINE SA	8,950	12.01	107,534.25
AEGON LTD	69,679	5.42	377,660.18
AGEAS	5,924	38.18	226,178.32
ALLIANZ SE-REG	16,723	248.10	4,148,976.30
ASR NEDERLAND NV	5,880	42.75	251,370.00
ASSICURAZIONI GENERALI	42,248	20.62	871,153.76
AXA SA	75,752	30.64	2,321,041.28
HANNOVER RUECK SE-REG	2,275	226.70	515,742.50
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,626	397.50	2,236,335.00
NN GROUP NV	10,270	37.53	385,433.10
POSTE ITALIANE SPA	19,560	10.09	197,360.40
SAMPO OYJ-A SHS	19,639	38.89	763,858.90
TALANX AG	2,500	66.40	166,000.00
BECHTLE AG	3,070	49.77	152,793.90
CAP GEMINI SA	6,509	204.80	1,333,043.20
DASSAULT SYSTEMES SE	27,400	42.07	1,152,718.00
NEMETSCHKE SE	2,350	84.86	199,421.00
SAP SE	43,202	166.40	7,188,812.80
NOKIA OYJ	251,336	3.33	837,451.55
CELLNEX TELECOM SA	21,660	33.80	732,108.00
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	133,476	22.66	3,025,233.54
ELISA OYJ	6,005	41.72	250,528.60
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	10.93	165,883.95
KONINKLIJKE KPN NV	122,956	3.21	395,057.62
ORANGE S.A.	72,804	10.79	785,846.37
TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.27	108,819.38

TELEFONICA SA	195,629	3.64	713,067.70	
ACCIONA SA	830	114.45	94,993.50	
E.ON SE	90,999	12.17	1,107,457.83	
EDP RENOVAVEIS SA	11,156	14.42	160,869.52	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	126,131	3.93	496,451.61	
ELIA GROUP SA/NV	1,356	106.70	144,685.20	
ENAGAS SA	12,830	14.70	188,601.00	
ENDESA SA	12,050	17.81	214,670.75	
ENEL SPA	344,237	6.07	2,091,584.01	
ENGIE	82,214	14.62	1,202,297.53	
FORTUM OYJ	16,755	12.40	207,845.77	
IBERDROLA SA	254,972	10.80	2,753,697.60	
NATURGY ENERGY GROUP SA	6,502	24.14	156,958.28	
REDEIA CORP SA	20,650	14.86	306,859.00	
RWE AG	25,835	33.03	853,330.05	
SNAM SPA	91,120	4.38	399,652.32	
TERNA SPA	53,627	7.58	406,492.66	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	31,150	29.94	932,631.00	
VERBUND AG	2,780	71.40	198,492.00	
ASM INTERNATIONAL NV	1,935	535.70	1,036,579.50	
ASML HOLDING NV	16,657	833.80	13,888,606.60	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	2,870	149.00	427,630.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	51,775	33.60	1,739,640.00	
STMICROELECTRONICS NV	27,283	40.89	1,115,738.28	
LEG IMMOBILIEN SE	3,010	71.80	216,118.00	
VONOVIA SE	33,969	27.37	929,731.53	
ユーロ小計	7,486,804		204,089,298.00 (32,474,689,097)	
英ボンド				
BP PLC	703,648	4.78	3,370,122.09	
SHELL PLC-NEW	273,647	24.89	6,811,073.83	
ANGLO AMERICAN PLC	54,004	18.22	984,276.90	
ANTOFAGASTA PLC	14,330	17.64	252,852.85	
CRH PLC	30,060	57.76	1,736,265.60	
CRODA INTERNATIONAL PLC	6,131	49.59	304,036.29	
ENDEAVOUR MINING PLC	6,490	13.38	86,836.20	
GLENCORE PLC	417,803	4.10	1,715,081.31	
MONDI PLC	16,700	13.73	229,291.00	
RIO TINTO PLC	46,505	53.94	2,508,479.70	
ASHTREAD GROUP PLC	17,770	52.40	931,148.00	
BAE SYSTEMS PLC ORD	124,235	12.05	1,497,652.92	
BUNZL PLC	12,896	32.12	414,219.52	
DCC PLC	3,820	57.60	220,032.00	
MELROSE INDUSTRIES PLC	50,400	5.91	298,065.60	

ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	353,031	3.17	1,121,932.51
SMITHS GROUP PLC	13,603	16.30	221,796.91
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,890	98.92	285,878.80
EXPERIAN PLC	37,408	32.97	1,233,341.76
INTERTEK GROUP PLC	6,025	44.77	269,739.25
RELX PLC	77,845	32.87	2,558,765.15
RENTOKIL INITIAL PLC	115,300	4.05	466,965.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	5.30	215,816.00
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,515	47.80	215,817.00
BURBERRY GROUP PLC	15,504	13.08	202,869.84
PERSIMMON PLC	12,440	14.27	177,518.80
TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.47	182,474.34
COMPASS GROUP PLC	72,268	21.68	1,566,770.24
ENTAIN PLC	24,860	9.66	240,147.60
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,366	166.90	1,229,385.40
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,473	75.70	565,706.10
PEARSON PLC	26,089	9.39	245,132.24
WHITBREAD PLC	8,110	35.43	287,337.30
AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	7.30	266,595.84
INFORMA PLC	56,580	7.88	446,076.72
WPP PLC	41,144	7.81	321,663.79
JD SPORTS FASHION PLC	97,350	1.10	107,815.12
KINGFISHER PLC	78,137	2.17	169,791.70
NEXT PLC	5,667	83.66	474,101.22
OCADO GROUP PLC	22,670	5.27	119,652.26
SAINSBURY (J) PLC	70,601	2.75	194,576.35
TESCO PLC	288,058	2.89	835,080.14
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,125	22.73	298,331.25
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	84,677	23.62	2,000,070.74
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	22.90	176,101.00
DIAGEO PLC	92,122	29.71	2,737,405.23
IMPERIAL BRANDS PLC	38,792	18.92	734,138.60
HALEON PLC	218,251	3.29	719,137.04
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	28,605	57.94	1,657,373.70
UNILEVER PLC	103,602	39.59	4,101,603.18
NMC HEALTH PLC	8,090	-	-
SMITH & NEPHEW PLC	33,906	11.17	378,730.02
ASTRAZENECA PLC	64,092	105.34	6,751,451.28
GSK PLC	169,260	16.53	2,797,867.80
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,740	19.20	110,236.70
BARCLAYS PLC	639,751	1.46	935,955.71
HSBC HOLDINGS PLC	801,061	6.32	5,062,705.52
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,649,936	0.41	1,109,793.19

NATWEST GROUP PLC	275,835	2.20	606,837.00
STANDARD CHARTERED PLC	95,420	5.99	572,329.16
3I GROUP PLC	40,649	23.16	941,430.84
ABRDN PLC	88,515	1.63	144,589.25
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	7.86	102,337.20
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	16,267	88.22	1,435,074.74
M&G PLC	99,522	2.20	219,545.53
SCHRODERS PLC	30,300	4.02	121,957.50
ST JAMES'S PLACE PLC	20,540	6.47	133,058.12
WISE PLC - A	21,400	8.32	178,219.20
ADMIRAL GROUP PLC	12,845	24.88	319,583.60
AVIVA PLC	134,324	4.29	576,921.58
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	225,651	2.51	567,512.26
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,230	5.02	151,754.60
PRUDENTIAL PLC	110,702	8.49	940,081.38
SAGE GROUP PLC/THE	38,840	11.53	448,019.40
HALMA PLC	14,690	21.74	319,360.60
BT GROUP PLC	267,752	1.07	286,628.51
VODAFONE GROUP PLC	996,528	0.66	660,000.49
CENTRICA PLC	209,200	1.33	278,654.40
NATIONAL GRID PLC	158,528	10.36	1,643,142.72
SEVERN TRENT PLC	13,573	25.36	344,211.28
SSE PLC	43,667	16.69	729,020.56
UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	10.49	273,841.45
英債券小計	11,367,466		77,147,193.52 (14,375,608,040)
スイスフラン			
CLARIANT AG-REG	7,990	11.09	88,609.10
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	647.50	174,825.00
GIVAUDAN-REG	378	3,611.00	1,364,958.00
HOLCIM LTD	22,219	66.14	1,469,564.66
SIG GROUP AG	10,900	18.05	196,745.00
SIKA AG-REG	6,605	238.40	1,574,632.00
ABB LTD-REG	67,595	37.56	2,538,868.20
GEBERIT AG-REG	1,490	495.70	738,593.00
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,070	207.00	221,490.00
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	215.40	318,792.00
VAT GROUP AG	1,015	410.60	416,759.00
ADECCO GROUP AG-REG	6,817	37.57	256,114.69
SGS SA-REG	5,950	81.72	486,234.00
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,160	290.10	626,616.00
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	22,259	128.70	2,864,733.30
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,125	197.30	221,962.50
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,950	38.20	74,490.00

AVOLTA AG	3,460	35.01	121,134.60	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	130	1,286.00	167,180.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	40	11,260.00	450,400.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	113,000.00	565,000.00	
NESTLE SA-REG	110,310	99.39	10,963,710.90	
ALCON INC	19,554	66.78	1,305,816.12	
SONOVA HOLDING AG-REG	2,051	278.80	571,818.80	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,370	137.25	599,782.50	
BACHEM HOLDING AG	1,400	58.75	82,250.00	
LONZA GROUP AG-REG	3,333	447.30	1,490,850.90	
NOVARTIS AG-REG	84,323	90.09	7,596,659.07	
ROCHE HOLDING AG-BR	1,640	243.40	399,176.00	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	28,903	230.55	6,663,586.65	
SANDOZ GROUP AG	16,448	28.46	468,110.08	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,510	110.20	166,402.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	8,420	45.66	384,457.20	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	900	1,167.00	1,050,300.00	
UBS GROUP AG-REG	136,442	24.56	3,351,015.52	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,740	139.40	242,556.00	
HELVETIA HOLDING AG-REG	1,320	124.20	163,944.00	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,285	620.20	796,957.00	
SWISS RE AG	12,289	102.20	1,255,935.80	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,116	439.80	2,689,816.80	
TEMENOS AG	2,280	88.16	201,004.80	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	74.50	496,170.00	
SWISSCOM AG-REG	1,024	505.80	517,939.20	
BKW AG	840	133.40	112,056.00	
SWISS PRIME SITE-REG	3,441	86.85	298,850.85	
スイスフラン小計	621,507		56,806,867.24 (9,659,439,705)	
スウェーデンク ローナ				
BOLIDEN AB	10,290	273.35	2,812,771.50	
HOLMEN AB-B SHARES	3,520	400.80	1,410,816.00	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	22,680	141.10	3,200,148.00	
ALFA LAVAL AB	10,710	370.90	3,972,339.00	
ASSA ABLOY AB-B	42,940	287.70	12,353,838.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	111,390	169.35	18,863,896.50	
ATLAS COPCO AB-B SHS	67,170	147.45	9,904,216.50	
BEIJER REF AB	15,480	140.50	2,174,940.00	
EPIROC AB-A	31,565	187.30	5,912,124.50	
EPIROC AB-B	15,450	165.30	2,553,885.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	82.50	1,237,500.00	
INDUTRADE AB	10,180	273.50	2,784,230.00	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	264.20	1,796,560.00	

	LIFCO AB-B SHS	8,470	261.80	2,217,446.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	63,000	61.76	3,890,880.00	
	SAAB AB-B	2,780	688.20	1,913,196.00	
	SANDVIK AB	40,890	218.00	8,914,020.00	
	SKANSKA AB-B SHS	14,390	177.30	2,551,347.00	
	SKF AB-B SHARES-B	14,079	213.50	3,005,866.50	
	VOLVO AB-A SHS	9,530	264.20	2,517,826.00	
	VOLVO AB-B SHS-B	58,430	257.80	15,063,254.00	
	SECURITAS AB-B SHS	17,788	99.80	1,775,242.40	
	VOLVO CAR AB-B	20,400	33.89	691,356.00	
	EVOLUTION AB	7,140	1,285.40	9,177,756.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,848	141.64	3,944,390.72	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	23,695	239.20	5,667,844.00	
	GETINGE AB-B SHS	9,470	199.20	1,886,424.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	8,148	282.00	2,297,736.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	62,450	147.10	9,186,395.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60,120	113.35	6,814,602.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	34,550	211.30	7,300,415.00	
	EQT AB	14,450	272.00	3,930,400.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	325.10	1,620,298.40	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	324.80	1,942,304.00	
	INVESTOR AB-B SHS	69,350	247.70	17,177,995.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,590	545.20	1,957,268.00	
	ERICSSON LM-B SHS	114,915	56.48	6,490,399.20	
	HEXAGON AB-B SHS	94,990	117.90	11,199,321.00	
	TELE2 AB-B SHS	23,245	84.56	1,965,597.20	
	TELIA CO AB	118,530	25.46	3,017,773.80	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	23,220	67.70	1,571,994.00	
	SAGAX AB-B	7,910	249.80	1,975,918.00	
	スウェーデンクローナ小計	1,327,517		210,642,530.22 (2,965,846,825)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	12,100	274.00	3,315,400.00	
	EQUINOR ASA	39,014	308.55	12,037,769.70	
	NORSK HYDRO A S	50,660	60.76	3,078,101.60	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,670	352.20	2,349,174.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,900	547.00	2,133,300.00	
	ADEVINTA ASA	11,400	112.20	1,279,080.00	
	MOWI ASA	16,360	194.40	3,180,384.00	
	ORKLA ASA	32,290	81.90	2,644,551.00	
	SALMAR ASA	3,590	606.60	2,177,694.00	
	DNB BANK ASA	35,845	205.40	7,362,563.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,410	169.90	1,258,959.00	
	TELENOR ASA	23,915	114.30	2,733,484.50	

ノルウェークローネ小計		243,154		43,550,460.80 (608,399,937)
デンマーククローネ	NOVOZYMES A/S-B SHARES	14,050	354.00	4,973,700.00
	ROCKWOOL A/S-B SHS	315	1,850.50	582,907.50
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	41,480	188.22	7,807,365.60
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	115	12,670.00	1,457,050.00
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	195	12,890.00	2,513,550.00
	DSV A/S	7,890	1,211.50	9,558,735.00
	PANDORA A/S	3,310	1,029.50	3,407,645.00
	CARLSBERG AS-B	3,910	905.00	3,538,550.00
	COLOPLAST-B	6,475	802.60	5,196,835.00
	DEMANT A/S	3,640	347.40	1,264,536.00
	GENMAB A/S	2,920	1,944.50	5,677,940.00
	NOVO NORDISK A/S-B	134,780	813.50	109,643,530.00
	DANSKE BANK A/S	26,635	194.70	5,185,834.50
	TRYG A/S	13,945	145.20	2,024,814.00
ORSTED A/S	7,570	385.50	2,918,235.00	
デンマーククローネ小計		267,230		165,751,227.60 (3,535,473,684)
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	36.79	322,832.25
	SANTOS LTD	151,760	7.87	1,194,351.20
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	75,946	32.29	2,452,296.34
	BHP GROUP LTD	208,627	45.96	9,588,496.92
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	23.15	423,876.50
	FORTESCUE LTD	73,745	28.05	2,068,547.25
	IGO LTD	24,300	6.78	164,754.00
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	16,955	59.60	1,010,518.00
	MINERAL RESOURCES LTD	7,320	55.21	404,137.20
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42,190	13.29	560,705.10
	ORICA LIMITED	17,675	16.35	288,986.25
	PILBARA MINERALS LTD	114,530	3.38	387,111.40
	RIO TINTO LTD	16,698	128.41	2,144,190.18
	SOUTH32 LTD	207,787	3.14	652,451.18
	REECE LTD	10,200	22.23	226,746.00
	BRAMBLES LTD	54,798	14.37	787,447.26
	COMPUTERSHARE LTD	20,910	24.78	518,149.80
	AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	3.75	275,887.50
	QANTAS AIRWAYS LTD	35,030	5.65	197,919.50
	TRANSURBAN GROUP	129,996	13.35	1,735,446.60
ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,520	44.31	1,042,171.20	
IDP EDUCATION LTD	10,150	19.05	193,357.50	
LOTTERY CORP LTD/THE	85,554	5.07	433,758.78	
CAR GROUP LTD	14,500	33.53	486,185.00	

	REA GROUP LTD	1,820	180.72	328,910.40	
	SEEK LTD	12,860	25.82	332,045.20	
	WESFARMERS LTD	47,855	58.07	2,778,939.85	
	COLES GROUP LTD	57,925	15.95	923,903.75	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	50,462	5.54	279,559.48	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	54,692	36.00	1,968,912.00	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	27,906	10.94	305,291.64	
	COCHLEAR LTD	2,947	287.29	846,643.63	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,105	50.19	356,599.95	
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	31.43	555,053.80	
	CSL LTD	20,042	301.96	6,051,882.32	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	120,799	27.43	3,313,516.57	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	69,437	114.37	7,941,509.69	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	124,183	32.20	3,998,692.60	
	WESTPAC BANKING CORP	140,651	24.15	3,396,721.65	
	ASX LTD	7,105	64.99	461,753.95	
	MACQUARIE GROUP LTD	14,604	188.33	2,750,371.32	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,370	33.58	281,064.60	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	6.12	582,165.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	108,430	3.80	412,034.00	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	70,410	16.11	1,134,305.10	
	SUNCORP GROUP LTD	44,036	14.10	620,907.60	
	WISETECH GLOBAL LTD	5,920	72.92	431,686.40	
	XERO LTD	5,960	108.34	645,706.40	
	TELSTRA GROUP LTD	164,284	4.03	662,064.52	
	APA GROUP	45,818	8.30	380,289.40	
	ORIGIN ENERGY LTD	68,320	8.27	565,006.40	
	豪ドル小計	2,837,572		69,865,860.13 (6,744,850,136)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,165	8.53	402,317.45	
	EBOS GROUP LTD	5,630	36.59	206,001.70	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,130	24.95	577,093.50	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	5.35	409,686.95	
	MERCURY NZ LTD	34,100	6.79	231,709.50	
	MERIDIAN ENERGY LTD	57,830	5.56	321,534.80	
	ニュージーランドドル小計	244,432		2,148,343.90 (193,737,652)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	125,708	41.40	5,204,311.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	52,500	84.20	4,420,500.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	71,000	6.49	460,790.00	
	MTR CORP	62,500	26.15	1,634,375.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	12.58	654,160.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	91,000	43.05	3,917,550.00	

	SANDS CHINA LTD	96,600	22.30	2,154,180.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	13.00	882,700.00	
	WH GROUP LTD	299,894	4.64	1,391,508.16	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	148,000	18.76	2,776,480.00	
	HANG SENG BANK LTD	29,100	81.65	2,376,015.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	52,800	243.60	12,862,080.00	
	AIA GROUP LTD	475,990	62.30	29,654,177.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	9.25	1,387,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	46.80	1,170,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	63,000	67.35	4,243,050.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	456,237	5.77	2,632,487.49	
	POWER ASSETS HOLDINGS	58,000	46.70	2,708,600.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	80,538	35.70	2,875,206.60	
	ESR GROUP LTD	75,800	10.04	761,032.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	8.96	698,880.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	20.95	1,213,025.95	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	61,666	9.62	593,226.92	
	SINO LAND CO	189,050	8.04	1,519,962.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,480	71.70	4,336,416.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	17,517	61.25	1,072,916.25	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	14.80	615,680.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	43,000	25.00	1,075,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	24.10	1,537,580.00	
香港ドル小計		3,146,581		96,829,389.57 (1,831,043,756)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	68,560	7.16	490,889.60	
	SEATRIM LTD	2,268,177	0.09	217,744.99	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	63,300	3.78	239,274.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	6.83	368,137.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	1.01	213,211.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	3.28	242,588.80	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	71,195	31.65	2,253,321.75	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	150,740	12.78	1,926,457.20	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	57,300	28.17	1,614,141.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	9.35	397,375.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	354,480	2.34	829,483.20	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	30,200	5.56	167,912.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	105,000	2.84	298,200.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	5.91	102,243.00	
	UOL GROUP LTD	15,550	6.05	94,077.50	
シンガポールドル小計		3,583,262		9,455,056.04 (1,040,528,917)	
イスラエルシュ	ICL GROUP LTD	39,490	16.78	662,642.20	

ケル	ELBIT SYSTEMS LTD	1,010	760.00	767,600.00	
	BANK HAPOALIM BM	50,495	31.58	1,594,632.10	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	62,565	27.65	1,729,922.25	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	48,330	17.69	854,957.70	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,900	135.20	932,880.00	
	NICE LTD	3,040	769.50	2,339,280.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,780	240.30	427,734.00	
イスラエルシェケル小計		213,610		9,309,648.25 (377,858,141)	
合 計		47,007,945		346,413,057,477 (346,413,057,477)	

(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	812,823.30	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	12,110	422,154.60	
		AMERICAN TOWER CORP	19,179	3,676,038.93	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	18,847	356,396.77	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,790	1,000,222.50	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,717	361,943.27	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,810	458,489.20	
		CROWN CASTLE INC	18,590	2,001,399.40	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	12,525	1,806,856.50	
		EQUINIX INC	3,868	3,241,422.68	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,550	439,177.50	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	15,450	914,331.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	577,765.60	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,800	1,256,024.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,340	512,681.40	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	368,380.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	27,179	529,175.13	
		INVITATION HOMES INC	25,700	840,904.00	
		IRON MOUNTAIN INC	13,365	921,650.40	
		KIMCO REALTY CORP	23,760	481,140.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,630	707,015.40	
		PROLOGIS INC	38,075	4,968,787.50	
		PUBLIC STORAGE	6,319	1,760,789.35	
		REALTY INCOME CORP	33,101	1,779,178.75	
		REGENCY CENTERS CORP	6,005	373,571.05	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,735	1,035,071.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	13,394	1,920,565.66	
SUN COMMUNITIES INC	5,920	739,881.60			

		UDR INC	12,100	430,276.00	
		VENTAS INC	17,025	767,827.50	
		VICI PROPERTIES INC	45,610	1,360,546.30	
		WELLTOWER INC	21,240	1,837,897.20	
		WEYERHAEUSER CO	29,998	984,234.38	
		WP CAREY INC	8,610	522,454.80	
米ドル小計			511,107	40,167,072.67 (5,939,906,706)	
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	133,028.00	
加ドル小計			2,800	133,028.00 (14,583,859)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	83,314.00	
		GECINA SA	1,950	195,000.00	
		KLEPIERRE	8,402	199,547.50	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,990	327,643.40	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,730	202,062.20	
ユーロ小計			24,997	1,007,567.10 (160,324,076)	
英ポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	177,422.33	
		SEGRO PLC	45,033	387,463.93	
英ポンド小計			71,657	564,886.26 (105,260,905)	
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	42,067	314,240.49	
		GOODMAN GROUP	70,642	1,888,967.08	
		GPT GROUP	71,335	315,300.70	
		MIRVAC GROUP	159,875	340,533.75	
		SCENTRE GROUP	198,271	610,674.68	
		STOCKLAND	102,400	452,608.00	
		VICINITY CENTRES	154,902	311,353.02	
豪ドル小計			799,492	4,233,677.72 (408,719,247)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	104,160	4,103,904.00	
香港ドル小計			104,160	4,103,904.00 (77,604,824)	
シンガ ポール ドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,243	384,315.54	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	414,920.88	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	144,556	216,834.00	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	106,000	146,280.00	
シンガポールドル小計			598,355	1,162,350.42 (127,916,663)	
合計				6,834,316,280 (6,834,316,280)	

(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 588銘柄	97.8%		74.1%
	投資証券 34銘柄		2.2%	1.7%
加ドル	株式 86銘柄	99.9%		3.2%
	投資証券 1銘柄		0.1%	0.0%
ユーロ	株式 219銘柄	99.5%		9.2%
	投資証券 5銘柄		0.5%	0.0%
英ポンド	株式 82銘柄	99.3%		4.1%
	投資証券 2銘柄		0.7%	0.0%
スイスフラン	株式 45銘柄	100.0%		2.7%
スウェーデンクローナ	株式 42銘柄	100.0%		0.8%
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 15銘柄	100.0%		1.0%
豪ドル	株式 51銘柄	94.3%		1.9%
	投資証券 7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 29銘柄	95.9%		0.5%
	投資証券 1銘柄		4.1%	0.0%
シンガポールドル	株式 15銘柄	89.1%		0.3%
	投資証券 4銘柄		10.9%	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）

2024年 2月 7日現在

資産の部	
流動資産	
預金	276,472,475
コール・ローン	98,465,077
株式	108,381,651,526
投資証券	122,704,818
派生商品評価勘定	118,523,602
未収配当金	117,386,217
未収利息	23,484
差入委託証拠金	5,124,641,093
流動資産合計	114,239,868,292
資産合計	114,239,868,292
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,769,870
未払解約金	57,086,082
未払利息	6
流動負債合計	61,855,958
負債合計	61,855,958

2024年 2月 7日現在

純資産の部	
元本等	
元本	45,016,759,536
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	69,161,252,798
元本等合計	114,178,012,334
純資産合計	114,178,012,334
負債純資産合計	114,239,868,292

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)

		2024年 2月 7日現在
1.	期首	2023年 2月10日
	期首元本額	43,220,523,913円
	期首からの追加設定元本額	10,427,953,219円
	期首からの一部解約元本額	8,631,717,596円
	元本の内訳	
	日興五大陸株式ファンド	1,949,490,955円
	インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	19,574,629,837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）	3,096,504,939円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	19,986,016,378円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	2,706,692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）	297,280,903円
	Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）	109,013,611円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	753,570円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	362,651円
	計	45,016,759,536円
2.	受益権の総数	45,016,759,536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 2023年 2月10日 至 2024年 2月 7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。	
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。	
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。	

金融商品の時価等に関する事項

2024年 2月 7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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

(2024年 2月 7日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	3,600,231,685
投資証券	14,137,204
合計	3,614,368,889

(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)

(2024年 2月 7日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,550,868,044	-	5,664,621,776	113,753,732
	合計	5,550,868,044	-	5,664,621,776	113,753,732

(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。

(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)

2024年 2月 7日現在	
1口当たり純資産額	2.5363円
(1万口当たり純資産額)	(25,363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	14.96	44,880.00
	GAZPROM PAO-SPON ADR	649,360	0.00	64.93
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	129,600	1.79	232,502.40
	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	17,950	17.23	309,278.50
	PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	22,950	16.71	383,494.50
	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	8.68	85,064.00
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	22,750	15.41	350,577.50
	GERDAU SA -SPON ADR	11,552	4.39	50,713.28
	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	82.21	737,012.65
	SUZANO SA - SPON ADR	14,350	10.79	154,836.50
	VALE SA-SP ADR	16,650	13.41	223,276.50
	QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	5,451	40.52	220,874.52
	GRUPO AEROPORTUARIO PAC-ADR	900	168.37	151,533.00
	GRUPO AEROPORTUARIO SUR-ADR	150	312.88	46,932.00
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	44,050	17.82	784,971.00
	NIO INC - ADR	143,050	6.03	862,591.50
	H WORLD GROUP LTD-ADR	22,822	32.68	745,822.96
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	47,500	12.18	578,550.00
	YUM CHINA HOLDINGS INC	43,500	37.44	1,628,640.00
	AUTOHOME INC-ADR	7,790	26.89	209,473.10
	IQIYI INC-ADR	44,800	3.56	159,488.00
JOYY INC-ADR	4,790	33.40	159,986.00	
KANZHUN LTD-ADR	24,650	14.86	366,299.00	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	81,950	9.80	803,110.00	
VK IPJSC -GDR	15,200	0.00	1.52	
WEIBO CORP-SPON-ADR	7,714	9.04	69,734.56	
YANDEX NV-A	35,050	0.00	3.50	
OZON HOLDINGS PLC - ADR	6,400	0.00	0.64	
PDD HOLDINGS INC-ADR	63,570	125.78	7,995,834.60	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	36,448	17.11	623,625.28	

SENDAS DISTRIBUIDORA-ADR	14,150	13.87	196,260.50
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	15,430	0.00	1.54
AMBEV SA-ADR	34,100	2.65	90,365.00
COCA-COLA FEMSA SAB-SP ADR	1,650	98.01	161,716.50
FOMENTO ECONOMICO MEX-SP ADR	2,350	139.31	327,378.50
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	8,100	59.41	481,221.00
BANCO BRADESCO-ADR	36,400	3.35	121,940.00
BANCO DE CHILE-ADR	2,200	22.82	50,204.00
BANCO SANTANDER BRASIL-ADS	11,900	6.01	71,519.00
BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	2,500	18.54	46,350.00
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	292,200	1.18	344,796.00
CREDICORP LTD	7,345	153.45	1,127,090.25
ITAU UNIBANCO H-SPON PRF ADR-ADR	55,250	7.05	389,512.50
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	17,312	2.55	44,145.60
QIFU TECHNOLOGY INC-ADR	11,900	14.94	177,786.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	54,288	2.03	110,204.64
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	60,892	0.00	6.08
TELEFONICA BRASIL-ADR	5,687	10.81	61,476.47
TIM SA-ADR	9,650	18.33	176,884.50
CENTRAIS ELETRICAS BR-SP ADR	82,600	8.71	719,446.00
CIA SANEAMIENTO BASICO DE-ADR	4,200	16.15	67,830.00
ENEL CHILE SA-ADR	12,300	2.82	34,686.00
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	6,350	18.15	115,252.50
KE HOLDINGS INC-ADR	72,120	13.70	988,044.00
米ドル小計	339,992,354		23,917,051.34 (3,536,853,552)
メキシコペソ			
CEMEX SAB-CPO	1,475,603	14.78	21,809,412.34
GRUPO MEXICO SA-SER B	337,954	89.34	30,192,810.36
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	19,850	221.93	4,405,310.50
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	101,665	34.33	3,490,159.45
ALFA S.A.B.-A	322,500	13.70	4,418,250.00
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	56,300	160.48	9,035,024.00
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	34,562	286.78	9,911,690.36
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	18,675	532.70	9,948,172.50
GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	29,300	164.15	4,809,595.00
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	21,040	178.71	3,760,058.40
WALMART DE MEXICO -SER V	556,800	72.88	40,579,584.00
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	52,800	192.52	10,165,056.00

	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	40,100	167.43	6,713,943.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	183,154	238.15	43,618,125.10	
	GRUMA S.A.B. -B	19,615	316.15	6,201,282.25	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	140,200	81.60	11,440,320.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	164,470	38.99	6,412,685.30	
	BANCO DEL BAJIO SA	80,800	67.63	5,464,504.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	281,447	185.33	52,160,572.51	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	227,000	53.56	12,158,120.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,990,749	15.37	30,597,812.13	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	145,200	19.76	2,869,152.00	
	メキシコペソ小計	6,299,784		330,161,639.20	(2,867,486,852)
ブラジルリアル	COSAN SA	111,200	18.55	2,062,760.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	356,160	42.97	15,304,195.20	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	464,960	41.59	19,337,686.40	
	PRIO SA	88,100	43.60	3,841,160.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	77,480	28.35	2,196,558.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL	64,800	17.99	1,165,752.00	
	GERDAU SA-PREF	106,575	21.73	2,315,874.75	
	KLABIN SA - UNIT	81,100	21.57	1,749,327.00	
	SUZANO SA	71,547	53.71	3,842,789.37	
	VALE SA	348,106	66.67	23,208,227.02	
	WEG SA	174,272	33.24	5,792,801.28	
	CCR SA	110,220	13.14	1,448,290.80	
	LOCALIZA RENT A CAR SA	93,918	52.69	4,948,539.42	
	LOCALIZA RENT A CAR SA-RTS	336	9.00	3,024.00	
	RUMO SA	134,400	22.52	3,026,688.00	
	LOJAS RENNER S.A.	98,662	15.61	1,540,113.82	
	MAGAZINE LUIZA SA	292,700	2.05	600,035.00	
	MAGAZINE LUIZA SA-RTS	28,037	0.15	4,205.55	
	VIBRA ENERGIA SA	120,200	23.95	2,878,790.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	67,500	11.39	768,825.00	
	RAIA DROGASIL SA	131,916	25.15	3,317,687.40	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	77,900	13.79	1,074,241.00	
	AMBEV SA	446,100	13.23	5,901,903.00	
	JBS SA	80,500	23.75	1,911,875.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	94,532	17.15	1,621,223.80	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	536,163	3.82	2,048,142.66	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	59,600	27.80	1,656,880.00	
	HYPERMARCAS SA	44,600	31.73	1,415,158.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	162,940	14.52	2,365,888.80	
	BANCO BRADESCO SA-PRF	530,979	16.60	8,814,251.40	

	BANCO DO BRASIL S.A.	89,500	59.60	5,334,200.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	24,150	29.76	718,704.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	464,715	34.79	16,167,434.85	
	ITAUSA SA-PRF	577,655	10.55	6,094,260.25	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	628,349	13.21	8,300,490.29	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	128,000	37.55	4,806,400.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	73,900	35.50	2,623,450.00	
	TOTVS SA	62,700	32.35	2,028,345.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	36,375	53.88	1,959,885.00	
	TIM SA	56,736	18.14	1,029,191.04	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	28,700	47.83	1,372,721.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	42,700	43.13	1,841,651.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	146,491	11.48	1,681,716.68	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PRF-B	97,500	10.27	1,001,325.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	31,460	80.31	2,526,552.60	
	CPFL ENERGIA SA	23,300	36.47	849,751.00	
	ENERGISA SA-UNITS	23,800	52.50	1,249,500.00	
	ENEVA SA	95,600	12.89	1,232,284.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	21,050	40.43	851,051.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	107,249	35.80	3,839,514.20	
	ブラジルリアル小計	7,815,433		191,671,321.08	(5,713,741,248)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	39,100	6,000.00	234,600,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	109,000	1,544.00	168,296,000.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B-PRF	9,450	38,380.00	362,691,000.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	1,875,000	65.00	121,875,000.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	18,580,000	11.23	208,653,400.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	89,300	2,295.00	204,943,500.00	
	CENCOSUD SA	130,150	1,660.00	216,049,000.00	
	BANCO DE CHILE	4,238,027	108.75	460,885,436.25	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	10,446	25,450.00	265,850,700.00	
	BANCO SANTANDER CHILE SA	6,020,500	44.39	267,249,995.00	
	ENEL AMERICAS SA	2,277,620	97.00	220,929,140.00	
	ENEL CHILE SA	2,487,370	55.30	137,551,561.00	
	チリペソ小計	35,865,963		2,869,574,732.25	(446,893,220)
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	25,330	33,980.00	860,713,400.00	
	BANCOLOMBIA SA-PRF	47,200	31,460.00	1,484,912,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	44,210	16,820.00	743,612,200.00	
	コロンビアペソ小計	116,740		3,089,237,600.00	(115,392,292)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	7,430	26.06	193,625.80	

	MYTILINEOS S.A.	10,680	38.66	412,888.80	
	OPAP SA	20,150	16.48	332,072.00	
	JUMBO SA	12,640	26.48	334,707.20	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	227,400	1.75	399,541.80	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	281,500	1.94	546,110.00	
	NATIONAL BANK OF GREECE	87,240	7.24	631,617.60	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	68,500	3.86	264,410.00	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,200	12.89	260,378.00	
	PUBLIC POWER CORP	21,300	12.50	266,250.00	
ユーロ小計		757,040		3,641,601.20 (579,451,582)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	111,750	154.50	17,265,375.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	151,667	44.20	6,703,681.40	
	HEKTAS TICARET T.A.S	144,300	18.34	2,646,462.00	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	91,200	21.24	1,937,088.00	
	SASA POLYESTER SANAYI	159,739	39.80	6,357,612.20	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	153,200	52.30	8,012,360.00	
	KOC HOLDING AS	73,684	170.60	12,570,490.40	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	152,600	50.10	7,645,260.00	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	4,350	788.00	3,427,800.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	57,000	291.00	16,587,000.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	7,470	938.00	7,006,860.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	12,000	257.00	3,084,000.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	46,160	378.50	17,471,560.00	
	AKBANK T.A.S.	336,489	41.04	13,809,508.56	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	95,700	77.35	7,402,395.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	383,412	26.12	10,014,721.44	
	YAPI VE KREDI BANKASI	361,000	22.82	8,238,020.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	116,756	69.35	8,097,028.60	
トルコリラ小計		2,458,477		158,277,222.60 (765,919,307)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	8,160	760.00	6,201,600.00	
	MONETA MONEY BANK AS	39,000	102.20	3,985,800.00	
	CEZ AS	16,660	868.50	14,469,210.00	
チェココルナ小計		63,820		24,656,610.00 (157,370,813)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	49,270	2,916.00	143,671,320.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,070	9,720.00	146,480,400.00	
	OTP BANK PLC	24,735	16,900.00	418,021,500.00	
ハンガリーフォリント小計		89,075		708,173,220.00 (291,579,700)	
	ORLEN SA	60,399	65.84	3,976,670.16	

ポーランドズロチ	KGHM POLSKA MIEDZ SA	15,980	111.20	1,776,976.00	
	BUDIMEX	1,250	684.00	855,000.00	
	LPP SA	114	15,760.00	1,796,640.00	
	CD PROJEKT SA	6,650	108.35	720,527.50	
	CYFROWY POLSAT SA	25,030	11.04	276,331.20	
	ALLEGRO.EU SA	57,990	30.65	1,777,393.50	
	PEPCO GROUP NV	17,980	22.08	396,998.40	
	DINO POLSKA SA	5,040	450.00	2,268,000.00	
	BANK PEKAO SA	19,012	158.50	3,013,402.00	
	MBANK SA	1,620	554.80	898,776.00	
	PKO BANK POLSKI SA	92,815	52.94	4,913,626.10	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,640	480.40	1,748,656.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	64,480	49.45	3,188,536.00	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	86,630	8.69	753,334.48	
ポーランドズロチ小計	458,630		28,360,867.34	(1,037,630,545)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	216,000	8.50	1,836,000.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	6.91	1,326,720.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,699,300	4.19	11,310,067.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	346,000	30.00	10,380,000.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	124,000	6.53	809,720.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,245,000	5.72	12,841,400.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	230,000	15.88	3,652,400.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	415,000	3.80	1,577,000.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	122,000	16.20	1,976,400.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	245,000	5.73	1,403,850.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	392,000	2.89	1,132,880.00	
	CMOC GROUP LTD-H	351,000	4.31	1,512,810.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H	42,960	20.70	889,272.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	119,000	10.96	1,304,240.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	183,000	3.17	580,110.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	77,250	11.94	922,365.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	137,000	7.82	1,071,340.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD	593,750	11.68	6,935,000.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	248,000	2.93	726,640.00	
	BOC AVIATION LTD	21,500	59.50	1,279,250.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	290,000	3.28	951,200.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	376,000	3.60	1,353,600.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	214,000	8.38	1,793,320.00	
	CITIC LTD	577,000	7.87	4,540,990.00	
CRRC CORP LTD - H	401,000	3.74	1,499,740.00		
FOSUN INTERNATIONAL LTD	241,000	4.36	1,050,760.00		

HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	69,000	18.18	1,254,420.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	126,000	5.42	682,920.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	67,000	17.46	1,169,820.00
WEICHAJ POWER CO LTD-H	196,400	14.24	2,796,736.00
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC	63,600	19.74	1,255,464.00
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	396,518	2.84	1,126,111.12
AIR CHINA LTD-H	174,000	4.28	744,720.00
CHINA COSCO HOLDINGS-H	333,350	8.32	2,773,472.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	183,000	9.73	1,780,590.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	198,000	2.92	578,160.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	210,000	4.84	1,016,400.00
JD LOGISTICS INC	196,400	7.29	1,431,756.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	158,000	7.77	1,227,660.00
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	13,500	118.20	1,595,700.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	183,540	5.83	1,070,038.20
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	310,000	3.89	1,205,900.00
BYD CO LTD-H	110,000	180.90	19,899,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	312,000	3.19	995,280.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	78,400	37.00	2,900,800.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	627,000	8.19	5,135,130.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	273,500	8.24	2,253,640.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	390,845	3.21	1,254,612.45
LI AUTO INC-CLASS A	122,000	119.00	14,518,000.00
MINTH GROUP LTD	74,000	12.46	922,040.00
XPENG INC - CLASS A SHARES	118,300	33.45	3,957,135.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	132,000	12.18	1,607,760.00
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	52,000	22.40	1,164,800.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	139,400	70.85	9,876,490.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	446,000	3.63	1,618,980.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	264,200	24.10	6,367,220.00
LI NING CO LTD	252,500	19.00	4,797,500.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	86,300	68.90	5,946,070.00
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	148,500	4.01	595,485.00
EAST BUY HOLDING LTD	45,500	24.50	1,114,750.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	168,000	13.16	2,210,880.00
MEITUAN-CLASS B	537,585	69.25	37,227,761.25
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	158,900	65.60	10,423,840.00
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	125,600	16.56	2,079,936.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	131,000	8.17	1,070,270.00
TRIP.COM GROUP LTD	59,140	306.40	18,120,496.00
BAIDU INC-CLASS A	239,160	105.80	25,303,128.00
BILIBILI INC-CLASS Z	19,517	76.15	1,486,219.55

CHINA LITERATURE LTD	39,400	21.85	860,890.00
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	644,000	1.60	1,030,400.00
KINGSOFT CORP LTD	97,200	20.00	1,944,000.00
KUAISHOU TECHNOLOGY	252,300	43.70	11,025,510.00
NETEASE INC	204,375	165.50	33,824,062.50
TENCENT HOLDINGS LTD	708,850	290.80	206,133,580.00
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,729,200	76.00	131,419,200.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	72.95	656,550.00
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	216,800	11.26	2,441,168.00
JD.COM INC - CL A	251,473	92.75	23,324,120.75
MINISO GROUP HOLDING LTD	42,000	33.30	1,398,600.00
POP MART INTERNATIONAL GROUP	55,200	18.34	1,012,368.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	212,000	5.61	1,189,320.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	122,500	14.24	1,744,400.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	642,000	3.03	1,945,260.00
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	116,700	28.30	3,302,610.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	67,200	11.50	772,800.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	10,200	101.11	1,031,322.00
CHINA FEIHE LTD	379,000	3.72	1,409,880.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	90,000	-	-
CHINA MENGNIU DAIRY CO	335,000	18.62	6,237,700.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	183,000	30.00	5,490,000.00
NONGFU SPRING CO LTD-H	217,600	43.70	9,509,120.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	184,000	5.15	947,600.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	202,000	8.09	1,634,180.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	72,000	47.55	3,423,600.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	126,000	4.68	589,680.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	517,000	4.30	2,223,100.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	84,500	25.20	2,129,400.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	37,000	23.05	852,850.00
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	37,400	27.05	1,011,670.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	100,700	6.14	618,298.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	263,600	5.04	1,328,544.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	82,600	12.02	992,852.00
SINOPHARM GROUP CO-H	138,000	21.30	2,939,400.00
3SBIO INC	216,500	5.86	1,268,690.00
AKESO INC - B	53,000	43.15	2,286,950.00
BEIGENE LTD	74,881	88.85	6,653,176.85
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	154,000	11.66	1,795,640.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	193,500	5.10	986,850.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	316,000	3.12	985,920.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	946,160	6.14	5,809,422.40

GENSCRIPT BIOTECH CORP	122,000	14.00	1,708,000.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	142,000	12.80	1,817,600.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	131,000	33.00	4,323,000.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	42,500	13.80	586,500.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,102,750	2.97	3,275,167.50
WUXI APPTec CO LTD-H	34,629	49.00	1,696,821.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	415,000	18.16	7,536,400.00
ZAI LAB LTD	100,550	17.68	1,777,724.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,891,000	3.13	9,048,830.00
BANK OF CHINA LTD - H	8,482,000	3.02	25,615,640.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	837,245	4.84	4,052,265.80
CHINA CITIC BANK - H	929,000	4.00	3,716,000.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	10,158,920	4.76	48,356,459.20
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	182,000	2.38	433,160.00
CHINA MERCHANTS BANK - H	405,650	29.55	11,986,957.50
CHINA MINSHENG BANKING-H	662,640	2.64	1,749,369.60
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,986,575	3.92	27,387,374.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	798,000	3.97	3,168,060.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	901,000	0.75	675,750.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	440,000	3.93	1,729,200.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	177,200	9.45	1,674,540.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	178,675	15.34	2,740,874.50
FAR EAST HORIZON LTD	246,000	5.80	1,426,800.00
GF SECURITIES CO LTD-H	101,000	7.71	778,710.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	237,200	3.69	875,268.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	127,000	9.37	1,189,990.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	801,000	9.47	7,585,470.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	266,400	14.96	3,985,344.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	154,740	6.53	1,010,452.20
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO-H	81,000	14.38	1,164,780.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	867,000	2.52	2,184,840.00
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	724,001	9.84	7,124,169.84
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	708,500	34.05	24,124,425.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	70,700	12.56	887,992.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	304,000	4.70	1,428,800.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	86,856	5.45	473,365.20
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	300,000	8.08	2,424,000.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	74,500	17.62	1,312,690.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	82,000	28.50	2,337,000.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	70,500	14.42	1,016,610.00
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	105,000	4.86	510,300.00
LENOVO GROUP LTD	766,000	8.48	6,495,680.00

SUNNY OPTICAL TECH	78,000	48.45	3,779,100.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	1,625,800	12.90	20,972,820.00	
ZTE CORP-H	71,200	14.34	1,021,008.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	4,606,000	0.88	4,053,280.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	56,500	28.45	1,607,425.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	504,000	1.88	947,520.00	
CGN POWER CO LTD-H	1,477,000	2.21	3,264,170.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	287,800	7.05	2,028,990.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	375,000	4.79	1,796,250.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	538,000	3.03	1,630,140.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	96,000	22.95	2,203,200.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	209,000	15.88	3,318,920.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	81,600	59.40	4,847,040.00	
GUANGDONG INVEST	316,000	4.37	1,380,920.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	404,000	4.04	1,632,160.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	398,000	6.96	2,770,080.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	57,000	13.30	758,100.00	
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	2,487,000	0.97	2,412,390.00	
HANERGY THIN FILM POWER GROU	240,000	-	-	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	60,000	15.66	939,600.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	522,000	3.69	1,926,180.00	
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	73,000	13.32	972,360.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	409,820	12.22	5,008,000.40	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	135,000	5.46	737,100.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	337,777	24.60	8,309,314.20	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	72,000	22.45	1,616,400.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	209,526	6.32	1,324,204.32	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	226,000	5.59	1,263,340.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	125,500	6.19	776,845.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	203,000	9.18	1,863,540.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	189,200	5.25	993,300.00	
香港ドル小計	88,276,708		1,084,940,925.33 (20,516,232,897)	
マレーシアリン ギット				
DIALOG GROUP BHD	357,700	1.73	618,821.00	
PETRONAS DAGANGAN BHD	30,600	21.80	667,080.00	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	306,400	6.74	2,065,136.00	
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	401,400	4.65	1,866,510.00	
GAMUDA BHD	228,700	5.02	1,148,074.00	
SIME DARBY BERHAD	279,020	2.47	689,179.40	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	144,500	7.95	1,148,775.00	
MISC BHD	135,900	7.36	1,000,224.00	
GENTING BHD	218,900	4.89	1,070,421.00	

	GENTING MALAYSIA BHD	315,400	2.79	879,966.00	
	MR DIY GROUP M BHD	419,750	1.40	587,650.00	
	IOI CORPORATION BERHAD	256,875	3.98	1,022,362.50	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	52,500	22.10	1,160,250.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,500	121.30	788,450.00	
	PPB GROUP BERHAD	63,980	14.70	940,506.00	
	QL RESOURCES BHD	114,500	5.77	660,665.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	213,120	4.46	950,515.20	
	IHH HEALTHCARE BHD	202,900	6.17	1,251,893.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	195,800	4.27	836,066.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	667,300	6.21	4,143,933.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	64,800	19.24	1,246,752.00	
	MALAYAN BANKING BHD	550,650	9.31	5,126,551.50	
	PUBLIC BANK BERHAD	1,522,350	4.39	6,683,116.50	
	RHB BANK BHD	154,859	5.61	868,758.99	
	AXIATA GROUP BERHAD	296,400	2.71	803,244.00	
	CELCOMDIGI BHD	447,100	4.19	1,873,349.00	
	MAXIS BHD	235,400	3.78	889,812.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	177,600	5.94	1,054,944.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	79,600	17.86	1,421,656.00	
	TENAGA NASIONAL BERHAD	256,925	10.78	2,769,651.50	
	INARI AMERTRON BHD	324,900	3.20	1,039,680.00	
	マレーシアリングット小計	8,722,329		47,273,992.59	(1,467,961,472)
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	883,700	6.30	5,567,310.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	146,610	153.00	22,431,330.00	
	PTT PCL-NVDR	1,013,300	34.25	34,705,525.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	138,100	55.25	7,630,025.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	196,800	24.90	4,900,320.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	286,345	34.25	9,807,316.25	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	130,900	31.75	4,156,075.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	81,200	274.00	22,248,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	481,300	64.50	31,043,850.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-NVDR	783,800	7.60	5,956,880.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	802,600	6.00	4,815,600.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	911,900	4.08	3,720,552.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	324,068	30.75	9,965,091.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	206,416	32.75	6,760,124.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	665,400	10.90	7,252,860.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	350,000	18.20	6,370,000.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	123,700	24.70	3,055,390.00	
	CP ALL PCL-NVDR	598,400	55.50	33,211,200.00	

	CP AXTRA PCL-NVDR	208,700	30.50	6,365,350.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	406,600	19.00	7,725,400.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	163,800	21.20	3,472,560.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,144,700	28.75	32,910,125.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	61,500	242.00	14,883,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	60,000	122.00	7,320,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	394,225	16.10	6,347,022.50	
	SCB X PCL-NVDR	85,100	106.00	9,020,600.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	2,342,000	1.85	4,332,700.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	130,400	43.75	5,705,000.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	76,900	44.25	3,402,825.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	319,500	82.75	26,438,625.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	132,800	218.00	28,950,400.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	99,900	73.50	7,342,650.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	1,002,720	6.40	6,417,408.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	177,200	40.75	7,220,900.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	64,900	51.25	3,326,125.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	314,990	43.75	13,780,812.50	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	214,800	63.50	13,639,800.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	917,700	7.65	7,020,405.00	
	タイパーツ小計	16,442,974		439,219,956.25 (1,827,155,018)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	190,400	47.50	9,044,000.00	
	AYALA CORPORATION	30,452	672.00	20,463,744.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	300,345	40.50	12,163,972.50	
	SM INVESTMENTS CORP	23,993	906.00	21,737,658.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	101,830	259.80	26,455,434.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	47,540	260.60	12,388,924.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	90,460	111.50	10,086,290.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	227,190	114.20	25,945,098.00	
	BDO UNIBANK INC	242,125	148.00	35,834,500.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	188,237	56.80	10,691,861.60	
	PLDT INC	8,365	1,290.00	10,790,850.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	31,630	365.00	11,544,950.00	
	AYALA LAND INC	682,560	34.15	23,309,424.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,074,210	34.00	36,523,140.00	
	フィリピンペソ小計	3,239,337		266,979,846.10 (702,610,860)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	1,485,200	2,460.00	3,653,592,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	160,000	22,800.00	3,648,000,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	668,000	7,575.00	5,060,100,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	899,300	1,425.00	1,281,502,500.00	

	BARITO PACIFIC TBK PT	3,096,796	1,045.00	3,236,151,820.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	283,000	8,000.00	2,264,000,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,356,873	2,460.00	3,337,907,580.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	347,712	6,250.00	2,173,200,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,091,900	5,250.00	10,982,475,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	88,529,000	84.00	7,436,436,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	2,177,200	2,600.00	5,660,720,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	728,100	4,840.00	3,524,004,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	307,400	11,525.00	3,542,785,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAK TBK	452,600	6,350.00	2,874,010,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	753,000	3,250.00	2,447,250,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,187,700	1,545.00	3,379,996,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	5,899,900	9,625.00	56,786,537,500.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	3,998,700	6,850.00	27,391,095,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	1,570,400	5,775.00	9,069,060,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	7,270,300	5,825.00	42,349,497,500.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	2,314,200	910.00	2,105,922,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,172,900	3,980.00	20,588,142,000.00	
	インドネシアルピア小計	131,750,181		222,792,384,400.00 (2,094,248,413)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	4,950	71,000.00	351,450,000.00	
	S-OIL CORPORATION	4,835	69,200.00	334,582,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	6,195	120,800.00	748,356,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	14,022	32,250.00	452,209,500.00	
	HYUNDAI STEEL CO	9,690	34,750.00	336,727,500.00	
	KOREA ZINC CO LTD	1,195	462,000.00	552,090,000.00	
	KUM YANG CO LTD	3,270	79,500.00	259,965,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,970	137,700.00	271,269,000.00	
	LG CHEM LTD	5,357	462,500.00	2,477,612,500.00	
	LG CHEM LTD-PRF	770	282,500.00	217,525,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	2,075	132,400.00	274,730,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	7,700	437,000.00	3,364,900,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,860	65,500.00	187,330,000.00	
	SKC CO LTD	2,170	81,100.00	175,987,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	5,610	48,900.00	274,329,000.00	
	DOOSAN ENERBILITY	49,990	15,320.00	765,846,800.00	
	ECOPRO BM CO LTD	5,084	216,000.00	1,098,144,000.00	
	ECOPRO CO LTD	2,140	509,000.00	1,089,260,000.00	
	GS HOLDINGS	4,395	48,950.00	215,135,250.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	4,000	132,000.00	528,000,000.00	
	HANWHA OCEAN CO LTD	5,559	22,300.00	123,965,700.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	2,190	115,300.00	252,507,000.00	

HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	4,417	120,400.00	531,806,800.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	7,560	33,700.00	254,772,000.00
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,850	67,900.00	193,515,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,940	49,150.00	390,251,000.00
L&F CO LTD	2,560	132,300.00	338,688,000.00
LG CORP	9,611	90,200.00	866,912,200.00
LG ENERGY SOLUTION	5,085	377,000.00	1,917,045,000.00
POSCO FUTURE M CO LTD	3,213	260,000.00	835,380,000.00
POSCO INTERNATIONAL CORP	5,510	52,800.00	290,928,000.00
SAMSUNG C&T CORP	8,487	147,500.00	1,251,832,500.00
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	16,500	22,950.00	378,675,000.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	78,369	7,210.00	565,040,490.00
SK INC	3,741	192,500.00	720,142,500.00
SK SQUARE CO LTD	10,503	62,400.00	655,387,200.00
HMM CO LTD	25,940	19,160.00	497,010,400.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,870	187,100.00	349,877,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	19,324	22,900.00	442,519,600.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	7,952	49,400.00	392,828,800.00
HANON SYSTEMS	18,900	6,180.00	116,802,000.00
HYUNDAI MOBIS	6,300	219,500.00	1,382,850,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	14,770	235,500.00	3,478,335,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,530	137,000.00	483,610,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	2,400	135,500.00	325,200,000.00
KIA CORP	27,290	111,600.00	3,045,564,000.00
COWAY CO LTD	5,640	59,000.00	332,760,000.00
F&F CO LTD / NEW	2,060	72,100.00	148,526,000.00
LG ELECTRONICS INC	10,905	96,600.00	1,053,423,000.00
KANGWON LAND INC	10,810	16,560.00	179,013,600.00
HYBE CO LTD	2,420	196,500.00	475,530,000.00
JYP ENTERTAINMENT CORP	2,820	74,800.00	210,936,000.00
KAKAO CORP	32,415	54,000.00	1,750,410,000.00
KRAFTON INC	2,940	211,500.00	621,810,000.00
NAVER CORP	13,985	205,500.00	2,873,917,500.00
NCSOFT CORP	1,430	208,500.00	298,155,000.00
NETMARBLE CORP	2,210	60,400.00	133,484,000.00
PEARL ABYSS CORP	3,205	32,950.00	105,604,750.00
HOTEL SHILLA CO LTD	3,390	60,800.00	206,112,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	874	296,500.00	259,141,000.00
KT&G CORP	10,815	90,000.00	973,350,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	2,326	92,200.00	214,457,200.00
AMOREPACIFIC CORP	2,990	124,900.00	373,451,000.00
LG H&H	955	311,000.00	297,005,000.00

HLB INC	12,382	74,000.00	916,268,000.00	
CELLTRION INC	16,240	183,000.00	2,971,920,000.00	
CELLTRION PHARM INC	1,786	102,500.00	183,065,000.00	
CELLTRION PHARM INC(N)	89	102,500.00	9,122,500.00	
HANMI PHARM CO LTD	731	321,500.00	235,016,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,940	846,000.00	1,641,240,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,350	88,900.00	297,815,000.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,940	63,600.00	186,984,000.00	
YUHAN CORP	6,919	59,800.00	413,756,200.00	
HANA FINANCIAL GROUP	30,958	54,300.00	1,681,019,400.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	27,600	13,270.00	366,252,000.00	
KAKAObANK CORP	16,870	27,300.00	460,551,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	40,290	63,100.00	2,542,299,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	46,818	42,150.00	1,973,378,700.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	62,591	14,580.00	912,576,780.00	
KAKAOPAY CORP	2,540	46,300.00	117,602,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,985	63,500.00	253,047,500.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	10,786	67,500.00	728,055,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	24,868	8,460.00	210,383,280.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,770	11,050.00	130,058,500.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6,807	38,900.00	264,792,300.00	
DONGBU INSURANCE CO LTD	4,850	99,000.00	480,150,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,200	293,000.00	937,600,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	8,005	77,400.00	619,587,000.00	
POSCO DX CO LTD	5,450	60,700.00	330,815,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	3,980	156,600.00	623,268,000.00	
COSMOAM&T CO LTD	2,719	151,900.00	413,016,100.00	
LG DISPLAY CO LTD	23,410	11,460.00	268,278,600.00	
LG DISPLAY CO LTD-RTS(N)	7,441	1,390.00	10,342,990.00	
LG INNOTEK CO LTD	1,485	197,900.00	293,881,500.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,865	138,600.00	812,889,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	508,450	74,400.00	37,828,680,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	85,570	60,800.00	5,202,656,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	5,943	374,000.00	2,222,682,000.00	
KT CORP	6,330	37,850.00	239,590,500.00	
LG UPLUS CORP.	21,900	10,310.00	225,789,000.00	
SK TELECOM	5,610	50,500.00	283,305,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,740	20,400.00	545,496,000.00	
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	5,000	61,000.00	305,000,000.00	
SK HYNIX INC	58,250	138,000.00	8,038,500,000.00	
韓国ウォン小計	1,675,297		120,740,709,140.00	(13,510,885,352)

台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	117,080	74.30	8,699,044.00
	ASIA CEMENT CORP	279,978	39.45	11,045,132.10
	CHINA STEEL CORP	1,231,181	24.85	30,594,847.85
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	360,047	57.10	20,558,683.70
	FORMOSA PLASTICS CORP	396,424	72.40	28,701,097.60
	NAN YA PLASTICS CORP	490,145	61.00	29,898,845.00
	TAIWAN CEMENT	821,420	32.15	26,408,653.00
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	14,696	1,015.00	14,916,440.00
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	322,957	30.65	9,898,632.05
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	7,000	1,335.00	9,345,000.00
	WALSIN LIHWA CORP	301,786	34.80	10,502,152.80
	CHINA AIRLINES LTD	319,000	20.50	6,539,500.00
	EVA AIRWAYS CORP	281,000	32.25	9,062,250.00
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	109,200	152.00	16,598,400.00
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	203,000	29.75	6,039,250.00
	WAN HAI LINES LTD	69,575	47.75	3,322,206.25
	YANG MING MARINE TRANSPORT	194,000	47.30	9,176,200.00
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	211,947	45.45	9,632,991.15
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	20,254	556.00	11,261,224.00
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	63,927	164.00	10,484,028.00
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	18,000	338.50	6,093,000.00
	POU CHEN	226,145	31.15	7,044,416.75
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	31,620	637.00	20,141,940.00
	MOMO.COM INC	9,200	421.50	3,877,800.00
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	56,448	267.00	15,071,616.00
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	521,703	73.10	38,136,489.30
	PHARMAESSENTIA CORP	27,000	309.50	8,356,500.00
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	534,348	17.45	9,324,372.60
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,888,746	28.15	53,168,199.90
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,447,229	24.50	35,457,110.50
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,125,910	26.80	30,174,388.00
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	928,004	21.75	20,184,087.00
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,238,496	37.60	46,567,449.60
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,119,297	19.10	21,378,572.70
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,177,195	17.10	20,130,034.50	
TAIWAN BUSINESS BANK	636,928	13.35	8,502,988.80	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,058,215	25.60	27,090,304.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	394,610	44.20	17,441,762.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	166,479	174.00	28,967,346.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,049,938	27.00	28,348,326.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	970,044	43.90	42,584,931.60	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,640,715	12.10	19,852,651.50	

FUBON FINANCIAL HOLDING CO	820,668	64.70	53,097,219.60
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	1,362,954	8.41	11,462,443.14
ACCTON TECHNOLOGY CORP	53,000	548.00	29,044,000.00
ACER INC	324,812	46.30	15,038,795.60
ADVANTECH CO LTD	53,984	370.50	20,001,072.00
ASUSTEK COMPUTER INC	73,797	452.00	33,356,244.00
AUO CORP	664,795	18.05	11,999,549.75
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	66,405	193.50	12,849,367.50
COMPAL ELECTRONICS	437,955	35.90	15,722,584.50
DELTA ELECTRONICS INC	210,541	287.50	60,530,537.50
E INK HOLDINGS INC	89,000	217.00	19,313,000.00
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	57,000	337.00	19,209,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,327,212	101.50	134,712,018.00
INNOLUX CORP	891,803	16.25	14,491,798.75
INVENTEC CORP	289,162	56.50	16,337,653.00
LARGAN PRECISION CO LTD	10,786	2,355.00	25,401,030.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	209,787	113.00	23,705,931.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	84,000	191.00	16,044,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	23,000	225.50	5,186,500.00
PEGATRON CORP	236,854	84.50	20,014,163.00
QUANTA COMPUTER INC	285,416	255.00	72,781,080.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	142,120	71.50	10,161,580.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	145,000	176.50	25,592,500.00
WISTRON CORP	271,000	124.50	33,739,500.00
WIWYNN CORP	10,500	2,265.00	23,782,500.00
WPG HOLDINGS LTD	175,520	87.60	15,375,552.00
YAGEO CORPORATION	36,884	550.00	20,286,200.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	69,000	98.50	6,796,500.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	393,371	121.50	47,794,576.50
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	210,000	79.40	16,674,000.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	180,188	98.50	17,748,518.00
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	8,000	4,105.00	32,840,000.00
ASE INDUSTRIAL HOLDING CO LT	333,387	130.00	43,340,310.00
EMEMORY TECHNOLOGY INC	7,100	2,955.00	20,980,500.00
GLOBAL UNICHIP CORP	9,000	1,435.00	12,915,000.00
GLOBALWAFERS CO LTD	23,200	579.00	13,432,800.00
MEDIATEK INC	162,432	937.00	152,198,784.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	140,000	68.20	9,548,000.00
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	60,522	506.00	30,624,132.00
PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	1,155.00	9,240,000.00
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	313,000	26.80	8,388,400.00
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	54,815	463.50	25,406,752.50

	SILERGY CORP	33,800	387.00	13,080,600.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,614,355	646.00	1,688,873,330.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,191,592	48.10	57,315,575.20	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	100,000	73.50	7,350,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	339,105	27.10	9,189,745.50	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	165,581	35.75	5,919,520.75	
台湾ドル小計		36,851,290		3,779,471,728.04	(17,814,162,042)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	78,450	609.30	47,799,585.00	
	COAL INDIA LTD	166,680	448.65	74,780,982.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	61,380	535.80	32,887,404.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	311,930	184.50	57,551,085.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	317,980	272.30	86,585,954.00	
	PETRONET LNG LTD	78,980	290.40	22,935,792.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	322,912	2,855.60	922,107,507.20	
	AMBUJA CEMENTS LIMITED	63,790	566.60	36,143,414.00	
	APL APOLLO TUBES LTD	17,000	1,402.85	23,848,450.00	
	ASIAN PAINTS LTD	40,100	2,930.95	117,531,095.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	34,140	555.80	18,975,012.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	27,260	2,066.00	56,319,160.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	128,490	584.90	75,153,801.00	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	38,230	781.20	29,865,276.00	
	JSW STEEL LTD	63,540	818.75	52,023,375.00	
	PI INDUSTRIES LTD	10,170	3,314.45	33,707,956.50	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	16,120	2,614.45	42,144,934.00	
	SHREE CEMENT LTD	955	27,569.40	26,328,777.00	
	SRF LTD	15,610	2,283.75	35,649,337.50	
	SUPREME INDUSTRIES LTD	7,150	4,148.75	29,663,562.50	
	TATA STEEL LTD	768,370	144.65	111,144,720.50	
	ULTRATECH CEMENT LTD	12,360	10,048.75	124,202,550.00	
	UPL LTD	53,425	481.85	25,742,836.25	
	VEDANTA LTD	126,360	283.00	35,759,880.00	
	ABB INDIA LTD	6,310	4,403.00	27,782,930.00	
	ADANI ENTERPRISES LTD	18,040	3,203.75	57,795,650.00	
	ASHOK LEYLAND LTD	176,000	179.95	31,671,200.00	
	ASTRAL LTD	12,100	1,888.75	22,853,875.00	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	390,900	183.10	71,573,790.00	
	CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	63,350	444.95	28,187,582.50	
	CUMMINS INDIA LTD	17,020	2,401.85	40,879,487.00	
	HAVELLS INDIA LTD	25,550	1,345.00	34,364,750.00	
	HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	22,030	2,958.45	65,174,653.50	
	LARSEN & TOUBRO LTD	71,030	3,424.25	243,224,477.50	

POLYCAB INDIA LTD	4,610	4,396.15	20,266,251.50
SIEMENS LTD	8,940	4,216.75	37,697,745.00
SUZLON ENERGY LTD	904,000	48.00	43,392,000.00
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	26,000	965.25	25,096,500.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	54,163	1,273.10	68,954,915.30
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	29,942	935.75	28,018,226.50
INTERGLOBE AVIATION LTD	13,550	3,137.85	42,517,867.50
BAJAJ AUTO LTD	7,540	7,720.40	58,211,816.00
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	7,940	2,382.15	18,914,271.00
BHARAT FORGE LTD	27,720	1,285.50	35,634,060.00
EICHER MOTORS LTD	14,590	3,944.60	57,551,714.00
HERO MOTOCORP LTD	11,820	4,783.45	56,540,379.00
MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	100,770	1,727.65	174,095,290.50
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	14,100	10,844.85	152,912,385.00
MRF LTD	200	143,387.70	28,677,540.00
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	240,860	118.75	28,602,125.00
SONA BLW PRECISION FORGINGS	40,500	631.30	25,567,650.00
TATA MOTORS LTD	171,708	939.55	161,328,251.40
TATA MOTORS LTD-A-DVR	46,900	619.35	29,047,515.00
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	11,340	3,598.25	40,804,155.00
TVS MOTOR CO LTD	25,520	2,047.50	52,252,200.00
PAGE INDUSTRIES LTD	660	36,355.20	23,994,432.00
TITAN CO LTD	38,440	3,559.15	136,813,726.00
INDIAN HOTELS CO LTD	90,930	506.15	46,024,219.50
JUBILANT FOODWORKS LTD	44,490	479.85	21,348,526.50
ZOMATO LTD	546,700	139.95	76,510,665.00
INFO EDGE INDIA LTD	7,230	5,355.75	38,722,072.50
TRENT LTD	19,010	3,035.00	57,695,350.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	16,640	3,727.40	62,023,936.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	11,240	5,007.05	56,279,242.00
ITC LTD	317,405	431.40	136,928,517.00
MARICO LTD	55,700	520.80	29,008,560.00
NESTLE INDIA LTD	36,050	2,456.65	88,562,232.50
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	59,060	1,163.55	68,719,263.00
UNITED SPIRITS LTD	29,680	1,072.00	31,816,960.00
VARUN BEVERAGES LTD	48,450	1,347.15	65,269,417.50
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	15,900	2,565.15	40,785,885.00
DABUR INDIA LTD	65,930	532.70	35,120,911.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	41,565	1,237.05	51,417,983.25
HINDUSTAN UNILEVER LTD	87,280	2,426.35	211,771,828.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	11,240	6,197.30	69,657,652.00
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	86,220	821.40	70,821,108.00

AUROBINDO PHARMA LTD	27,210	1,014.40	27,601,824.00
CIPLA LTD	55,000	1,425.45	78,399,750.00
DIVI'S LABORATORIES LTD	12,840	3,726.50	47,848,260.00
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,130	6,166.60	74,800,858.00
LUPIN LTD	20,890	1,580.15	33,009,333.50
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	99,554	1,475.10	146,852,105.40
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	10,420	2,610.75	27,204,015.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	17,810	616.50	10,979,865.00
AXIS BANK LTD	241,330	1,050.05	253,408,566.50
BANDHAN BANK LTD	74,240	218.40	16,214,016.00
BANK OF BARODA	100,500	250.30	25,155,150.00
HDFC BANK LIMITED	297,743	1,444.10	429,970,666.30
ICICI BANK LTD	548,887	1,026.40	563,377,616.80
IDFC FIRST BANK LTD	390,500	83.00	32,411,500.00
INDUSIND BANK LTD	29,500	1,511.40	44,586,300.00
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	116,680	1,787.00	208,507,160.00
STATE BANK OF INDIA	183,320	650.25	119,203,830.00
YES BANK LTD	1,377,600	25.40	34,991,040.00
BAJAJ FINANCE LTD	29,220	6,598.15	192,797,943.00
BAJAJ FINSERV LTD	38,590	1,597.05	61,630,159.50
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	2,880	8,452.45	24,343,056.00
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	47,120	1,157.05	54,520,196.00
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	8,500	3,624.25	30,806,125.00
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	347,102	270.95	94,047,286.90
MUTHOOT FINANCE LTD	13,050	1,390.50	18,146,025.00
ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	22,800	451.15	10,286,220.00
POWER FINANCE CORPORATION	157,400	454.00	71,459,600.00
REC LTD	139,700	502.95	70,262,115.00
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	31,920	708.60	22,618,512.00
SHRIRAM FINANCE LTD	29,334	2,396.45	70,297,464.30
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	99,780	592.75	59,144,595.00
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	25,340	1,590.95	40,314,673.00
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	35,540	526.00	18,694,040.00
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	47,040	1,464.00	68,866,560.00
HCL TECHNOLOGIES LTD	100,770	1,623.75	163,625,287.50
INFOSYS LTD	350,708	1,729.45	606,531,950.60
LTIMINDTREE LTD	9,801	5,470.30	53,614,410.30
MPHASIS LTD	7,840	2,578.65	20,216,616.00
PERSISTENT SYSTEMS LTD	5,780	8,642.00	49,950,760.00
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	97,039	4,136.00	401,353,304.00
TATA ELXSI LTD	3,480	7,721.80	26,871,864.00
TECH MAHINDRA LTD	55,910	1,351.05	75,537,205.50

	WIPRO LTD	140,669	499.65	70,285,265.85	
	BHARTI AIRTEL LTD	236,795	1,134.05	268,537,369.75	
	TATA COMMUNICATIONS LTD	11,700	1,705.05	19,949,085.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	32,600	1,721.65	56,125,790.00	
	ADANI POWER LTD	82,920	549.70	45,581,124.00	
	GAIL INDIA LTD	234,863	181.55	42,639,377.65	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	30,240	453.85	13,724,424.00	
	NTPC LIMITED	469,322	334.20	156,847,412.40	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	503,484	274.25	138,080,487.00	
	TATA POWER CO LTD	150,180	392.95	59,013,231.00	
	DLF LTD	63,670	797.35	50,767,274.50	
	GODREJ PROPERTIES LTD	15,340	2,300.40	35,288,136.00	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	24,700	1,111.30	27,449,110.00	
インドルピー小計		14,275,526		10,812,482,098.65 (19,354,342,956)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	67,690	15.40	1,042,426.00	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	309,700	3.35	1,037,495.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	473,800	1.66	786,981.80	
	INDUSTRIES QATAR	157,210	11.85	1,862,938.50	
	COMMERCIAL BANK PQSC	342,480	5.10	1,746,648.00	
	DUKHAN BANK	179,000	3.93	705,081.00	
	MASRAF AL RAYAN	575,200	2.29	1,317,208.00	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	116,100	10.42	1,209,762.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	173,680	19.10	3,317,288.00	
	QATAR NATIONAL BANK	492,140	15.28	7,519,899.20	
	OOREDOO QPSC	77,600	10.50	814,800.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	44,020	17.23	758,464.60	
	BARWA REAL ESTATE CO	214,700	2.84	609,748.00	
カタールリアル小計		3,223,320		22,728,740.10 (923,695,997)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	24,980	182.22	4,551,855.60	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	6,660	782.50	5,211,450.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	43,602	339.23	14,791,106.46	
	GOLD FIELDS LTD	93,680	271.55	25,438,804.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	57,570	116.67	6,716,691.90	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	108,020	69.15	7,469,583.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	7,080	554.78	3,927,842.40	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	36,420	120.37	4,383,875.40	
	SASOL LTD	60,095	157.55	9,467,967.25	
	SIBANYE STILLWATER LTD	292,830	22.20	6,500,826.00	
	BIDVEST GROUP LTD	30,292	235.88	7,145,276.96	
	NASPERS LTD-N SHS	19,880	3,378.29	67,160,405.20	

	PEPKOR HOLDINGS LTD	193,850	19.55	3,789,767.50	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	95,575	68.93	6,587,984.75	
	BID CORP LTD	34,799	472.51	16,442,875.49	
	CLICKS GROUP LTD	26,070	302.19	7,878,093.30	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	58,770	268.49	15,779,157.30	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	39,681	196.62	7,802,078.22	
	ABSA GROUP LTD	89,130	164.21	14,636,037.30	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	9,112	2,039.61	18,584,926.32	
	NEDBANK GROUP LTD	48,728	218.41	10,642,682.48	
	STANDARD BANK GROUP LTD	147,243	200.63	29,541,363.09	
	FIRSTRAND LTD	523,419	66.45	34,781,192.55	
	REINET INVESTMENTS SCA	13,180	461.11	6,077,429.80	
	REMGRO LTD	55,390	155.25	8,599,297.50	
	DISCOVERY LTD	55,055	137.01	7,543,085.55	
	OLD MUTUAL LTD	508,380	12.26	6,232,738.80	
	OUTSURANCE GROUP LTD	97,200	41.60	4,043,520.00	
	SANLAM LTD	181,761	71.82	13,054,075.02	
	MTN GROUP LTD	177,442	94.98	16,853,441.16	
	VODACOM GROUP LTD	62,895	95.50	6,006,472.50	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	49,648	126.42	6,276,500.16	
	南アフリカランド小計	3,248,437		403,918,402.96	(3,170,759,463)
アラブディルハム	MULTIPLY GROUP	402,100	2.65	1,065,565.00	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	250,000	3.01	752,500.00	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	322,900	3.57	1,152,753.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	323,604	8.69	2,812,118.76	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	150,050	11.20	1,680,560.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	316,633	6.35	2,010,619.55	
	EMIRATES NBD PJSC	201,070	17.70	3,558,939.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	457,801	13.80	6,317,653.80	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	363,731	18.60	6,765,396.60	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	418,950	5.07	2,124,076.50	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	729,050	7.43	5,416,841.50	
	アラブディルハム小計	3,935,889		33,657,023.71	(1,357,387,766)
クウェート・ディナール	AGILITY	161,452	0.58	94,610.87	
	BOUBYAN BANK K.S.C	156,497	0.61	96,871.64	
	GULF BANK	231,575	0.29	68,546.20	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	831,967	0.77	645,606.39	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	818,899	0.97	799,245.42	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	218,400	0.51	113,349.60	
	MABANEE CO KPSC	67,685	0.74	50,560.69	

クウェート・ディナール小計		2,486,475		1,868,790.81 (899,598,520)
香港・オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	57,700	6.54	377,358.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	214,717	5.97	1,281,860.49
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	49,400	37.74	1,864,356.00
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	23,600	12.43	293,348.00
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	46,500	6.58	305,970.00
	PETROCHINA CO LTD-A	166,233	8.12	1,349,811.96
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	73,700	24.23	1,785,751.00
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	53,700	10.58	568,146.00
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	36,150	23.05	833,257.50
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	14,900	26.61	396,489.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	117,200	5.65	662,180.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	34,200	23.74	811,908.00
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	206,200	6.32	1,303,184.00
	CHINA JUSHI CO LTD -A	26,289	9.38	246,590.82
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	139,200	5.59	778,128.00
	CHINA NORTHERN RARE EARTH-A	38,100	17.39	662,559.00
	GANFENG LITHIUM CO LTD-A	16,100	34.10	549,010.00
	GEM CO LTD-A	55,400	4.55	252,070.00
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	16,600	17.68	293,488.00
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	66,554	12.05	801,975.70
	HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	7,400	46.46	343,804.00
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	438,792	1.47	645,024.24
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	66,500	3.72	247,380.00
	JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	58,800	10.15	596,820.00
	JIANGXI COPPER CO LTD-A	20,600	18.12	373,272.00
	LB GROUP CO LTD-A	14,800	17.00	251,600.00
	NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	67,500	13.94	940,950.00
	QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	50,000	14.65	732,500.00
	RONGSHENG PETROCHEMICAL CO-A	77,800	10.02	779,556.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	27,244	21.27	579,479.88
	SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	15,340	25.21	386,721.40
	SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	145,000	2.89	419,050.00
	SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	17,545	16.41	287,913.45
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	30,700	5.16	158,412.00
	TIANQI LITHIUM CORP-A	13,500	44.83	605,205.00
	TONGKUN GROUP CO LTD-A	14,600	11.80	172,280.00
	WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	22,500	72.30	1,626,750.00
	WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	8,320	26.46	220,147.20
	YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C-A	8,300	41.44	343,952.00
	ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	15,150	24.04	364,206.00

ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	154,600	12.19	1,884,574.00
AECC AVIATION POWER CO-A	24,100	31.58	761,078.00
AVICOPTER PLC-A	9,400	34.06	320,164.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	12,200	27.94	340,868.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	40,900	30.34	1,240,906.00
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	308,200	2.15	662,630.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	48,800	6.26	305,488.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	185,000	6.22	1,150,700.00
CHINA STATE CONSTRUCTION-A	324,000	5.11	1,655,640.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	29,700	158.33	4,702,401.00
CRRC CORP LTD-A	231,200	5.87	1,357,144.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	21,700	14.27	309,659.00
EVE ENERGY CO LTD-A	17,383	34.21	594,672.43
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	60,060	4.43	266,065.80
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	3,500	57.81	202,335.00
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	43,900	6.96	305,544.00
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD-A	14,100	18.00	253,800.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	13,020	23.94	311,698.80
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,879	53.13	631,131.27
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	30,800	11.53	355,124.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	157,500	3.19	502,425.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	65,080	22.14	1,440,871.20
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	2,340	68.80	160,992.00
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	122,702	4.88	598,785.76
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	1,050	73.98	77,679.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	69,100	13.70	946,670.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	87,700	2.33	204,341.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	121,700	3.99	485,583.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	12,576	60.10	755,817.60
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	13,100	84.20	1,103,020.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	12,200	12.37	150,914.00
TBEA CO LTD-A	51,350	14.41	739,953.50
WEICHAJ POWER CO LTD-A	57,500	15.40	885,500.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	111,700	6.03	673,551.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	20,100	18.68	375,468.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	49,000	7.79	381,710.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	5,400	32.89	177,606.00
AIR CHINA LTD-A	110,000	7.17	788,700.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	464,100	5.06	2,348,346.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	161,700	3.75	606,375.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	71,400	5.63	401,982.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	103,710	10.04	1,041,248.40

DAQIN RAILWAY CO LTD-A	135,800	7.49	1,017,142.00
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	408,400	1.38	563,592.00
S F HOLDING CO LTD-A	32,200	36.25	1,167,250.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	11,338	34.27	388,553.26
YUNDA HOLDING CO LTD-A	24,570	6.46	158,722.20
BYD CO LTD -A	12,800	175.87	2,251,136.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	2,300	126.83	291,709.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	65,482	12.88	843,408.16
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,900	40.66	768,474.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS-A	29,471	16.13	475,367.23
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	5,200	87.02	452,504.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC-A	11,800	14.37	169,566.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	7,700	48.40	372,680.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	64,200	14.15	908,430.00
SERES GROUP CO L-A	14,400	61.71	888,624.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	12,500	20.27	253,375.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	18,100	35.90	649,790.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	53,100	23.80	1,263,780.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	9,400	23.15	217,610.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	3,780	61.34	231,865.20
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	6,493	54.31	352,634.83
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	7,000	24.58	172,060.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	17,320	9.56	165,579.20
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	17,300	17.17	297,041.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	22,700	7.36	167,072.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	128,100	5.94	760,914.00
KUNLUN TECH CO LTD-A	6,400	31.25	200,000.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	17,400	22.36	389,064.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	15,300	9.64	147,492.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	58,200	4.11	239,202.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	18,500	82.70	1,529,950.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	32,200	6.53	210,266.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	67,900	4.41	299,439.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	7,170	40.80	292,536.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	3,200	219.60	702,720.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	4,500	40.48	182,160.00
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	5,000	52.88	264,400.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	52,000	4.79	249,080.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING-A	30,872	36.79	1,135,780.88
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	14,600	40.10	585,460.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	31,677	29.38	930,670.26
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	54,300	28.14	1,528,002.00

JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	11,600	49.43	573,388.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	10,383	96.52	1,002,167.16
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	5,647	22.94	129,542.18
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	8,160	1,676.00	13,676,160.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,600	153.45	1,473,120.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	34,452	37.01	1,275,068.52
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	41,775	8.38	350,074.50
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	8,460	219.80	1,859,508.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	6,300	45.33	285,579.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	6,600	76.49	504,834.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO-A	43,080	19.30	831,444.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	25,500	132.99	3,391,245.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	13,300	31.35	416,955.00
BY-HEALTH CO LTD-A	25,500	16.25	414,375.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	66,176	14.40	952,934.40
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	13,100	28.65	375,315.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	3,700	59.68	220,816.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	10,000	34.90	349,000.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	41,024	7.46	306,039.04
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	16,073	14.17	227,754.41
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	23,271	5.06	117,751.26
OVCTEK CHINA INC-A	6,720	19.15	128,688.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	17,900	17.56	314,324.00
SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A	7,790	143.05	1,114,359.50
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	7,755	292.50	2,268,337.50
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	3,400	59.38	201,892.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	3,260	89.57	291,998.20
BEIJING TONGRENTANG CO-A	13,000	43.40	564,200.00
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	5,684	55.88	317,621.92
BGI GENOMICS CO LTD-A	3,300	41.35	136,455.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	3,300	118.99	392,667.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	9,700	55.79	541,163.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	19,200	51.40	986,880.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	3,400	40.76	138,584.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	20,930	18.61	389,507.30
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	1,300	320.50	416,650.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	47,673	41.00	1,954,593.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	21,091	13.42	283,041.22
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	10,350	20.71	214,348.50
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	24,000	16.25	390,000.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	20,700	23.15	479,205.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	65,500	6.69	438,195.00

SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	9,280	22.46	208,428.80
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	14,800	17.17	254,116.00
WUXI APPTTEC CO LTD-A	19,488	52.25	1,018,248.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	12,740	49.45	629,993.00
ZHANGZHOU PIENZTEHUANG PHA-A	4,900	205.93	1,009,057.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	11,620	12.43	144,436.60
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	24,480	16.65	407,592.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	672,600	4.09	2,750,934.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	199,923	5.10	1,019,607.30
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	38,000	12.59	478,420.00
BANK OF CHINA LTD-A	180,800	4.46	806,368.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	313,500	6.19	1,940,565.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	55,760	10.70	596,632.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	169,910	7.42	1,260,732.20
BANK OF NANJING CO LTD -A	79,112	8.38	662,958.56
BANK OF NINGBO CO LTD -A	45,407	21.69	984,877.83
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	134,327	6.48	870,438.96
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	90,700	7.05	639,435.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	439,900	3.18	1,398,882.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	154,410	31.33	4,837,665.30
CHINA MINSHENG BANKING-A	335,200	3.97	1,330,744.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	125,443	6.12	767,711.16
IND & COMM BK OF CHINA-A	384,100	5.32	2,043,412.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	152,821	15.92	2,432,910.32
PING AN BANK CO LTD-A	147,644	9.68	1,429,193.92
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	172,500	4.86	838,350.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	185,521	7.00	1,298,647.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	70,700	3.00	212,100.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	73,580	7.39	543,756.20
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	87,100	5.03	438,113.00
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	22,948	32.48	745,351.04
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	69,230	13.99	968,527.70
CITIC SECURITIES CO-A	94,970	21.14	2,007,665.80
CSC FINANCIAL CO LTD-A	41,000	22.75	932,750.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	43,500	7.90	343,650.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	123,866	13.20	1,635,031.20
EVERBRIGHT SECURITIE CO-A	30,800	16.17	498,036.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	55,200	5.32	293,664.00
GF SECURITIES CO LTD-A	46,700	13.73	641,191.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	59,317	8.08	479,281.36
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	69,188	14.71	1,017,755.48
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	68,900	6.39	440,271.00

HAITONG SECURITIES CO LTD-A	88,200	8.85	780,570.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	4,400	121.44	534,336.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	68,100	13.92	947,952.00
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	41,400	7.29	301,806.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	68,640	5.47	375,460.80
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	60,160	8.43	507,148.80
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	220,000	4.50	990,000.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	79,937	6.65	531,581.05
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	88,900	3.72	330,708.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	55,200	6.09	336,168.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,800	9.55	418,290.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	22,867	30.14	689,211.38
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	53,312	25.35	1,351,459.20
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	15,000	30.05	450,750.00
PICC HOLDING CO-A	77,900	5.17	402,743.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	76,657	41.56	3,185,864.92
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	64,500	7.00	451,500.00
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,215	227.53	959,038.95
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	18,672	6.50	121,368.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	48,200	4.76	229,432.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	17,660	20.64	364,502.40
IFLYTEK CO LTD-A	17,400	41.20	716,880.00
NAVINFO CO LTD-A	30,300	6.11	185,133.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,800	54.10	205,580.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	22,916	43.12	988,137.92
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	31,571	10.64	335,915.44
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	320,712	3.82	1,225,119.84
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	23,100	8.27	191,037.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	125,200	15.53	1,944,356.00
GOERTEK INC -A	35,700	15.51	553,707.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	47,875	9.47	453,376.25
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	36,300	9.64	349,932.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	13,336	29.13	388,477.68
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	41,100	11.00	452,100.00
LINGYI ITECH GUANGDONG CO-A	45,000	4.85	218,250.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	51,560	28.22	1,455,023.20
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	4,880	94.67	461,989.60
NINESTAR CORP-A	16,800	18.69	313,992.00
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	6,805	150.12	1,021,566.60
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	25,300	12.73	322,069.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	172,920	4.16	719,347.20
TIANMA MICROELECTRONICS-A	32,300	7.96	257,108.00

UNISPLENDOUR CORP LTD-A	27,002	15.78	426,091.56
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	12,300	32.43	398,889.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	25,352	5.33	135,126.16
MUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	14,948	22.90	342,309.20
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	7,630	26.49	202,118.70
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	28,000	16.52	462,560.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	7,200	124.88	899,136.00
ZTE CORP-A	36,100	23.08	833,188.00
CHINA UNITED NETWORK-A	217,000	4.47	969,990.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	178,500	8.35	1,490,475.00
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	270,700	4.56	1,234,392.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	169,509	24.72	4,190,262.48
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	168,600	4.47	753,642.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	71,900	6.00	431,400.00
HUANENG POWER INTL INC-A	86,900	8.55	742,995.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	70,500	14.07	991,935.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	42,192	15.58	657,351.36
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	5,844	116.80	682,579.20
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	3,920	111.20	435,904.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	5,376	61.96	333,096.96
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	14,756	23.08	340,568.48
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	18,310	76.30	1,397,053.00
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	25,648	17.17	440,376.16
JINKO SOLAR CO LTD-A	63,000	8.09	509,670.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	54,235	19.60	1,063,006.00
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	4,400	251.00	1,104,400.00
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	47,200	11.59	547,048.00
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A	17,080	13.45	229,726.00
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	1,300	131.77	171,301.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	2,560	114.01	291,865.60
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	30,500	11.52	351,360.00
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	27,500	6.44	177,100.00
TONGWEI CO LTD-A	33,400	25.12	839,008.00
TRINA SOLAR CO LTD-A	16,250	23.01	373,912.50
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,579	52.26	343,818.54
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	10,160	84.08	854,252.80
XINJIANG DAQO NEW ENERGY C-A	16,830	27.65	465,349.50
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	13,500	33.24	448,740.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	61,077	8.79	536,866.83
CHINA VANKE CO LTD -A	75,200	9.51	715,152.00
GEMDALE CORP-A	20,500	3.84	78,720.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	84,753	9.44	800,068.32

	SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	15,000	9.13	136,950.00
	SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	76,498	2.83	216,489.34
香港・オフショア人民元小計		17,967,700		222,105,239.88 (4,563,129,942)
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	50,122	9.08	455,107.76
	SAUDI ARABIAN OIL CO	275,839	31.35	8,647,552.65
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	14,800	39.15	579,420.00
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	38,290	11.78	451,056.20
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	24,000	130.00	3,120,000.00
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	38,390	31.75	1,218,882.50
	SAUDI ARABIAN MINING CO	139,730	47.35	6,616,215.50
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	6,260	153.40	960,284.00
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	93,290	79.20	7,388,568.00
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	38,016	20.50	779,328.00
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	80,560	9.06	729,873.60
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	37,530	38.00	1,426,140.00
	SAUDI RESEARCH AND MARKETING	3,990	221.00	881,790.00
	JARIR MARKETING CO	62,840	15.44	970,249.60
	NAHDI MEDICAL CO	3,940	141.20	556,328.00
	ALMARAI CO	24,340	59.60	1,450,664.00
	SAVOLA	26,820	48.00	1,287,360.00
	DALLAH HEALTHCARE CO	4,540	173.00	785,420.00
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	8,950	313.20	2,803,140.00
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	10,060	125.80	1,265,548.00
	AL RAJHI BANK	208,482	87.00	18,137,934.00
	ALINMA BANK	101,660	41.85	4,254,471.00
	ARAB NATIONAL BANK	70,920	24.90	1,765,908.00
	BANK AL-JAZIRA	42,440	19.64	833,521.60
	BANK ALBILAD	49,936	46.60	2,327,017.60
	BANQUE SAUDI FRANSI	61,170	38.35	2,345,869.50
	RIYAD BANK	153,010	28.40	4,345,484.00
	SAUDI AWWAL BANK	103,950	35.55	3,695,422.50
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	52,710	15.86	835,980.60
	THE SAUDI NATIONAL BANK	312,375	40.10	12,526,237.50
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	4,860	209.20	1,016,712.00
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	9,255	218.40	2,021,292.00
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	8,560	130.80	1,119,648.00	
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	2,580	344.80	889,584.00	
ELM CO	2,560	939.00	2,403,840.00	
ETIHAD ETISALAT CO	38,960	53.20	2,072,672.00	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	47,250	13.64	644,490.00	
SAUDI TELECOM CO	217,765	42.55	9,265,900.75	

	ACWA POWER CO	10,050	243.20	2,444,160.00	
	POWER & WATER UTILITY CO FOR	7,330	63.60	466,188.00	
	SAUDI ELECTRICITY CO	83,220	19.50	1,622,790.00	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	57,980	12.90	747,942.00	
サウジアラビアリアル小計		2,629,330		118,155,992.86 (4,667,161,717)	
合 計		728,642,109		108,381,651,526 (108,381,651,526)	

(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	8,859,046.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	72,488	5,269,152.72	
メキシコペソ小計			372,388	14,128,198.72 (122,704,818)	
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	()	
合 計				122,704,818 (122,704,818)	

(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 70銘柄	100.0%			3.3%
メキシコペソ	株式 22銘柄	95.9%			2.6%
	投資証券 2銘柄			4.1%	0.1%
ブラジルリアル	株式 50銘柄	100.0%			5.3%
チリペソ	株式 12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%			0.5%
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%			0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%			0.3%
ポーランドズロチ	株式 15銘柄	100.0%			1.0%
香港ドル	株式 183銘柄	100.0%			18.9%
マレーシアリングギット	株式 31銘柄	100.0%			1.4%
タイバーツ	株式 38銘柄	100.0%			1.7%
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%			1.9%
韓国ウォン	株式	104銘柄	100.0%			12.5%
台湾ドル	株式	90銘柄	100.0%			16.4%
インドルピー	株式	131銘柄	100.0%			17.8%
	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	32銘柄	100.0%			2.9%
アラブディルハム	株式	11銘柄	100.0%			1.3%
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	294銘柄	100.0%			4.2%
サウジアラビアリアル	株式	42銘柄	100.0%			4.3%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本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）

2024年 2月 7日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	82,584,295
投資証券	59,112,838,850
未収配当金	660,500,372
流動資産合計	59,855,923,517
資産合計	59,855,923,517
負債の部	
流動負債	
未払利息	5
流動負債合計	5
負債合計	5
純資産の部	
元本等	
元本	24,372,916,265
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	35,483,007,247
元本等合計	59,855,923,512
純資産合計	59,855,923,512
負債純資産合計	59,855,923,517

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。
--	--

(貸借対照表に関する注記)

		2024年 2月 7日現在
1.	期首	2023年 2月10日
	期首元本額	23,742,309,243円
	期首からの追加設定元本額	4,928,122,944円
	期首からの一部解約元本額	4,297,515,922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	2,488,233,690円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	1,574,157,463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）	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）	19,487,539,932円
	財産3分法（適格機関投資家専用）	646,131,843円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	1,205,746円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	746,907円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	360,215円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）奇数月分配型	16,186,605円
	計	24,372,916,265円
2.	受益権の総数	24,372,916,265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 2023年 2月10日 至 2024年 2月 7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。	
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。	
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。	

金融商品の時価等に関する事項

		2024年 2月 7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。	
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。	
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。	

(有価証券に関する注記)

(2024年 2月 7日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	3,369,674,055
合計	3,369,674,055

(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)

		2024年 2月 7日現在
1口当たり純資産額		2.4558円
(1万口当たり純資産額)		(24,558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	1,196	142,922,000	
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,885	171,535,000	
	S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	2,936	342,044,000	
	東海道リート投資法人 投資証券	1,005	125,926,500	
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	2,032	1,227,328,000	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	6,919	927,837,900	
	産業ファンド投資法人 投資証券	8,978	1,186,891,600	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,773	1,876,225,000	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	3,087	1,227,082,500	
	G L P 投資法人 投資証券	19,876	2,504,376,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,894	885,564,000	
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	10,250	2,712,150,000	
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	1,086	562,548,000	
	O n e リート投資法人 投資証券	1,026	276,404,400	
	イオンリート投資法人 投資証券	7,218	982,369,800	
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,505	846,118,500	
	日本リート投資法人 投資証券	1,911	645,918,000	
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	17,681	1,377,349,900	
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	1,239	174,203,400	
	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	1,451	192,257,500	
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,603	169,918,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	19,028	2,955,048,400	
	いちごホテルリート投資法人 投資証券	975	110,565,000	
	ラサールロジポート投資法人 投資証券	7,521	1,119,876,900	
	スターアジア不動産投資法人 投資証券	9,068	524,130,400	
	マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	907	113,193,600	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,447	1,096,256,000	
	大江戸温泉リート投資法人 投資証券	900	65,520,000	
	投資法人みらい 投資証券	8,075	358,933,750	
	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	2,032	739,648,000	
	C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,533	385,775,900	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	955	113,931,500		
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	2,790	289,602,000		
アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	2,578	325,343,600		
日本ビルファンド投資法人 投資証券	6,864	4,036,032,000		

ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	6,044	3,360,464,000	
日本都市ファンド投資法人 投資証券	28,204	2,721,686,000	
オリックス不動産投資法人 投資証券	11,724	1,943,839,200	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	4,024	1,364,136,000	
N T T都市開発リート投資法人 投資証券	5,965	737,870,500	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	3,945	661,576,500	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	4,345	470,998,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	13,162	1,908,490,000	
森トラストリート投資法人 投資証券	11,341	817,686,100	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	28,489	1,709,340,000	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,183	935,415,500	
平和不動産リート投資法人 投資証券	4,396	598,735,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	3,769	1,021,399,000	
福岡リート投資法人 投資証券	3,043	521,874,500	
K D X不動産投資法人 投資証券	16,933	2,590,749,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	4,821	390,501,000	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,219	743,590,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	2,805	400,554,000	
スターツプロシード投資法人 投資証券	1,020	203,694,000	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	8,870	2,267,172,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	19,697	1,422,123,400	
大和証券リビング投資法人 投資証券	8,665	915,024,000	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	5,113	615,093,900	
合計	372,001	59,112,838,850	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2024年 2月 7日現在

資産の部	
流動資産	
預金	394,406,600
コール・ローン	35,036,404
投資証券	54,655,130,457
未収入金	2,810,635
未収配当金	75,852,556
流動資産合計	55,163,236,652
資産合計	
55,163,236,652	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	5,059,218
未払利息	2
流動負債合計	5,059,220

2024年 2月 7日現在

負債合計	5,059,220
純資産の部	
元本等	
元本	17,602,447,154
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	37,555,730,278
元本等合計	55,158,177,432
純資産合計	55,158,177,432
負債純資産合計	55,163,236,652

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)

		2024年 2月 7日現在
1.	期首	2023年 2月10日
	期首元本額	19,644,232,705円
	期首からの追加設定元本額	3,767,857,212円
	期首からの一部解約元本額	5,809,642,763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	2,009,709,877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）	6,647,253円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	15,349,636,391円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	13,203,549円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	592,485円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	569,806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）	222,087,793円
	計	17,602,447,154円
2.	受益権の総数	17,602,447,154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 2023年 2月10日 至 2024年 2月 7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。	
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。	
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。	

金融商品の時価等に関する事項

		2024年 2月 7日現在

貸借対照表計上額、時価及びその差額 時価の算定方法	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。 (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。
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 (有価証券に関する注記) (2024年 2月 7日現在)	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。

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	998,345,812
合計	998,345,812

(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)

2024年 2月 7日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.1336円 (31,336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	26,283	447,862.32	
		AGREE REALTY CORPORATION	28,465	1,658,086.25	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	19,881	340,362.72	
		ALEXANDER'S INC	617	133,512.63	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	43,942	5,168,897.46	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	3,159	47,985.21	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	13,746	299,525.34	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	89,471	3,118,959.06	
		AMERICOLD REALTY TRUST INC	75,049	2,112,629.35	
		APARTMENT INCOME REIT CO	41,468	1,349,783.40	
		APARTMENT INVT&MGMT CO -A	38,144	286,080.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	59,808	956,329.92	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	18,326	216,063.54	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	8,742	14,511.72	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	39,950	6,901,362.50	
		BOSTON PROPERTIES INC	40,614	2,571,272.34	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	17,457	39,278.25	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	48,905	203,933.85	

BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	84,385	1,896,130.95	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	52,873	847,554.19	
BRT APARTMENTS CORP	3,398	56,236.90	
CAMDEN PROPERTY TRUST	30,055	2,864,842.60	
CARETRUST REIT INC	33,648	688,101.60	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	6,777	158,581.80	
CENTERSPACE	4,124	222,572.28	
CHATHAM LODGING TRUST	12,668	132,887.32	
CITY OFFICE REIT INC	11,825	55,222.75	
CLIPPER REALTY INC	3,393	16,422.12	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	6,767	171,814.13	
COPT DEFENSE PROPERTIES	31,873	733,716.46	
COUSINS PROPERTIES INC	42,545	929,182.80	
CTO REALTY GROWTH INC	6,385	105,991.00	
CUBESMART	63,206	2,759,573.96	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	58,507	538,264.40	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	190,524	126,698.46	
DIGITAL REALTY TRUST INC	85,162	12,285,470.12	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	58,979	153,345.40	
DOUGLAS EMMETT INC	47,038	598,793.74	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	68,595.90	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	27,076	319,767.56	
EASTGROUP PROPERTIES INC	13,035	2,360,638.50	
ELME COMMUNITIES	24,973	358,112.82	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	36,694	350,427.70	
EPR PROPERTIES	21,237	911,704.41	
EQUINIX INC	26,390	22,115,083.90	
EQUITY COMMONWEALTH	30,758	580,711.04	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	52,514	3,521,063.70	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	97,242	5,754,781.56	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	43,835	1,076,587.60	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	18,070	4,209,767.90	
EXTRA SPACE STORAGE INC	59,402	8,478,447.46	
FARMLAND PARTNERS INC	11,625	127,061.25	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	20,651	2,099,380.66	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	37,181	1,913,706.07	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	25,618	592,031.98	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	26,426	62,893.88	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	75,136	3,396,898.56	
GETTY REALTY CORPORATION	13,458	364,308.06	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	10,804	135,050.00	
GLADSTONE LAND CORP	8,550	115,938.00	

GLOBAL MEDICAL REIT INC	16,639	160,233.57
GLOBAL NET LEASE INC	54,512	445,908.16
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	107,541	1,713,128.13
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	153,895	2,782,421.60
HIGHWOODS PROPERTIES INC	29,661	641,864.04
HOST HOTELS & RESORTS INC	198,346	3,861,796.62
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	36,680	277,300.80
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	63,049	936,908.14
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	18,055	69,872.85
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	7,860	712,823.40
INVENTRUST PROPERTIES CORP	18,777	469,425.00
INVITATION HOMES INC	161,749	5,292,427.28
IRON MOUNTAIN INC	82,086	5,660,650.56
JBG SMITH PROPERTIES	24,457	393,023.99
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	219,100	56,966.00
KILROY REALTY CORPORATION	30,001	1,018,233.94
KIMCO REALTY CORP	186,857	3,783,854.25
KITE REALTY GROUP TRUST	61,660	1,328,156.40
LTC PROPERTIES INC	11,963	365,110.76
LXP INDUSTRIAL TRUST	82,427	741,018.73
MACERICH CO/THE	60,428	1,003,709.08
MANULIFE US REAL ESTATE INV	584,347	32,723.43
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	168,184	543,234.32
MID-AMERICA APARTMENT COMM	32,821	4,121,661.18
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	21,784	804,047.44
NATL HEALTH INVESTORS INC	12,274	637,143.34
NET LEASE OFFICE PROPERTY	4,251	101,641.41
NETSTREIT CORP	19,358	347,476.10
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	7,296	48,591.36
NEXPOINT RESIDENTIAL	6,156	192,375.00
NNN REIT INC	51,354	2,065,457.88
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	15,503	55,810.80
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	69,130	1,933,566.10
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,565	92,076.05
ORION OFFICE REIT INC	17,145	82,124.55
PARAMOUNT GROUP INC	45,499	205,655.48
PARK HOTELS & RESORTS INC	59,080	900,970.00
PEAKSTONE REALTY TRUST	9,720	139,190.40
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	33,793	510,950.16
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	33,833	1,182,125.02
PHYSICIANS REALTY TRUST	67,495	807,915.15
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	33,502	215,082.84
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	9,896	215,040.08

		POSTAL REALTY TRUST INC- A	5,728	81,394.88
		PRIME US REIT	184,200	29,103.60
		PROLOGIS INC	259,673	33,887,326.50
		PUBLIC STORAGE	44,490	12,397,138.50
		REALTY INCOME CORP	233,958	12,575,242.50
		REGENCY CENTERS CORP	46,196	2,873,853.16
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	35,038	484,575.54
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	59,275	3,134,462.00
		RLJ LODGING TRUST	43,863	509,249.43
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	16,785	1,918,693.35
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	65,405	848,302.85
		SAFEHOLD INC	12,509	255,934.14
		SAUL CENTERS INC	3,710	140,312.20
		SERVICE PROPERTIES TRUST	46,532	354,573.84
		SIMON PROPERTY GROUP INC	91,689	13,147,285.71
		SITE CENTERS CORP	50,306	689,695.26
		SL GREEN REALTY CORP	18,122	775,077.94
		STAG INDUSTRIAL INC	51,037	1,914,908.24
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	29,619	192,819.69
		SUN COMMUNITIES INC	35,013	4,375,924.74
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	57,839	620,612.47
		TANGER INC	29,686	779,851.22
		TERRENO REALTY CORP	23,582	1,436,851.26
		UDR INC	85,209	3,030,032.04
		UMH PROPERTIES INC	17,827	263,661.33
		UNITI GROUP INC	66,940	340,724.60
		UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	3,614	140,801.44
		URBAN EDGE PROPERTIES	32,852	571,624.80
		VENTAS INC	113,169	5,103,921.90
		VERIS RESIDENTIAL INC	22,622	338,198.90
		VICI PROPERTIES INC	290,760	8,673,370.80
		VORNADO REALTY TRUST	44,966	1,138,089.46
		WELLTOWER INC	155,643	13,467,788.79
		WHITESTONE REIT	13,006	166,997.04
		WP CAREY INC	61,547	3,734,671.96
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	29,709	390,079.17
米ドル小計			7,944,382	287,853,639.99 (42,567,796,281)
加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	17,854	312,445.00
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,987	101,837.19
		BOARDWALK EQUITIES INC	6,694	469,115.52
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	5,317	83,476.90

		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	10,240	30,617.60	
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	23,240	1,104,132.40	
		CHOICE PROPERTIES REIT	45,872	630,281.28	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,026	213,786.84	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	15,585	224,112.30	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	37,305	514,062.90	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,012	30,120.00	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	29,799	477,081.99	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	8,756	659,589.48	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	36,548	356,708.48	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	19,632	262,872.48	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	16,411	309,019.13	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,648	94,604.00	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	5,901	89,636.19	
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	9,851	79,497.57	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	32,841	152,710.65	
		PRIMARIS REIT	13,115	178,101.70	
		PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	8,609	47,263.41	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	41,695	749,259.15	
		SLATE GROCERY REIT	6,982	87,903.38	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	19,835	483,180.60	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	2,223	18,895.50	
加ドル小計			454,978	7,760,311.64	(850,762,965)
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	13,372	757,523.80	
		ALTAREA	1,217	96,143.00	
		CARE PROPERTY INVEST	10,435	135,655.00	
		CARMILA	15,528	249,690.24	
		COFINIMMO	10,420	667,401.00	
		COVIVIO	13,516	584,972.48	
		CROMWELL REIT EUR	85,360	116,089.60	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	11,963	241,174.08	
		GECINA SA	14,412	1,441,200.00	
		HAMBORNER REIT AG	21,815	140,052.30	
		ICADE	9,067	276,543.50	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	17,269	37,560.07	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	81,583	434,429.47	
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	8,508	176,966.40	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	129,693	146,293.70	
		KLEPIERRE	54,671	1,298,436.25	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	15,711	96,151.32	
		MERCIALYS	26,368	276,600.32	

		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	94,291	882,563.76	
		MONTEA	4,382	336,099.40	
		NSI NV	5,548	109,073.68	
		RETAIL ESTATES	3,481	209,208.10	
		SHURGARD SELF STORAGE LTD	8,695	360,364.27	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	28,460	1,868,683.60	
		VASTNED RETAIL	4,832	96,881.60	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	48,592	1,270,194.88	
		WERELDHAVE NV	11,149	151,291.93	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	8,021	215,764.90	
	ユーロ小計		758,359	12,673,008.65	(2,016,529,136)
英ポンド	投資証券	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	103,214	54,393.77	
		AEW UK REIT PLC	48,766	45,742.50	
		ASSURA PLC	834,381	362,955.73	
		BALANCED COMM PROPERTY TRUST	191,594	147,527.38	
		BIG YELLOW GROUP PLC	55,165	609,021.60	
		BRITISH LAND COMPANY PLC	264,128	1,008,704.83	
		CLS HOLDINGS PLC	40,564	38,982.00	
		CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	124,321	85,905.81	
		DERWENT LONDON PLC	31,547	644,189.74	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	178,296	164,923.80	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	71,398	281,022.52	
		HAMMERSON PLC	1,055,049	278,110.91	
		HELICAL PLC	33,388	65,640.80	
		HOME REIT PLC	256,438	97,574.65	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	122,092	101,946.82	
		INTU PROPERTIES PLC	758,746		
		LAND SECURITIES GROUP PLC	211,095	1,406,737.08	
		LIFE SCIENCE REIT PLC	110,213	62,600.98	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	306,645	577,719.18	
		LXI REIT PLC	485,422	504,353.45	
		NEWRIVER REIT PLC	84,126	65,954.78	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	146,665	95,478.91	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	376,452	352,359.07	
		PRS REIT PLC/THE	145,505	119,314.10	
		REGIONAL REIT LTD	147,696	36,407.06	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	60,747	478,382.62	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	159,661	70,330.67	
		SEGRO PLC	345,188	2,969,997.55	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	549,063	724,214.09	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	356,077	279,520.44	

		TARGET HEALTHCARE REIT PLC	169,123	142,232.44
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	103,176	60,254.78
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	536,218	876,716.43
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	240,704	153,809.85
		UNITE GROUP PLC/THE	111,166	1,117,218.30
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	128,160	160,200.00
		WAREHOUSE REIT PLC	121,094	101,840.05
		WORKSPACE GROUP PLC	37,110	187,962.15
英債券小計			9,100,393	14,530,246.84 (2,707,566,196)
豪ドル	投資証券	ABACUS GROUP	142,410	150,954.60
		ABACUS STORAGE KING	164,070	186,219.45
		ARENA REIT	98,586	348,994.44
		BWP TRUST	140,960	472,216.00
		CENTURIA CAPITAL GROUP	223,594	361,104.31
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	156,473	517,925.63
		CENTURIA OFFICE REIT	121,951	151,219.24
		CHARTER HALL GROUP	132,406	1,545,178.02
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	190,705	699,887.35
		CHARTER HALL RETAIL REIT	150,782	551,862.12
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	93,916	258,269.00
		CROMWELL PROPERTY GROUP	422,166	164,644.74
		DEXUS INDUSTRIA REIT	65,834	183,018.52
		DEXUS/AU	305,631	2,283,063.57
		GDI PROPERTY GROUP	181,454	118,852.37
		GOODMAN GROUP	485,860	12,991,896.40
		GPT GROUP	541,622	2,393,969.24
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	76,727	178,006.64
		HEALTHCO REIT	149,367	200,151.78
		HMC CAPITAL LTD	68,018	418,990.88
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	501,969	622,441.56
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	60,162	175,673.04
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	108,326	482,050.70
		MIRVAC GROUP	1,114,922	2,374,783.86
		NATIONAL STORAGE REIT	358,274	820,447.46
		REGION RE LTD	333,801	747,714.24
		RURAL FUNDS GROUP	108,250	224,077.50
		SCENTRE GROUP	1,465,934	4,515,076.72
		STOCKLAND	673,409	2,976,467.78
		VICINITY CENTRES	1,094,293	2,199,528.93
		WAYPOINT REIT	195,834	475,876.62
			9,927,706	39,790,562.71

豪ドル小計				(3,841,380,924)
ニュー ジーラン ドドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	375,484	820,432.54
ニュージーランドドル小計			375,484	820,432.54 (73,986,606)
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	503,000	910,430.00
		FORTUNE REIT	434,900	1,961,399.00
		LINK REIT	720,180	28,375,092.00
		PROSPERITY REIT	411,000	509,640.00
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	306,000	566,100.00
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	670,610	697,434.40
香港ドル小計			3,045,690	33,020,095.40 (624,410,004)
シンガ ポールド ル	投資証券	AIMS APAC REIT	196,717	253,764.93
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,003,932	2,790,930.96
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	714,292	660,720.10
		CAPITALAND CHINA TRUST	325,185	255,270.22
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	1,427,092	2,825,642.16
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	181,400	181,400.00
		EC WORLD REIT	70,300	19,684.00
		ESR-LOGOS REIT	1,676,019	527,945.98
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	319,100	205,819.50
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	311,305	706,662.35
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	828,960	903,566.40
		KEPPEL DC REIT	378,977	617,732.51
		KEPPEL REIT	646,900	572,506.50
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	493,852	301,249.72
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	588,208	1,423,463.36
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	937,387	1,406,080.50
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	653,531	901,872.78
		PARAGON REIT	362,400	308,040.00
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	113,300	409,013.00
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	154,400	104,220.00
STARHILL GLOBAL REIT	394,000	193,060.00		
SUNTEC REIT	640,500	736,575.00		
シンガポールドル小計			12,417,757	16,305,219.97 (1,794,389,457)
韓国ウォ ン	投資証券	D&D PLATFORM REIT CO LTD	16,715	54,156,600.00
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	49,349	192,461,100.00
		JR REIT XXVII	45,388	186,317,740.00
		KORAMCO LIFE INFRA REIT	16,399	80,437,095.00
		LOTTE REIT CO LTD	39,257	123,463,265.00

		NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,699	42,287,670.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	20,630	134,920,200.00	
		SK REITS CO LTD	37,743	143,989,545.00	
韓国ウォン小計			238,180	958,033,215.00	(107,203,916)
イスラエル シュケル	投資証券	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	225,077	382,630.90	
		REIT 1 LTD	53,286	861,101.76	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	63,926	508,147.77	
イスラエルシュケル小計			342,289	1,751,880.43	(71,104,972)
合計				54,655,130,457	(54,655,130,457)

(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 139銘柄	100.0%	77.9%
加ドル	投資証券 26銘柄	100.0%	1.6%
ユーロ	投資証券 28銘柄	100.0%	3.7%
英ポンド	投資証券 38銘柄	100.0%	5.0%
豪ドル	投資証券 31銘柄	100.0%	7.0%
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%	1.1%
シンガポールドル	投資証券 22銘柄	100.0%	3.3%
韓国ウォン	投資証券 8銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシュケル	投資証券 3銘柄	100.0%	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2024年 2月 7日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	182,098,545
国債証券	47,017,030,640
地方債証券	2,523,397,458
特殊債証券	2,308,703,510
社債証券	1,203,937,000
未収利息	117,278,665
前払費用	4,189,160
流動資産合計	53,356,634,978
資産合計	53,356,634,978

2024年 2月 7日現在

負債の部	
流動負債	
未払解約金	20,075,669
未払利息	12
流動負債合計	20,075,681
負債合計	20,075,681
純資産の部	
元本等	
元本	39,750,098,097
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	13,586,461,200
元本等合計	53,336,559,297
純資産合計	53,336,559,297
負債純資産合計	53,356,634,978

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 2月 7日現在
1.	期首	2023年 2月10日
	期首元本額	35,889,356,118円
	期首からの追加設定元本額	5,418,836,568円
	期首からの一部解約元本額	1,558,094,589円
	元本の内訳	
	DCインデックスバランス（株式20）	5,966,888,495円
	DCインデックスバランス（株式40）	5,827,499,753円
	DCインデックスバランス（株式60）	4,716,792,230円
	DCインデックスバランス（株式80）	871,557,846円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	2,180,580,298円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	4,636,888,576円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,778,089,418円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	18,651,516円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	1,398,691円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	1,327,798円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	3,073,727,169円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,605,381,704円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,632,304,279円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,004,293,549円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	148,289,119円
	インデックスファンド日本債券（1年決算型）	5,871,908,443円
	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	414,519,213円
	計	39,750,098,097円
2.	受益権の総数	39,750,098,097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 2023年 2月10日 至 2024年 2月 7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。
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。
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。

金融商品の時価等に関する事項

	2024年 2月 7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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

(2024年 2月 7日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	693,476,190
地方債証券	145,042
特殊債券	6,230,510
社債券	1,721,000
合計	701,282,658

(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)

	2024年 2月 7日現在
1口当たり純資産額	1.3418円
(1万口当たり純資産額)	(13,418円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第449回利付国債(2年)	80,000,000	79,988,800	
	第450回利付国債(2年)	200,000,000	199,944,000	
	第451回利付国債(2年)	50,000,000	49,981,500	
	第149回利付国債(5年)	100,000,000	99,791,000	
	第150回利付国債(5年)	50,000,000	49,871,500	
	第152回利付国債(5年)	100,000,000	99,969,000	
	第153回利付国債(5年)	300,000,000	298,692,000	

第155回利付国債(5年)	100,000,000	100,441,000	
第156回利付国債(5年)	200,000,000	200,114,000	
第157回利付国債(5年)	150,000,000	149,907,000	
第158回利付国債(5年)	230,000,000	228,921,300	
第159回利付国債(5年)	150,000,000	149,092,500	
第160回利付国債(5年)	120,000,000	119,792,400	
第161回利付国債(5年)	120,000,000	120,284,400	
第162回利付国債(5年)	130,000,000	130,118,300	
第163回利付国債(5年)	270,000,000	271,474,200	
第1回利付国債(40年)	70,000,000	81,083,100	
第2回利付国債(40年)	125,000,000	139,307,500	
第3回利付国債(40年)	85,000,000	94,391,650	
第4回利付国債(40年)	95,000,000	105,378,750	
第5回利付国債(40年)	95,000,000	100,996,400	
第6回利付国債(40年)	110,000,000	114,283,400	
第7回利付国債(40年)	130,000,000	128,718,200	
第8回利付国債(40年)	115,000,000	105,405,550	
第9回利付国債(40年)	180,000,000	120,162,600	
第10回利付国債(40年)	175,000,000	137,063,500	
第11回利付国債(40年)	140,000,000	105,081,200	
第12回利付国債(40年)	175,000,000	116,413,500	
第13回利付国債(40年)	180,000,000	118,184,400	
第14回利付国債(40年)	190,000,000	133,133,000	
第15回利付国債(40年)	230,000,000	177,760,100	
第16回利付国債(40年)	170,000,000	143,884,600	
第338回利付国債(10年)	390,000,000	391,794,000	
第339回利付国債(10年)	570,000,000	572,986,800	
第340回利付国債(10年)	620,000,000	623,645,600	
第341回利付国債(10年)	700,000,000	703,059,000	
第342回利付国債(10年)	630,000,000	630,327,600	
第343回利付国債(10年)	645,000,000	645,303,150	
第344回利付国債(10年)	700,000,000	700,273,000	
第345回利付国債(10年)	660,000,000	660,092,400	
第346回利付国債(10年)	660,000,000	659,795,400	
第347回利付国債(10年)	680,000,000	679,197,600	
第348回利付国債(10年)	500,000,000	498,920,000	
第349回利付国債(10年)	590,000,000	588,070,700	
第350回利付国債(10年)	540,000,000	537,467,400	
第351回利付国債(10年)	535,000,000	531,763,250	
第352回利付国債(10年)	520,000,000	515,850,400	
第353回利付国債(10年)	400,000,000	396,260,000	
第354回利付国債(10年)	325,000,000	321,564,750	

第355回利付国債(10年)	350,000,000	346,122,000	
第356回利付国債(10年)	350,000,000	345,849,000	
第357回利付国債(10年)	560,000,000	552,748,000	
第358回利付国債(10年)	590,000,000	581,521,700	
第359回利付国債(10年)	420,000,000	413,208,600	
第360回利付国債(10年)	580,000,000	569,519,400	
第361回利付国債(10年)	460,000,000	450,629,800	
第362回利付国債(10年)	400,000,000	390,756,000	
第363回利付国債(10年)	500,000,000	487,005,000	
第364回利付国債(10年)	500,000,000	485,505,000	
第365回利付国債(10年)	410,000,000	396,990,700	
第366回利付国債(10年)	400,000,000	389,432,000	
第367回利付国債(10年)	420,000,000	407,757,000	
第368回利付国債(10年)	450,000,000	435,613,500	
第369回利付国債(10年)	490,000,000	485,668,400	
第370回利付国債(10年)	420,000,000	415,296,000	
第371回利付国債(10年)	480,000,000	469,200,000	
第372回利付国債(10年)	500,000,000	505,870,000	
第373回利付国債(10年)	150,000,000	148,546,500	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	56,916,500	
第3回利付国債(30年)	70,000,000	78,479,800	
第5回利付国債(30年)	80,000,000	90,022,400	
第6回利付国債(30年)	50,000,000	57,243,500	
第8回利付国債(30年)	170,000,000	187,494,700	
第9回利付国債(30年)	70,000,000	74,806,900	
第11回利付国債(30年)	170,000,000	186,243,500	
第13回利付国債(30年)	180,000,000	202,240,800	
第14回利付国債(30年)	108,000,000	125,571,600	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	172,561,830	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	41,142,850	
第17回利付国債(30年)	50,000,000	58,345,000	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	127,353,600	
第19回利付国債(30年)	40,000,000	46,321,200	
第20回利付国債(30年)	40,000,000	47,225,600	
第21回利付国債(30年)	70,000,000	81,156,600	
第22回利付国債(30年)	70,000,000	82,817,000	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	65,115,050	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	80,552,120	
第25回利付国債(30年)	60,000,000	69,643,200	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	199,432,100	
第27回利付国債(30年)	89,000,000	105,628,760	
第28回利付国債(30年)	144,000,000	170,919,360	

第29回利付国債(30年)	176,000,000	206,625,760
第30回利付国債(30年)	147,000,000	170,295,090
第31回利付国債(30年)	120,000,000	137,222,400
第32回利付国債(30年)	160,000,000	184,881,600
第33回利付国債(30年)	175,000,000	193,989,250
第34回利付国債(30年)	160,000,000	181,808,000
第35回利付国債(30年)	193,000,000	212,971,640
第36回利付国債(30年)	195,000,000	214,851,000
第37回利付国債(30年)	211,000,000	228,601,620
第38回利付国債(30年)	165,000,000	175,611,150
第39回利付国債(30年)	165,000,000	178,109,250
第40回利付国債(30年)	130,000,000	137,789,600
第41回利付国債(30年)	160,000,000	166,553,600
第42回利付国債(30年)	135,000,000	140,363,550
第43回利付国債(30年)	155,000,000	160,964,400
第44回利付国債(30年)	150,000,000	155,580,000
第45回利付国債(30年)	120,000,000	120,000,000
第46回利付国債(30年)	160,000,000	159,742,400
第47回利付国債(30年)	125,000,000	126,816,250
第48回利付国債(30年)	85,000,000	83,002,500
第49回利付国債(30年)	140,000,000	136,459,400
第50回利付国債(30年)	145,000,000	124,830,500
第51回利付国債(30年)	140,000,000	106,943,200
第52回利付国債(30年)	130,000,000	103,755,600
第53回利付国債(30年)	135,000,000	109,826,550
第54回利付国債(30年)	110,000,000	93,418,600
第55回利付国債(30年)	110,000,000	93,133,700
第56回利付国債(30年)	140,000,000	118,171,200
第57回利付国債(30年)	190,000,000	159,883,100
第58回利付国債(30年)	180,000,000	151,005,600
第59回利付国債(30年)	170,000,000	138,799,900
第60回利付国債(30年)	120,000,000	102,452,400
第61回利付国債(30年)	100,000,000	81,036,000
第62回利付国債(30年)	120,000,000	91,909,200
第63回利付国債(30年)	120,000,000	88,964,400
第64回利付国債(30年)	100,000,000	73,775,000
第65回利付国債(30年)	110,000,000	80,825,800
第66回利付国債(30年)	180,000,000	131,616,000
第67回利付国債(30年)	110,000,000	84,734,100
第68回利付国債(30年)	140,000,000	107,450,000
第69回利付国債(30年)	110,000,000	86,522,700
第70回利付国債(30年)	110,000,000	86,225,700

第71回利付国債(30年)	120,000,000	93,738,000	
第72回利付国債(30年)	160,000,000	124,548,800	
第73回利付国債(30年)	150,000,000	116,463,000	
第74回利付国債(30年)	150,000,000	126,070,500	
第75回利付国債(30年)	180,000,000	163,099,800	
第76回利付国債(30年)	150,000,000	139,062,000	
第77回利付国債(30年)	160,000,000	155,396,800	
第78回利付国債(30年)	150,000,000	138,670,500	
第79回利付国債(30年)	140,000,000	123,036,200	
第80回利付国債(30年)	130,000,000	132,039,700	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	10,234,700	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	21,446,250	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	40,894,400	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	164,323,200	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	61,998,000	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	135,817,500	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	315,696,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	16,882,400	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	264,440,000	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	63,434,400	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	63,523,800	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	53,091,500	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	87,955,660	
第96回利付国債(20年)	248,000,000	264,350,640	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	48,306,600	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	100,569,660	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	125,617,050	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	32,439,000	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	71,903,700	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	88,589,700	
第103回利付国債(20年)	11,000,000	11,983,180	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	35,664,750	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	83,421,030	
第106回利付国債(20年)	2,000,000	2,175,880	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	141,248,900	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	144,309,960	
第109回利付国債(20年)	27,000,000	29,173,770	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	106,876,840	
第111回利付国債(20年)	25,000,000	27,513,500	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	87,621,600	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	318,817,300	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	57,359,640	

第115回利付国債(20年)	125,000,000	138,603,750
第116回利付国債(20年)	135,000,000	150,207,750
第117回利付国債(20年)	343,000,000	379,584,380
第118回利付国債(20年)	70,000,000	77,235,200
第119回利付国債(20年)	60,000,000	65,434,200
第120回利付国債(20年)	170,000,000	183,280,400
第121回利付国債(20年)	22,000,000	24,188,560
第122回利付国債(20年)	17,000,000	18,581,340
第123回利付国債(20年)	195,000,000	217,432,800
第124回利付国債(20年)	90,000,000	99,751,500
第125回利付国債(20年)	50,000,000	56,202,000
第126回利付国債(20年)	105,000,000	116,533,200
第127回利付国債(20年)	50,000,000	55,146,500
第128回利付国債(20年)	65,000,000	71,766,500
第129回利付国債(20年)	85,000,000	93,242,450
第130回利付国債(20年)	150,000,000	164,664,000
第131回利付国債(20年)	92,000,000	100,317,720
第132回利付国債(20年)	135,000,000	147,367,350
第133回利付国債(20年)	110,000,000	120,909,800
第134回利付国債(20年)	120,000,000	132,054,000
第135回利付国債(20年)	30,000,000	32,780,100
第136回利付国債(20年)	220,000,000	238,581,200
第137回利付国債(20年)	200,000,000	218,648,000
第138回利付国債(20年)	120,000,000	129,216,000
第139回利付国債(20年)	230,000,000	249,602,900
第140回利付国債(20年)	318,000,000	347,930,160
第141回利付国債(20年)	235,000,000	257,186,350
第142回利付国債(20年)	165,000,000	182,044,500
第143回利付国債(20年)	94,000,000	102,074,600
第144回利付国債(20年)	330,000,000	355,499,100
第145回利付国債(20年)	315,000,000	345,098,250
第146回利付国債(20年)	195,000,000	213,622,500
第147回利付国債(20年)	208,000,000	225,790,240
第148回利付国債(20年)	180,000,000	193,503,600
第149回利付国債(20年)	185,000,000	198,817,650
第150回利付国債(20年)	210,000,000	223,419,000
第151回利付国債(20年)	240,000,000	250,094,400
第152回利付国債(20年)	250,000,000	260,202,500
第153回利付国債(20年)	270,000,000	283,467,600
第154回利付国債(20年)	160,000,000	166,006,400
第155回利付国債(20年)	270,000,000	273,626,100
第156回利付国債(20年)	160,000,000	150,851,200

第157回利付国債(20年)	150,000,000	137,401,500	
第158回利付国債(20年)	230,000,000	217,849,100	
第159回利付国債(20年)	150,000,000	143,325,000	
第160回利付国債(20年)	140,000,000	135,053,800	
第161回利付国債(20年)	180,000,000	170,807,400	
第162回利付国債(20年)	150,000,000	141,874,500	
第163回利付国債(20年)	165,000,000	155,449,800	
第164回利付国債(20年)	255,000,000	236,022,900	
第165回利付国債(20年)	170,000,000	156,668,600	
第166回利付国債(20年)	150,000,000	141,732,000	
第167回利付国債(20年)	160,000,000	146,241,600	
第168回利付国債(20年)	140,000,000	125,433,000	
第169回利付国債(20年)	160,000,000	140,411,200	
第170回利付国債(20年)	140,000,000	122,225,600	
第171回利付国債(20年)	170,000,000	147,641,600	
第172回利付国債(20年)	230,000,000	202,022,800	
第173回利付国債(20年)	190,000,000	166,031,500	
第174回利付国債(20年)	200,000,000	173,862,000	
第175回利付国債(20年)	180,000,000	158,439,600	
第176回利付国債(20年)	190,000,000	166,510,300	
第177回利付国債(20年)	200,000,000	171,348,000	
第178回利付国債(20年)	220,000,000	191,076,600	
第179回利付国債(20年)	190,000,000	164,272,100	
第180回利付国債(20年)	190,000,000	172,780,300	
第181回利付国債(20年)	190,000,000	175,354,800	
第182回利付国債(20年)	200,000,000	190,576,000	
第183回利付国債(20年)	190,000,000	190,000,000	
第184回利付国債(20年)	200,000,000	189,524,000	
第185回利付国債(20年)	230,000,000	217,172,900	
第186回利付国債(20年)	170,000,000	171,558,900	
国債証券 合計	47,426,000,000	47,017,030,640	
地方債証券			
第4回東京都公募公債(東京グリーンbond(5年))	100,000,000	99,790,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	102,100,000	
第32回東京都公募公債(5年)	200,000,000	199,700,000	
第744回東京都公募公債	100,000,000	100,615,000	
令和2年度第2回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,850,000	
令和3年度第6回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,507,000	
第214回神奈川県公募公債	100,000,000	100,589,000	
平成27年度第10回静岡県公募公債	200,000,000	201,000,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	102,680,000	
平成26年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	100,336,000	
第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,363,008	

	第142回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,514,120	
	第144回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,404,000	
	第147回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,574,000	
	第165回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,628,000	
	平成28年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	99,750,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	100,559,000	
	平成29年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	99,604,000	
	平成27年度第2回熊本県公募公債（10年）	100,000,000	100,543,000	
	第2回名古屋市定時償還公募公債（10年）	15,000,000	15,018,330	
	平成27年度第5回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,515,000	
	令和2年度第1回鹿児島県公募公債（5年）	100,000,000	99,758,000	
地方債証券 合計		2,515,000,000	2,523,397,458	
特殊債券	第5回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	99,877,000	
	第13回新関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,325,510	
	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	199,222,000	
	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,486,000	
	第28回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,437,000	
	第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,542,000	
	第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,458,000	
	第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,711,000	
	第324回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,952,000	
	第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,242,000	
	第69回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,368,000	
	第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,414,000	
	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,750,000	
	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,322,000	
	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,145,000	
	第363回信金中金債（5年）	100,000,000	99,836,000	
	第395回信金中金債（5年）	100,000,000	99,431,000	
	第29回国際協力機構債券	100,000,000	100,562,000	
	第37回国際協力機構債券	100,000,000	99,623,000	
特殊債券 合計		2,300,000,000	2,308,703,510	
社債券	第22回味の素株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,002,000	
	第25回味の素株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,895,000	
	第10回株式会社資生堂無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,813,000	
	第14回株式会社小松製作所無担保社債（社債間限定同順位特約付）（グリーンボンド）	100,000,000	99,792,000	

第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債 （社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,623,000	
第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 （社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,891,000	
第510回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,881,000	
第552回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,094,000	
第400回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,376,000	
第447回中国電力株式会社社債（一般担保付） （トランジションボンド）	100,000,000	99,387,000	
第31回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,917,000	
第28回東京瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定 同順位特約付）	100,000,000	106,266,000	
社債券 合計	1,200,000,000	1,203,937,000	
合計	53,441,000,000	53,053,068,608	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2024年 2月 7日現在

資産の部	
流動資産	
預金	111,282,532
コール・ローン	69,593,634
国債証券	22,693,042,702
派生商品評価勘定	8,326,049
未収利息	209,231,316
前払費用	13,617,114
流動資産合計	23,105,093,347
資産合計	23,105,093,347
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	270,865,422
未払金	4,796,388
未払解約金	2,142,504
未払利息	4
流動負債合計	277,804,318
負債合計	277,804,318
純資産の部	
元本等	
元本	17,279,456,302
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,547,832,727
元本等合計	22,827,289,029
純資産合計	22,827,289,029
負債純資産合計	23,105,093,347

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法 国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。

<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>(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> <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)

		2024年 2月 7日現在
1.	期首	2023年 2月10日
	期首元本額	15,998,349,713円
	期首からの追加設定元本額	2,333,498,497円
	期首からの一部解約元本額	1,052,391,908円
	元本の内訳	
	インデックスファンド海外債券ヘッジあり（DC専用）	6,272,507,109円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,497,275,093円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	149,526,443円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	1,414,016円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	3,344,345円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	8,254,358,182円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	125,054,742円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	184,470,112円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	202,153,732円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	149,924,104円
	インデックスファンド海外債券（ヘッジあり）1年決算型	439,428,424円
	計	17,279,456,302円
2.	受益権の総数	17,279,456,302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 2023年 2月10日 至 2024年 2月 7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。	
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。	
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。	

金融商品の時価等に関する事項

		2024年 2月 7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。	
時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	

	2024年 2月 7日現在
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

（2024年 2月 7日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	1,047,385,251
合計	1,047,385,251

（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）

（2024年 2月 7日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	22,795,699,725	-	23,058,239,098	262,539,373
	米ドル	10,728,683,742	-	10,907,142,641	178,458,899
	加ドル	413,662,255	-	421,581,889	7,919,634
	メキシコペソ	186,609,930	-	192,654,933	6,045,003
	ユーロ	7,282,193,952	-	7,325,399,483	43,205,531
	英ポンド	1,142,904,984	-	1,157,333,444	14,428,460
	スウェーデンクローナ	60,950,351	-	61,279,557	329,206
	ノルウェークローネ	43,325,985	-	44,629,299	1,303,314
	デンマーククローネ	74,530,945	-	74,715,158	184,213
	ポーランドズロチ	126,317,543	-	127,197,067	879,524
	豪ドル	348,064,932	-	348,564,876	499,944
	ニュージーランドドル	38,067,913	-	38,948,437	880,524
	シンガポールドル	94,000,813	-	94,867,918	867,105
	マレーシアリンギット	316,393,329	-	313,458,668	2,934,661
	中国元	1,862,663,024	-	1,869,993,092	7,330,068
	イスラエルシケル	77,330,027	-	80,472,636	3,142,609
合計	22,795,699,725	-	23,058,239,098	262,539,373	

（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、以下のよう評価しております。

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2024年 2月 7日現在	
1口当たり純資産額	1.3211円
(1万口当たり純資産額)	(13,211円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	1,150,000.00	1,117,441.20	
		US TREASURY N/B-1.75%-25/03/15	1,200,000.00	1,161,374.40	
		US TREASURY N/B-3.875%-25/03/31	2,200,000.00	2,178,600.60	
		US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	1,300,000.00	1,259,729.90	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	600,000.00	586,617.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	700,000.00	682,745.70	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	500,000.00	469,335.50	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	2,000,000.00	1,925,898.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	3,200,000.00	3,080,000.00	
		US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	1,500,000.00	1,394,383.50	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	1,500,000.00	1,451,601.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	1,600,000.00	1,515,499.20	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	2,100,000.00	1,979,084.10	
		US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	900,000.00	841,113.00	
		US TREASURY N/B-1.375%-26/08/31	500,000.00	465,410.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	4,000,000.00	3,770,312.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	500,000.00	466,230.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	1,100,000.00	1,040,595.60	
		US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,000,000.00	913,476.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	1,500,000.00	1,419,256.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	1,100,000.00	1,033,033.10	
		US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	500,000.00	437,382.50	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	1,100,000.00	963,981.70	
		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	530,000.00	566,810.09	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	600,000.00	561,409.80			

US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	1,990,000.00	1,748,129.43
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	900,000.00	855,509.40
US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	1,000,000.00	890,957.00
US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	900,000.00	800,244.00
US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	1,600,000.00	1,419,748.80
US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	400,000.00	350,171.60
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	1,500,000.00	1,426,435.50
US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	1,400,000.00	1,230,112.80
US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	500,000.00	440,869.00
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	210,000.00	220,770.69
US TREASURY N/B-1.375%-28/12/31	650,000.00	573,357.85
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	900,000.00	841,886.10
US TREASURY N/B-2.375%-29/03/31	1,400,000.00	1,291,280.20
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	900,000.00	828,843.30
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	850,000.00	752,814.40
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	2,400,000.00	2,073,513.60
US TREASURY N/B-4.0%-30/02/28	450,000.00	448,022.25
US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	1,700,000.00	1,378,062.50
US TREASURY N/B-3.75%-30/05/31	500,000.00	490,800.50
US TREASURY N/B-4.125%-30/08/31	500,000.00	501,074.00
US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	950,000.00	773,452.00
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	400,000.00	433,859.20
US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	600,000.00	509,015.40
US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	1,400,000.00	1,146,658.80
US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	800,000.00	657,093.60
US TREASURY N/B-1.875%-32/02/15	1,000,000.00	849,882.00
US TREASURY N/B-2.875%-32/05/15	900,000.00	823,640.40
US TREASURY N/B-4.125%-32/11/15	750,000.00	751,698.75
US TREASURY N/B-3.5%-33/02/15	800,000.00	764,280.80
US TREASURY N/B-3.375%-33/05/15	500,000.00	472,500.00
US TREASURY N/B-3.875%-33/08/15	1,200,000.00	1,179,750.00
US TREASURY N/B-4.5%-33/11/15	1,000,000.00	1,032,734.00
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	390,000.00	408,525.00
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	170,000.00	174,409.29
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	390,000.00	359,835.84
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	100,000.00	101,402.30
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	230,000.00	232,461.69
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	350,000.00	332,164.70
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	200,000.00	200,769.40
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	200,000.00	185,140.60
US TREASURY N/B-3.125%-41/11/15	350,000.00	295,872.85
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	300,000.00	236,390.40
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	100,000.00	83,371.00

		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	250,000.00	200,053.50	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	140,000.00	125,450.36	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	200,000.00	182,242.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	450,000.00	402,205.05	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	120,000.00	103,153.08	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	600,000.00	483,492.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	650,000.00	478,384.40	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	450,000.00	361,045.80	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	700,000.00	548,542.40	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	200,000.00	159,929.60	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	950,000.00	691,106.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	150,000.00	108,834.90	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	950,000.00	653,922.05	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	300,000.00	232,658.10	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	900,000.00	677,689.20	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	550,000.00	413,423.45	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	650,000.00	510,224.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	1,000,000.00	669,902.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	350,000.00	220,239.95	
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	1,550,000.00	794,919.05	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	1,800,000.00	954,000.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	400,000.00	226,866.80	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	1,000,000.00	604,863.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	400,000.00	272,765.60	
		US TREASURY N/B-2.875%-52/05/15	1,270,000.00	966,538.58	
		US TREASURY N/B-4.125%-53/08/15	200,000.00	193,796.80	
米ドル小計			82,790,000.00	73,085,079.00 (10,807,821,482)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	400,000.00	386,328.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	290,000.00	282,019.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	400,000.00	370,688.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	400,000.00	371,536.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-28/03/01	300,000.00	299,163.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	280,000.00	311,332.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	400,000.00	377,784.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	100,000.00	87,762.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	230,000.00	201,486.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-32/12/01	200,000.00	185,956.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	210,000.00	244,513.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	200,000.00	203,586.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	550,000.00	416,383.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	100,000.00	88,115.00	
			4,060,000.00	3,826,652.60	

加ドル小計				(419,515,924)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	4,000,000.00	3,680,625.00
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	3,000,000.00	2,674,687.50
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	2,000,000.00	1,883,437.50
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	4,000,000.00	3,871,875.00
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	2,500,000.00	2,298,828.12
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	4,500,000.00	4,185,000.00
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	3,000,000.00	2,560,781.25
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	980,000.00	848,159.37
メキシコペソ小計			23,980,000.00	22,003,393.74 (191,101,674)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	150,000.00	155,511.15
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	100,000.00	94,403.80
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	130,000.00	144,937.00
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	200,000.00	185,960.60
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	400,000.00	341,806.40
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	400,000.00	355,352.40
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	170,000.00	185,639.49
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	260,000.00	309,881.52
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	150,000.00	169,941.60
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	120,000.00	127,864.20
		BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	200,000.00	141,980.20
		BELGIUM KINGDOM-1.4%-53/06/22	50,000.00	31,694.75
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	50,000.00	38,643.55
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	110,000.00	81,527.49
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 71/10/31	50,000.00	23,927.35
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%- 25/04/30	300,000.00	294,319.80
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%- 25/07/30	200,000.00	204,531.20
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	600,000.00	588,407.40
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	400,000.00	428,741.60
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	350,000.00	336,302.40
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	300,000.00	283,577.70
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/07/30	100,000.00	94,231.40
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	550,000.00	606,408.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	430,000.00	493,064.23		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%- 29/10/31	150,000.00	132,306.90		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	150,000.00	141,584.40		

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%-30/10/31	300,000.00	269,300.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%-31/04/30	150,000.00	122,325.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.7%-32/04/30	200,000.00	166,120.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	200,000.00	239,788.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-33/04/30	200,000.00	199,750.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%-33/07/30	300,000.00	280,171.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	430,000.00	464,260.68	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	400,000.00	453,472.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	150,000.00	180,154.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	300,000.00	260,447.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	250,000.00	206,082.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.9%-52/10/31	80,000.00	52,718.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	100,000.00	89,268.80	
BUNDES OBLIGATION-2.4%-28/10/19	150,000.00	151,081.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	150,000.00	146,032.35	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15	500,000.00	486,485.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	750,000.00	719,475.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	400,000.00	375,942.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15	600,000.00	564,600.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	260,000.00	292,192.94	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-28/02/15	500,000.00	467,182.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	200,000.00	220,753.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-29/02/15	500,000.00	454,562.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.1%-29/11/15	150,000.00	149,072.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	430,000.00	524,995.17	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.4%-30/11/15	100,000.00	101,086.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	420,000.00	507,339.42	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.7%-32/08/15	900,000.00	864,231.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.3%-33/02/15	100,000.00	100,490.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.6%-33/08/15	350,000.00	359,791.95	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-	300,000.00	366,609.90	

34/07/04			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	260,000.00	304,755.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	150,000.00	183,011.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	270,000.00	350,222.94	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	200,000.00	220,506.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	150,000.00	148,916.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	330,000.00	328,449.66	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	200,000.00	104,341.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 52/08/15	200,000.00	99,372.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%- 53/08/15	250,000.00	213,086.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%- 53/08/15	100,000.00	85,360.50	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.8%-25/06/12	100,000.00	99,759.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%- 25/02/01	200,000.00	194,193.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 25/03/01	300,000.00	304,966.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	400,000.00	391,036.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 25/11/15	300,000.00	297,011.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	550,000.00	565,502.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	550,000.00	610,450.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	300,000.00	285,897.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	400,000.00	386,915.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	250,000.00	280,085.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	150,000.00	143,937.15	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%- 28/03/15	150,000.00	133,598.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%- 28/08/01	580,000.00	594,896.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	550,000.00	586,317.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	450,000.00	495,964.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	500,000.00	504,276.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 30/08/01	150,000.00	128,632.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 31/04/01	350,000.00	293,321.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	350,000.00	406,783.65	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	300,000.00	259,920.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-32/06/01	100,000.00	81,151.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	250,000.00	288,856.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.4%-33/05/01	350,000.00	368,764.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.35%-33/11/01	200,000.00	209,286.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	250,000.00	274,477.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-35/04/30	200,000.00	201,720.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	260,000.00	260,167.18	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	300,000.00	326,908.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	300,000.00	326,627.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01	150,000.00	158,382.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-46/09/01	450,000.00	382,659.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%-48/03/01	400,000.00	349,644.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-52/09/01	140,000.00	90,911.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	250,000.00	178,207.75	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	150,000.00	152,218.95	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	200,000.00	201,595.00	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	150,000.00	127,404.60	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	100,000.00	93,729.30	
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	100,000.00	72,530.70	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	70,000.00	26,655.37	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	400,000.00	387,307.60	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	450,000.00	473,332.95	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	450,000.00	436,038.75	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	400,000.00	406,979.20	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	450,000.00	428,710.95	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	600,000.00	570,834.00	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	500,000.00	503,379.50	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/02/25	450,000.00	419,368.50	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	450,000.00	417,724.65	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	400,000.00	368,116.40	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-29/02/25	150,000.00	151,275.15	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	490,000.00	558,879.30	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	200,000.00	179,940.00	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	750,000.00	747,022.50	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-30/11/25	100,000.00	84,021.50	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	1,000,000.00	927,226.00	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	850,000.00	1,046,300.70	

	FRANCE (GOVT OF) -2.0%-32/11/25	200,000.00	188,909.20	
	FRANCE (GOVT OF) -1.25%-34/05/25	300,000.00	257,954.10	
	FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	180,000.00	211,473.18	
	FRANCE (GOVT OF) -1.25%-36/05/25	300,000.00	247,348.50	
	FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	460,000.00	510,912.34	
	FRANCE (GOVT OF) -1.75%-39/06/25	150,000.00	125,834.25	
	FRANCE (GOVT OF) -0.5%-40/05/25	270,000.00	179,473.32	
	FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	250,000.00	294,238.25	
	FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	370,000.00	369,843.12	
	FRANCE (GOVT OF) -2.0%-48/05/25	200,000.00	157,542.40	
	FRANCE (GOVT OF) -0.75%-52/05/25	300,000.00	161,351.40	
	FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	320,000.00	359,461.76	
	FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	350,000.00	398,408.50	
	IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	100,000.00	102,335.20	
	IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	300,000.00	298,471.80	
	IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	300,000.00	247,573.50	
	IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	100,000.00	87,239.50	
	IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	100,000.00	84,306.00	
	IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	50,000.00	36,141.40	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	150,000.00	144,474.75	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	250,000.00	238,020.25	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	270,000.00	300,414.15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	200,000.00	177,684.20	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-32/07/15	150,000.00	127,211.40	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	230,000.00	229,332.08	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	300,000.00	341,009.70	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	200,000.00	142,576.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	50,000.00	56,776.05	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	200,000.00	200,321.60	
	NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-54/01/15	100,000.00	85,319.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	130,000.00	95,986.54	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	250,000.00	243,420.75	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	100,000.00	104,273.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	200,000.00	223,704.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	370,000.00	334,175.12	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	200,000.00	192,123.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	200,000.00	224,102.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	100,000.00	100,376.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	50,000.00	28,914.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	80,000.00	91,524.00	
	ユーロ小計	45,720,000.00	45,108,731.92 (7,177,701,423)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.5%-26/07/22	200,000.00	188,291.80

		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	250,000.00	228,582.50	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	150,000.00	151,627.50	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	120,000.00	131,312.40	
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	350,000.00	298,074.00	
		UK TREASURY-0.375%-30/10/22	200,000.00	159,739.60	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	200,000.00	211,122.00	
		UK TREASURY-1.0%-32/01/31	100,000.00	80,351.00	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	280,000.00	287,814.80	
		UK TREASURY-3.25%-33/01/31	200,000.00	189,598.00	
		UK TREASURY-0.875%-33/07/31	280,000.00	211,887.20	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	100,000.00	103,792.00	
		UK TREASURY-0.625%-35/07/31	150,000.00	102,540.00	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	100,000.00	101,030.10	
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	250,000.00	186,100.00	
		UK TREASURY-3.75%-38/01/29	200,000.00	188,740.00	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	170,000.00	178,077.21	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	100,000.00	98,230.70	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	120,000.00	120,641.28	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	450,000.00	375,844.95	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	50,000.00	43,124.60	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	350,000.00	335,988.80	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	100,000.00	56,540.00	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	100,000.00	58,820.00	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	560,000.00	533,908.48	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	400,000.00	366,243.20	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	300,000.00	247,280.40	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	900,000.00	867,285.00	
英ポンド小計			6,730,000.00	6,102,587.52	(1,137,156,158)
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	250,000.00	248,238.75	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	1,500,000.00	1,441,120.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,750,000.00	1,748,026.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	700,000.00	793,226.00	
スウェーデンクローナ小計			4,200,000.00	4,230,611.25	(59,567,006)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	1,000,000.00	956,303.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	1,300,000.00	1,221,113.40	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-33/08/15	1,000,000.00	948,272.00	
ノルウェークローネ小計			3,300,000.00	3,125,688.40	(43,665,866)
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	500,000.00	491,909.50	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	2,300,000.00	2,865,889.70	
デンマーククローネ小計			2,800,000.00	3,357,799.20	(71,621,856)

ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	500,000.00	475,520.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,200,000.00	1,060,344.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	500,000.00	481,760.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	1,000,000.00	886,340.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.0%-33/10/25	500,000.00	526,085.00	
ポーランドズロチ小計			3,700,000.00	3,430,049.00	(125,494,173)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	250,000.00	247,982.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	250,000.00	234,865.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	330,000.00	333,567.63	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	150,000.00	154,797.75	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	200,000.00	193,390.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	350,000.00	341,377.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	500,000.00	461,943.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	300,000.00	247,516.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	150,000.00	126,474.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	250,000.00	207,173.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-33/11/21	200,000.00	182,030.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	400,000.00	379,480.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	450,000.00	353,839.95	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-54/06/21	100,000.00	104,545.80	
豪ドル小計			3,880,000.00	3,568,984.33	(344,549,747)
ニュージーランドドル	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-25/04/15	150,000.00	145,882.65	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.0%-29/04/20	150,000.00	140,026.65	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-37/04/15	150,000.00	119,828.25	
ニュージーランドドル小計			450,000.00	405,737.55	(36,589,412)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	400,000.00	406,033.20	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	100,000.00	103,264.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	150,000.00	145,805.25	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	190,000.00	182,698.87	
シンガポールドル小計			840,000.00	837,801.82	(92,200,090)
マレーシアリングット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	1,000,000.00	1,005,820.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,000,000.00	1,009,355.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,400,000.00	1,418,753.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,000,000.00	1,014,625.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,000,000.00	1,000,905.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	500,000.00	554,810.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	2,250,000.00	2,294,192.25	
マレーシアリングット小計			8,150,000.00	8,298,460.75	(257,685,462)
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-2.26%-25/02/24	4,000,000.00	4,010,690.20	

CHINA GOVERNMENT BOND-2.35%-25/03/15	1,000,000.00	1,004,243.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.24%-25/05/25	2,000,000.00	2,002,517.90	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.0%-25/06/15	1,000,000.00	997,819.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-25/08/25	1,000,000.00	1,000,317.50	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	2,000,000.00	2,031,465.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-25/11/25	3,000,000.00	3,005,089.50	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.33%-25/12/15	2,000,000.00	2,007,754.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.46%-26/02/15	3,000,000.00	3,015,891.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	1,000,000.00	1,018,979.50	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.3%-26/05/15	3,000,000.00	3,005,439.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	1,000,000.00	1,011,264.50	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-26/08/15	1,000,000.00	998,862.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.39%-26/11/15	2,000,000.00	2,008,280.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-27/01/20	2,000,000.00	2,007,037.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.48%-27/04/15	3,000,000.00	3,019,297.50	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	3,000,000.00	3,019,263.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.64%-28/01/15	2,000,000.00	2,023,791.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-28/04/15	1,000,000.00	1,011,336.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	4,000,000.00	4,113,592.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.48%-28/09/25	3,000,000.00	3,020,790.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	1,000,000.00	1,025,559.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-29/01/15	1,000,000.00	1,002,157.55	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-29/03/24	4,000,000.00	4,082,930.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-29/06/15	1,000,000.00	1,017,288.50	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.79%-29/12/15	4,000,000.00	4,080,918.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-30/03/25	2,000,000.00	2,040,452.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-30/06/25	1,000,000.00	1,009,354.50	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-30/09/15	3,000,000.00	3,025,563.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.54%-30/12/25	2,000,000.00	2,011,048.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	2,000,000.00	2,075,051.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.89%-31/11/18	1,000,000.00	1,030,890.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	3,000,000.00	3,054,777.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-32/09/01	1,000,000.00	1,006,984.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-33/02/25	3,000,000.00	3,090,931.50	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/05/25	3,000,000.00	3,039,831.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.52%-33/08/25	1,000,000.00	1,001,210.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/11/25	2,000,000.00	2,037,114.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	1,000,000.00	1,211,334.50	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	1,000,000.00	1,193,364.50	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.32%-52/04/15	4,000,000.00	4,475,972.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-52/10/25	1,000,000.00	1,080,500.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-53/04/15	1,000,000.00	1,106,710.00	
	88,000,000.00	90,033,658.65	

中国元小計				(1,851,497,173)
イスラエル シケル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-0.5%-25/04/30	700,000.00	672,821.33
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	500,000.00	532,116.63
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	620,000.00	689,110.40
イスラエルシケル小計			1,820,000.00	1,894,048.36 (76,875,256)
合計				22,693,042,702 (22,693,042,702)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 94銘柄	100.0%	47.7%
加ドル	国債証券 14銘柄	100.0%	1.8%
メキシコペソ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 164銘柄	100.0%	31.6%
英ポンド	国債証券 28銘柄	100.0%	5.0%
スウェーデンクローナ	国債証券 4銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 3銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 2銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.6%
豪ドル	国債証券 14銘柄	100.0%	1.5%
ニュージーランドドル	国債証券 3銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 4銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券 7銘柄	100.0%	1.1%
中国元	国債証券 43銘柄	100.0%	8.2%
イスラエルシケル	国債証券 3銘柄	100.0%	0.3%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

【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（2024年 2月 8日から2024年 8月 7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。

【Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前計算期間末 2024年 2月 7日現在	当中間計算期間末 2024年 8月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,093,348	8,864,451
親投資信託受益証券	334,608,174	617,204,513
未収利息	-	57
流動資産合計	337,701,522	626,069,021
資産合計	337,701,522	626,069,021
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,183,928	5,863,206
未払受託者報酬	27,297	53,717
未払委託者報酬	108,072	212,419
その他未払費用	71,462	73,219
流動負債合計	1,390,759	6,202,561
負債合計	1,390,759	6,202,561
純資産の部		
元本等		
元本	319,498,800	576,428,329
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	16,811,963	43,438,131
（分配準備積立金）	9,388,329	6,980,337
元本等合計	336,310,763	619,866,460
純資産合計	336,310,763	619,866,460
負債純資産合計	337,701,522	626,069,021

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自 2023年 2月10日 至 2023年 8月 9日	当中間計算期間 自 2024年 2月 8日 至 2024年 8月 7日
営業収益		
受取利息	-	1,338
有価証券売買等損益	2,041,035	8,394,639
営業収益合計	2,041,035	8,395,977
営業費用		
支払利息	184	-
受託者報酬	8,330	53,717
委託者報酬	33,169	212,419
その他費用	35,891	73,219
営業費用合計	77,574	339,355
営業利益又は営業損失（ ）	1,963,461	8,056,622
経常利益又は経常損失（ ）	1,963,461	8,056,622
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,963,461	8,056,622
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（ ）	242,112	3,141,410
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	16,811,963
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,801,629	30,343,992
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	2,801,629	30,343,992
剰余金減少額又は欠損金増加額	73,238	8,633,036
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	73,238	8,633,036
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（ ）	4,449,740	43,438,131

（ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

	前計算期間末 2024年 2月 7日現在	当中間計算期間末 2024年 8月 7日現在
1. 期首元本額	10,000,000円	319,498,800円
期中追加設定元本額	477,437,224円	399,431,357円
期中一部解約元本額	167,938,424円	142,501,828円
2. 受益権の総数	319,498,800口	576,428,329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 2023年 2月10日 至 2023年 8月 9日	当中間計算期間 自 2024年 2月 8日 至 2024年 8月 7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 2024年 2月 7日現在	当中間計算期間末 2024年 8月 7日現在
中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末日の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（ 1口当たり情報 ）

	前計算期間末 2024年 2月 7日現在	当中間計算期間末 2024年 8月 7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0526円 (10,526円)	1.0754円 (10,754円)

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

（参考）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	116,511,544	909,095,688
株式	56,368,493,750	56,269,057,730
派生商品評価勘定	961,700	-
未収入金	-	2,132,000

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
未収配当金	78,446,646	71,534,568
未収利息	-	5,892
前払金	-	28,789,100
流動資産合計	56,564,413,640	57,280,614,978
資産合計	56,564,413,640	57,280,614,978
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	23,315,700
前受金	65,000	-
未払金	-	745,775,879
未払解約金	34,627,040	4,624,908
未払利息	8	-
流動負債合計	34,692,048	773,716,487
負債合計	34,692,048	773,716,487
純資産の部		
元本等		
元本	21,627,627,655	21,886,825,784
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	34,902,093,937	34,620,072,707
元本等合計	56,529,721,592	56,506,898,491
純資産合計	56,529,721,592	56,506,898,491
負債純資産合計	56,564,413,640	57,280,614,978

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
1. 期首	2023年 2月10日	2024年 2月 8日
期首元本額	22,734,797,694円	21,627,627,655円
期首からの追加設定元本額	1,965,790,973円	1,470,116,557円
期首からの一部解約元本額	3,072,961,012円	1,210,918,428円
元本の内訳		
DCインデックスバランス（株式20）	720,627,179円	686,336,459円
DCインデックスバランス（株式40）	2,006,343,878円	2,082,923,727円
DCインデックスバランス（株式60）	4,391,302,375円	4,650,962,196円
DCインデックスバランス（株式80）	5,418,426,275円	5,761,786,313円
インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,830,560,657円	1,894,490,117円
世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,484,497,509円	2,258,311,026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）	454,670,687円	421,039,181円
Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	1,245,112円	2,079,555円
Ni つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	725,924円	1,141,167円
Ni つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	342,931円	530,659円

		2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,643,072,775円	1,399,130,414円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	198,577,410円	192,829,226円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	593,241,634円	583,041,318円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	928,346,391円	1,006,780,825円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	955,646,918円	945,443,601円
	計	21,627,627,655円	21,886,825,784円
2.	受益権の総数	21,627,627,655口	21,886,825,784口
3.	担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	832,594,000円	703,252,500円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（2024年 2月 7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	151,945,000	-	152,910,000	965,000
	合計	151,945,000	-	152,910,000	965,000

（2024年 8月 7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	320,909,100	-	297,600,000	23,309,100
	合計	320,909,100	-	297,600,000	23,309,100

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

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

（1口当たり情報）

2024年 2月 7日現在		2024年 8月 7日現在	
1口当たり純資産額	2,6138円	1口当たり純資産額	2,5818円
(1万口当たり純資産額)	(26,138円)	(1万口当たり純資産額)	(25,818円)

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

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
資産の部		
流動資産		
預金	137,586,537	346,398,194
コール・ローン	4,453,274,652	5,033,832,169
株式	346,413,057,477	378,185,183,393
投資証券	6,834,316,280	7,821,742,694
派生商品評価勘定	161,253,448	-
未収入金	11,738,926	121,630
未収配当金	173,239,462	196,021,641
未収利息	-	32,628
差入委託証拠金	546,515,622	552,285,704
流動資産合計	358,730,982,404	392,135,618,053
資産合計		
358,730,982,404		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,130,446	398,772,232
未払金	-	119,168,155
未払解約金	54,697,541	1,417,949,978
未払利息	312	-
流動負債合計	61,828,299	1,935,890,365
負債合計		
61,828,299		
純資産の部		
元本等		
元本	62,314,238,388	64,577,613,785
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	296,354,915,717	325,622,113,903
元本等合計	358,669,154,105	390,199,727,688
純資産合計		
358,669,154,105		
負債純資産合計		
358,730,982,404		
392,135,618,053		

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)

		2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
1.	期首	2023年 2月10日	2024年 2月 8日
	期首元本額	61,138,454,902円	62,314,238,388円
	期首からの追加設定元本額	9,412,175,217円	5,766,139,123円
	期首からの一部解約元本額	8,236,391,731円	3,502,763,726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）	34,229,717,179円	35,878,236,043円
	DCインデックスバランス（株式20）	109,912,399円	98,526,920円
	DCインデックスバランス（株式40）	305,587,498円	284,537,371円
	DCインデックスバランス（株式60）	666,876,506円	635,394,807円
	DCインデックスバランス（株式80）	822,166,275円	824,401,621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	1,137,936,676円	988,171,649円
	日興五大陸株式ファンド	3,399,899,541円	3,439,324,095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）	10,433,802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）	69,164,103円	61,501,442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）	5,670,656,329円	5,609,954,224円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	8,786,704,017円	7,080,100,726円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	10,005,042円	16,754,547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）	1,096,422,058円	3,775,143,293円
	Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）	401,987,465円	558,132,904円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	327,233円	494,505円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	158,177円	228,120円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,247,568,070円	1,008,489,107円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	15,074,559円	13,143,520円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	44,957,259円	39,722,819円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	71,159,877円	64,144,951円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	72,251,999円	68,021,630円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,145,272,324円	4,133,189,491円
	計	62,314,238,388円	64,577,613,785円
2.	受益権の総数	62,314,238,388口	64,577,613,785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

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7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

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7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）

（2024年 2月 7日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,550,208,672	-	5,658,484,923	108,276,251
合計		5,550,208,672	-	5,658,484,923	108,276,251

（2024年 8月 7日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,610,880,395	-	3,417,246,750	193,633,645
合計		3,610,880,395	-	3,417,246,750	193,633,645

（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）

（2024年 2月 7日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	4,789,977,634	-	4,835,824,965	45,847,331
	米ドル	4,071,506,140	-	4,115,536,940	44,030,800
	ユーロ	718,471,494	-	720,288,025	1,816,531
	売建	18,627,900	-	18,628,480	580
	英ポンド	18,627,900	-	18,628,480	580
合計		4,808,605,534	-	4,854,453,445	45,846,751

（2024年 8月 7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	3,196,168,940	-	2,995,577,615	200,591,325
	米ドル	2,789,549,220	-	2,612,208,220	177,341,000
	ユーロ	406,619,720	-	383,369,395	23,250,325
	売建	295,509,844	-	300,057,106	4,547,262
	米ドル	253,330,000	-	257,244,750	3,914,750
	加ドル	21,759,840	-	22,086,403	326,563
	英ポンド	20,420,004	-	20,725,953	305,949
	合計	3,491,678,784	-	3,295,634,721	205,138,587

(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)

2024年 2月 7日現在		2024年 8月 7日現在	
1口当たり純資産額	5.7558円	1口当たり純資産額	6.0423円
(1万口当たり純資産額)	(57,558円)	(1万口当たり純資産額)	(60,423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)

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
資産の部		
流動資産		
預金	276,472,475	1,666,416,307
コール・ローン	98,465,077	22,908,308
株式	108,381,651,526	106,550,210,836
投資証券	122,704,818	87,509,375
派生商品評価勘定	118,523,602	577,908
未収入金	-	3,244,576
未収配当金	117,386,217	334,786,982
未収利息	23,484	148
差入委託証拠金	5,124,641,093	5,407,484,567
流動資産合計	114,239,868,292	114,073,139,007
資産合計	114,239,868,292	114,073,139,007
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,769,870	373,460,375
未払解約金	57,086,082	81,597,484
未払利息	6	-

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
流動負債合計	61,855,958	455,057,859
負債合計	61,855,958	455,057,859
純資産の部		
元本等		
元本	45,016,759,536	43,021,418,427
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	69,161,252,798	70,596,662,721
元本等合計	114,178,012,334	113,618,081,148
純資産合計	114,178,012,334	113,618,081,148
負債純資産合計	114,239,868,292	114,073,139,007

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)

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
1. 期首	2023年 2月10日	2024年 2月 8日
期首元本額	43,220,523,913円	45,016,759,536円
期首からの追加設定元本額	10,427,953,219円	3,135,749,009円
期首からの一部解約元本額	8,631,717,596円	5,131,090,118円
元本の内訳		
日興五大陸株式ファンド	1,949,490,955円	1,961,822,181円
インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	19,574,629,837円	20,504,804,164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）	3,096,504,939円	3,279,668,968円
グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	19,986,016,378円	16,086,453,155円
Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	2,706,692円	4,571,520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）	297,280,903円	1,030,179,649円
Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）	109,013,611円	152,282,321円
Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	753,570円	1,114,935円
Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	362,651円	521,534円
計	45,016,759,536円	43,021,418,427円
2. 受益権の総数	45,016,759,536口	43,021,418,427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

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7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）

（2024年 2月 7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	5,550,868,044	-	5,664,621,776	113,753,732
	合計	5,550,868,044	-	5,664,621,776	113,753,732

（2024年 8月 7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	7,267,701,967	-	6,897,914,012	369,787,955
	合計	7,267,701,967	-	6,897,914,012	369,787,955

（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）

（2024年 2月 7日現在）

該当事項はありません。

（2024年 8月 7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	36,685,692	-	37,263,600	577,908
	メキシコペソ	36,685,692	-	37,263,600	577,908
	売建	300,629,000	-	304,301,420	3,672,420
	米ドル	300,629,000	-	304,301,420	3,672,420
	合計	337,314,692	-	341,565,020	3,094,512

(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)

2024年 2月 7日現在		2024年 8月 7日現在	
1口当たり純資産額	2,5363円	1口当たり純資産額	2,6410円
(1万口当たり純資産額)	(25,363円)	(1万口当たり純資産額)	(26,410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)

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	82,584,295	71,773,879
投資証券	59,112,838,850	59,175,008,500
未収配当金	660,500,372	656,115,752
未収利息	-	465
流動資産合計	59,855,923,517	59,902,898,596
資産合計	59,855,923,517	59,902,898,596
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	64,764,688
未払利息	5	-
流動負債合計	5	64,764,688
負債合計	5	64,764,688
純資産の部		
元本等		
元本	24,372,916,265	24,763,700,056
剰余金		
剰余金又は欠損金()	35,483,007,247	35,074,433,852
元本等合計	59,855,923,512	59,838,133,908
純資産合計	59,855,923,512	59,838,133,908
負債純資産合計	59,855,923,517	59,902,898,596

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。

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
1.	期首	2023年 2月10日	2024年 2月 8日
	期首元本額	23,742,309,243円	24,372,916,265円
	期首からの追加設定元本額	4,928,122,944円	1,140,508,561円
	期首からの一部解約元本額	4,297,515,922円	749,724,770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	2,488,233,690円	2,486,971,536円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	1,574,157,463円	1,686,180,456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）	158,353,864円	159,795,689円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	19,487,539,932円	19,637,886,849円
	財産3分法（適格機関投資家専用）	646,131,843円	729,808,962円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	1,205,746円	2,056,157円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	746,907円	1,313,241円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	360,215円	605,303円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）奇数月分配型	16,186,605円	59,081,863円
	計	24,372,916,265円	24,763,700,056円
2.	受益権の総数	24,372,916,265口	24,763,700,056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

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7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）

2024年 2月 7日現在		2024年 8月 7日現在	
1口当たり純資産額	2.4558円	1口当たり純資産額	2.4164円
(1万口当たり純資産額)	(24,558円)	(1万口当たり純資産額)	(24,164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）

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
資産の部		
流動資産		
預金	394,406,600	147,166,404
コール・ローン	35,036,404	25,318,649
投資証券	54,655,130,457	54,238,672,333
未収入金	2,810,635	4,010,072
未収配当金	75,852,556	103,944,084
未収利息	-	164

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
流動資産合計	55,163,236,652	54,519,111,706
資産合計	55,163,236,652	54,519,111,706
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	492,841
未払解約金	5,059,218	18,326,364
未払利息	2	-
流動負債合計	5,059,220	18,819,205
負債合計	5,059,220	18,819,205
純資産の部		
元本等		
元本	17,602,447,154	15,987,375,714
剰余金		
剰余金又は欠損金()	37,555,730,278	38,512,916,787
元本等合計	55,158,177,432	54,500,292,501
純資産合計	55,158,177,432	54,500,292,501
負債純資産合計	55,163,236,652	54,519,111,706

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
1. 期首	2023年 2月10日	2024年 2月 8日
期首元本額	19,644,232,705円	17,602,447,154円
期首からの追加設定元本額	3,767,857,212円	13,867,596円
期首からの一部解約元本額	5,809,642,763円	1,628,939,036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	2,009,709,877円	1,892,262,250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)	6,647,253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)	15,349,636,391円	13,869,531,875円
Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	13,203,549円	22,504,469円
Ni つみインデックスラップ世界10指数(均等型)	592,485円	897,488円
Ni つみインデックスラップ世界10指数(安定成長型)	569,806円	840,324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)	222,087,793円	201,339,308円
計	17,602,447,154円	15,987,375,714円
2. 受益権の総数	17,602,447,154口	15,987,375,714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

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 「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 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

（通貨関連）

（2024年 2月 7日現在）

該当事項はありません。

（2024年 8月 7日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	32,679,270	-	33,172,111	492,841
	ユーロ	7,913,250	-	8,033,395	120,145
	英ポンド	14,717,120	-	14,937,624	220,504
	豪ドル	5,679,300	-	5,765,856	86,556
	シンガポールドル	4,369,600	-	4,435,236	65,636
合計		32,679,270	-	33,172,111	492,841

（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）

	2024年 2月 7日現在		2024年 8月 7日現在
1口当たり純資産額	3.1336円	1口当たり純資産額	3.4090円
(1万口当たり純資産額)	(31,336円)	(1万口当たり純資産額)	(34,090円)

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	182,098,545	1,021,357,088
国債証券	47,017,030,640	47,524,427,380
地方債証券	2,523,397,458	1,518,117,089
特殊債券	2,308,703,510	2,100,426,528
社債券	1,203,937,000	2,031,883,301
未収入金	-	1,030,581,400
未収利息	117,278,665	125,705,263
前払費用	4,189,160	7,549,476
流動資産合計	53,356,634,978	55,360,047,525
資産合計	53,356,634,978	55,360,047,525
負債の部		
流動負債		
未払解約金	20,075,669	1,059,284,530
未払利息	12	-
流動負債合計	20,075,681	1,059,284,530
負債合計	20,075,681	1,059,284,530
純資産の部		
元本等		
元本	39,750,098,097	41,155,216,668
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	13,586,461,200	13,145,546,327
元本等合計	53,336,559,297	54,300,762,995
純資産合計	53,336,559,297	54,300,762,995
負債純資産合計	53,356,634,978	55,360,047,525

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
1. 期首	2023年 2月10日	2024年 2月 8日
期首元本額	35,889,356,118円	39,750,098,097円
期首からの追加設定元本額	5,418,836,568円	3,002,732,473円
期首からの一部解約元本額	1,558,094,589円	1,597,613,902円
元本の内訳		
DCインデックスバランス（株式20）	5,966,888,495円	6,479,189,568円
DCインデックスバランス（株式40）	5,827,499,753円	6,228,690,641円
DCインデックスバランス（株式60）	4,716,792,230円	5,150,357,011円
DCインデックスバランス（株式80）	871,557,846円	1,054,010,126円
インデックスファンド日本債券（DC専用）	2,180,580,298円	2,125,738,876円

世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	4,636,888,576円	4,630,419,444円
インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,778,089,418円	1,805,481,105円
Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	18,651,516円	33,217,398円
Ni つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	1,398,691円	2,398,380円
Ni つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	1,327,798円	2,239,668円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	3,073,727,169円	3,052,842,095円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,605,381,704円	1,656,251,845円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,632,304,279円	1,738,967,168円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,004,293,549円	974,508,372円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	148,289,119円	174,014,343円
インデックスファンド日本債券（1年決算型）	5,871,908,443円	5,635,198,109円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	414,519,213円	411,692,519円
計	39,750,098,097円	41,155,216,668円
2. 受益権の総数	39,750,098,097口	41,155,216,668口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（1口当たり情報）

2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3418円 (13,418円)	1.3194円 (13,194円)

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
資産の部		
流動資産		
預金	111,282,532	640,466,055
コール・ローン	69,593,634	253,568,260
国債証券	22,693,042,702	22,765,745,631
派生商品評価勘定	8,326,049	330,831,341
未収入金	-	428,907,078
未収利息	209,231,316	196,823,655
前払費用	13,617,114	15,195,147
流動資産合計	23,105,093,347	24,631,537,167
資産合計	23,105,093,347	24,631,537,167
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	270,865,422	250,242,148

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
未払金	4,796,388	549,322,578
未払解約金	2,142,504	164,518,929
未払利息	4	-
流動負債合計	277,804,318	964,083,655
負債合計	277,804,318	964,083,655
純資産の部		
元本等		
元本	17,279,456,302	17,844,705,658
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,547,832,727	5,822,747,854
元本等合計	22,827,289,029	23,667,453,512
純資産合計	22,827,289,029	23,667,453,512
負債純資産合計	23,105,093,347	24,631,537,167

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
1. 期首	2023年 2月10日	2024年 2月 8日
期首元本額	15,998,349,713円	17,279,456,302円
期首からの追加設定元本額	2,333,498,497円	1,068,774,715円
期首からの一部解約元本額	1,052,391,908円	503,525,359円
元本の内訳		
インデックスファンド海外債券ヘッジあり（DC専用）	6,272,507,109円	6,745,024,410円
インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,497,275,093円	1,497,548,794円
Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	149,526,443円	281,243,211円
Ni つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	1,414,016円	2,387,266円
Ni つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	3,344,345円	5,572,942円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	8,254,358,182円	8,194,206,531円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	125,054,742円	126,779,730円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	184,470,112円	192,018,274円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	202,153,732円	195,909,094円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	149,924,104円	174,184,233円
インデックスファンド海外債券（ヘッジあり）1年決算型	439,428,424円	429,831,173円
計	17,279,456,302円	17,844,705,658円
2. 受益権の総数	17,279,456,302口	17,844,705,658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

	2024年 2月 7日現在	2024年 8月 7日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	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）

（2024年 2月 7日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	22,795,699,725	-	23,058,239,098	262,539,373
	米ドル	10,728,683,742	-	10,907,142,641	178,458,899
	加ドル	413,662,255	-	421,581,889	7,919,634
	メキシコペソ	186,609,930	-	192,654,933	6,045,003
	ユーロ	7,282,193,952	-	7,325,399,483	43,205,531
	英ポンド	1,142,904,984	-	1,157,333,444	14,428,460
	スウェーデンクローナ	60,950,351	-	61,279,557	329,206
	ノルウェークローネ	43,325,985	-	44,629,299	1,303,314
	デンマーククローネ	74,530,945	-	74,715,158	184,213
	ポーランドズロチ	126,317,543	-	127,197,067	879,524
	豪ドル	348,064,932	-	348,564,876	499,944
	ニュージーランドドル	38,067,913	-	38,948,437	880,524
	シンガポールドル	94,000,813	-	94,867,918	867,105
	マレーシアリンギット	316,393,329	-	313,458,668	2,934,661
	中国元	1,862,663,024	-	1,869,993,092	7,330,068
	イスラエルシェケル	77,330,027	-	80,472,636	3,142,609
合計	22,795,699,725	-	23,058,239,098	262,539,373	

（2024年 8月 7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	22,831,033,263	-	22,750,444,070	80,589,193
	米ドル	10,591,144,635	-	10,694,480,491	103,335,856
	加ドル	481,704,850	-	453,226,399	28,478,451
	メキシコペソ	188,027,981	-	162,420,865	25,607,116
	ユーロ	6,758,224,777	-	6,850,653,532	92,428,755
	英ポンド	1,261,524,816	-	1,192,177,413	69,347,403
	スウェーデンクローナ	60,914,655	-	57,214,725	3,699,930
	ノルウェークローネ	47,674,223	-	43,846,833	3,827,390
	デンマーククローネ	80,898,795	-	76,352,145	4,546,650
	ポーランドズロチ	116,401,357	-	112,327,715	4,073,642
	豪ドル	298,419,026	-	270,897,690	27,521,336
	ニュージーランドドル	42,776,978	-	39,913,839	2,863,139
	シンガポールドル	101,705,188	-	96,857,430	4,847,758
	マレーシアリンギット	345,425,482	-	342,952,028	2,473,454
	中国元	2,404,839,531	-	2,310,266,997	94,572,534
	イスラエルシケル	51,350,969	-	46,855,968	4,495,001
合計		22,831,033,263	-	22,750,444,070	80,589,193

(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)

2024年 2月 7日現在		2024年 8月 7日現在	
1口当たり純資産額	1.3211円	1口当たり純資産額	1.3263円
(1万口当たり純資産額)	(13,211円)	(1万口当たり純資産額)	(13,263円)

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2024年 8月30日現在です。

【Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）】

【純資産額計算書】

資産総額	664,585,407円
負債総額	1,936,054円
純資産総額（ - ）	662,649,353円
発行済口数	606,755,827口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0921円

（参考）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	61,967,000,698円
負債総額	61,881,645円
純資産総額（ - ）	61,905,119,053円
発行済口数	21,994,603,574口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8146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	418,020,939,161円
負債総額	295,998,226円
純資産総額（ - ）	417,724,940,935円
発行済口数	65,352,935,513口
1口当たり純資産額（ / ）	6.3918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	122,377,852,822円
負債総額	152,965,209円
純資産総額（ - ）	122,224,887,613円
発行済口数	44,145,465,734口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7687円

日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	62,494,765,711円
------	-----------------

負債総額	78,518,023円
純資産総額（ - ）	62,416,247,688円
発行済口数	24,735,179,795口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5234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	56,347,580,348円
負債総額	3,441,743円
純資産総額（ - ）	56,344,138,605円
発行済口数	15,955,471,987口
1口当たり純資産額（ / ）	3.5313円

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	54,784,740,275円
負債総額	82,216,862円
純資産総額（ - ）	54,702,523,413円
発行済口数	41,396,981,796口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3214円

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	23,810,394,367円
負債総額	485,397,947円
純資産総額（ - ）	23,324,996,420円
発行済口数	17,611,320,031口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3244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たと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8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8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8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8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	771	299,204
株式投資信託	725	261,663
単位型	270	7,372
追加型	455	254,290
公社債投資信託	46	37,541
単位型	33	992
追加型	13	36,548

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。

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65期事業年度(2023年4月1日から2024年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第64期 (2023年3月31日)		第65期 (2024年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		42,036		31,198
金銭の信託		-		3,899
有価証券		1,025		1
前払費用		908		814
未収入金	4	410		179
未収委託者報酬		21,336		21,592
未収収益	3	589	3	647
関係会社短期貸付金		3,318		-
立替金		1,015		1,089
その他	2	1,233	2	2,011
流動資産合計		71,875		61,434
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	245	1	233
器具備品	1	122	1	134
有形固定資産合計		367		368
無形固定資産				
ソフトウェア		390		438
無形固定資産合計		390		438
投資その他の資産				
投資有価証券		23,274		28,465
関係会社株式		22,366		37,647
長期差入保証金		375		285
繰延税金資産		448		-
投資その他の資産合計		46,465		66,398
固定資産合計		47,224		67,205
資産合計		119,099		128,640

(単位：百万円)

	第64期 (2023年3月31日)		第65期 (2024年3月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金		433		451
未払金		7,557		9,211
未払収益分配金		7		7
未払償還金		71		71
未払手数料		6,586		8,330

その他未払金		892		803
未払費用	3	4,227	3	4,082
未払法人税等		-		1,644
未払消費税等		-	4	620
賞与引当金		2,563		2,619
役員賞与引当金		218		232
その他		647		683
流動負債合計		15,648		19,547
固定負債				
退職給付引当金		1,424		1,448
賞与引当金		437		565
役員賞与引当金		16		56
繰延税金負債		-		295
その他		181		251
固定負債合計		2,059		2,617
負債合計		17,708		22,165
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		79,307		82,591
利益剰余金合計		79,307		82,591
自己株式		2,067		2,067
株主資本合計		99,823		103,107
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		2,056		4,523
繰延ヘッジ損益		488		1,155
評価・換算差額等合計		1,567		3,367
純資産合計		101,391		106,475
負債純資産合計		119,099		128,640

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)		第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		73,998		75,874
その他営業収益		3,479	1	3,714
営業収益合計		77,477		79,588
営業費用				
支払手数料		30,699		32,917
広告宣伝費		755		711
公告費		3		3
調査費		17,479		17,736
調査費		1,170		1,266
委託調査費		16,282		16,445
図書費		26		23

委託計算費	581	610
営業雑経費	948	881
通信費	139	135
印刷費	309	308
協会費	56	48
諸会費	16	11
その他	427	375
営業費用計	50,469	52,860
一般管理費		
給料	9,818	10,550
役員報酬	314	459
役員賞与引当金繰入額	234	273
給料・手当	6,544	6,791
賞与	147	277
賞与引当金繰入額	2,577	2,747
交際費	56	71
寄付金	24	22
旅費交通費	205	260
租税公課	433	389
不動産賃借料	938	906
退職給付費用	383	388
退職金	155	36
固定資産減価償却費	183	199
福利費	1,097	1,208
諸経費	4,291	4,661
一般管理費計	17,588	18,694
営業利益	9,420	8,033

(単位：百万円)

	第64期 (自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月 31日)		第65期 (自 2023年 4月 1日 至 2024年 3月 31日)	
営業外収益				
受取利息		107		4
受取配当金	2	9,255	2	4,946
有価証券評価益		-	3	1,113
金銭の信託運用益		-		399
時効成立分配金・償還金		1		2
その他		236		50
営業外収益合計		9,601		6,517
営業外費用				
支払利息		407		569
デリバティブ費用		389		3,494
有価証券償還損		6		-
時効成立後支払分配金・償還金		1		1
為替差損		342		165
その他		15		0
営業外費用合計		1,163		4,231
経常利益		17,858		10,319
特別利益				
投資有価証券売却益		427		815
訴訟損失引当金戻入額	4	4,481		-
特別利益合計		4,909		815

特別損失		
投資有価証券売却損	347	174
固定資産処分損	0	52
損害賠償損失	-	167
特別損失合計	347	394
税引前当期純利益	22,420	10,740
法人税、住民税及び事業税	1,340	2,415
法人税等調整額	3,252	51
法人税等合計	4,593	2,364
当期純利益	17,826	8,376

(3) 【株主資本等変動計算書】

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						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	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

第65期（自 2023年4月1日 至 2024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	79,307	79,307	2,067	99,823
当期変動額							

剰余金の配当				5,092	5,092		5,092
当期純利益				8,376	8,376		8,376
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	-	-	-	3,284	3,284	-	3,284
当期末残高	17,363	5,220	5,220	82,591	82,591	2,067	103,107

	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
当期変動額				
剰余金の配当				5,092
当期純利益				8,376
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	2,467	666	1,800	1,800
当期変動額合計	2,467	666	1,800	5,084
当期末残高	4,523	1,155	3,367	106,475

[注記事項]

（重要な会計方針）

項目	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
	1 資産の評価基準及び評価 方法	(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
2 固定資産の減価償却の方法	(2) 金銭の信託 時価法	
	(3) デリバティブ 時価法	
3 引当金の計上基準	(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。 建物 3年～15年 器具備品 3年～20年	
	(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。	
3 引当金の計上基準	(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。	
	(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。	

4 収益の計上基準	<p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <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あります。</p>

(重要な会計上の見積り)

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。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
該当事項はありません。

(貸借対照表関係)

第64期 (2023年3月31日)	第65期 (2024年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,437百万円</p> <p>器具備品 879百万円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,482百万円</p> <p>器具備品 920百万円</p>
<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託してあります。</p>	<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託してあります。</p>

<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産) 未収収益 263百万円</p> <p>(流動負債) 未払費用 1,778百万円</p> <p>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、「未収入金」に含めて表示しております。</p> <p>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448百万円（5百万豪ドル）を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。</p>	<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産) 未収収益 248百万円</p> <p>(流動負債) 未払費用 1,873百万円</p> <p>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。</p> <p>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493百万円（5百万豪ドル）を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。</p>
--	---

(損益計算書関係)

第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
-	1 営業収益合計には、成功報酬212百万円が含まれております。
2 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 9,241百万円	2 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 4,889百万円
-	3 有価証券評価益 保有している一部の有価証券の区分を、運用方針の変更のためその他有価証券から売買目的有価証券に振り替え、金銭の信託に移管したことに伴い、振替時の評価差額1,113百万円を営業外収益に計上しております。
4 訴訟損失引当金戻入額 原告との和解が成立したことにより、前事業年度に計上した訴訟損失引当金から、和解金を控除した額を計上しております。	-

(株主資本等変動計算書関係)

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

	新株予約権の目的となる株式の数(株)
--	--------------------

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	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	当事業年度末残高(百万円)
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	-	1,471,000	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

第65期(自 2023年4月1日 至 2024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(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)121,000株及び2017年度ストックオプション(1)346,000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
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
2024年5月29日 取締役会	普通株式	利益剰余金	11,183	57.60	2024年3月31日	2024年6月25日

(リース取引関係)

第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024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 899百万円	1年内 891百万円
1年超 3,425百万円	1年超 2,613百万円
合計 4,324百万円	合計 3,505百万円

(金融商品関係)

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、市場価格

のない株式等は、次表には含めておりません。

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券 その他有価証券 投資信託	6,238	18,045	-	24,283
資産計	6,238	18,045	-	24,283
デリバティブ取引(*1) 株式関連(*2) 通貨関連(*3)	246 - -	- 352 -	- - -	246 352 -
デリバティブ取引計	246	352	-	599

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

(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

株価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

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については金銭の信託及び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、適時に資金繰り予定表を作成・更新するとともに、手許流動性（最低限必要な運転資金）を状況に応じて見直し・維持すること等により、流動性リスクを管理しております。

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託 有価証券	-	3,899	-	3,899

その他有価証券 投資信託	7,785	18,141	-	25,927
資産計	7,785	22,041	-	29,827
デリバティブ取引(*1)				
株式関連 (*2)	309	-	-	309
通貨関連 (*3)	-	367	-	367
デリバティブ取引計	309	367	-	677

(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 309百万円は、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 367百万円は、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

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、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。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

株価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	2,540
子会社株式	19,011
関連会社株式	18,635

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	31,198			
未収委託者報酬	21,592			
未収収益	647			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	1	169	2,483	-
合計	53,440	169	2,483	-

(有価証券関係)

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

第65期(自 2023年4月1日 至 2024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	19,011
関連会社株式	18,635

(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	24,313	17,701	6,611
	小計	24,313	17,701	6,611
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	1,613	1,769	156
	小計	1,613	1,769	156
合計		25,927	19,471	6,455

(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2,540百万円）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	8,145	1,057	167
合計	8,145	1,057	167

4 保有目的を変更した有価証券

注記事項「（損益計算書関係） 3 有価証券評価益」をご参照ください。

（金銭の信託関係）

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。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	当事業年度の損益に含まれた 評価差額
運用目的の金銭の信託	3,899	399

（デリバティブ取引関係）

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 米ドル 豪ドル 香港ドル 人民元 ユーロ	投資有価証券	6,132	-	280
			105	-	0
			699	-	34
			5,822	-	1
			234	-	10
			合計	12,994	-

(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65期(2024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	15,077	-	309	309
合計	15,077	-	309	309

(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

該当事項はありません。

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		6,465	-	268
	豪ドル		84	-	2
	香港ドル		542	-	17
	人民元		2,979	-	17
	ユーロ		2,172	-	60
	合計		12,243	-	367

(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64期 (自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日)	第65期 (自 2023年 4月 1日 至 2024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 5,326	(1) 関連会社に対する投資の金額 5,342
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 16,722	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 17,691
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,185	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,474

(退職給付関係)

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。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024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	1,366
勤務費用	134
利息費用	8
数理計算上の差異の発生額	9
退職給付の支払額	110
退職給付債務の期末残高	1,407

(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	1,407
未積立退職給付債務	1,407
未認識数理計算上の差異	40
貸借対照表に計上された負債の額	1,448
退職給付引当金	1,448
貸借対照表に計上された負債の額	1,448

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	134
利息費用	8
数理計算上の差異の費用処理額	7
確定給付制度に係る退職給付費用	134

(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 0.7%

3 確定拠出制度
 当社の確定拠出制度への要拠出額は、253百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2016年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名
株式の種類別のストックオプション の付与数 (注)	普通株式 4,437,000株	普通株式 4,409,000株
付与日	2016年7月15日	2017年4月27日

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

	2016年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2016年7月15日	2017年4月27日
権利確定前(株)		
期首	88,000	816,000
付与	0	0
失効	88,000	599,000
権利確定	0	0
権利未確定残	-	217,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2018年4月27日

権利確定前(株)	
期首	1,536,000
付与	0
失効	784,000
権利確定	0
権利未確定残	752,000
権利確定後(株)	
期首	-
権利確定	-
権利行使	-
失効	-
権利未行使残	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

第65期(自 2023年4月1日 至 2024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(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 4,409,000株	普通株式 4,422,000株
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定条件	2019年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

	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	217,000	752,000
付与	0	0
失効	96,000	406,000
権利確定	0	0
権利未確定残	121,000	346,000
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(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利行使価格(円)	553	694
付与日における公正な評価単価 (円) (注) 1	0	0

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

2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 104百万円

(税効果会計関係)

第64期 (2023年3月31日)	第65期 (2024年3月31日)

1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳
(単位：百万円)	(単位：百万円)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 918	賞与引当金 975
投資有価証券評価損 97	投資有価証券評価損 8
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 436	退職給付引当金 443
固定資産減価償却費 83	固定資産減価償却費 80
繰延ヘッジ損益 215	繰延ヘッジ損益 510
その他 672	その他 679
繰延税金資産小計 2,478	繰延税金資産小計 2,750
評価性引当金 52	評価性引当金 52
繰延税金資産合計 2,425	繰延税金資産合計 2,697
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 2,044
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 2,992
繰延税金資産の純額 448	繰延税金負債の純額 295
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 1.0%	交際費等永久に損金に算入されない項目 1.2%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 12.0%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 10.9%
その他 0.8%	その他 1.1%
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 22.0%

(関連当事者情報)

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

1. 融資枠55百万シンガポールドル、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
2. 融資枠5,300百万円（若しくは5,300百万円相当額の外国通貨）、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定してあります（決定方針等を2022年8月26日付にて上記1に変更しております）。
3. Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は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

第65期(自 2023年4月1日 至 2024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	-	資金の返済(シンガポールドル貸建)(注1)	3,318 (SGD 33,000千)	関係会社短期貸付金	-
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	22 (SGD 223千)	未収収益	-
							関係会社株式の取得(注2)	13,412	-	-
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	2,950 (USD 20,000千)	-	-
子会社	Nikko AM Global Holdings Limited	英国	3,378	アセットマネジメント業	直接100.00	-	増資の引受(注4)	1,828	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

1. 融資枠55百万シンガポールドル、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
2. Nikko Asset Management International Limitedが保有する関連会社AHAM Asset Management 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。
3. Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。
4. Nikko AM Global Holdings Limitedの行った1,828,000,000株の新株発行増資を、1株につき1円で当社が引受けたものであります。

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2023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	41,322百万円
負債合計	8,314百万円
純資産合計	33,008百万円

営業収益	18,682百万円
税引前当期純利益	6,005百万円
当期純利益	4,538百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

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

関連情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第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。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024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。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024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。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
該当事項はありません。

(収益認識関係)

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。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024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64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	522円22銭	548円41銭
1株当たり当期純利益金額	91円81銭	43円14銭

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益(百万円)	17,826	8,376
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）	17,826	8,376
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（2）217,000株、2017年度ストックオプション（1）752,000株	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64期 (2023年3月31日)	第65期 (2024年3月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	101,391	106,475
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）	101,391	106,475
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）
該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2024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 (2024年3月末現在)	事業の内容
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	

株式会社SBI証券	54,323百万円	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。
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	13,195百万円	
moomoo証券株式会社	3,500百万円 (2023年12月末現在)	
楽天証券株式会社	19,495百万円	
株式会社千葉銀行	145,069百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
PayPay銀行株式会社	72,216百万円	

2【関係業務の概要】

- (1) 受託会社
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。
- (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、短期間で解約資金の手当てをする必要が生じた場合や、主たる取引市場において市場が急変した場合などに、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがある旨。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金

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

独立監査人の監査報告書

2024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2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

する注記事項の妥当性を評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年4月17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Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）の2023年2月10日から2024年2月7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、Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）の2024年2月7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を検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうかを注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1.上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2.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

2024年9月18日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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

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Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）の2024年2月8日から2024年8月7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、Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）の2024年8月7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（2024年2月8日から2024年8月7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。