【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2025年1月28日提出
【計算期間】	第23期(自　2023年10月27日至　2024年10月28日)
【ファンド名】	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 ステファニー・ドゥルーズ
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目７番１号
【事務連絡者氏名】	新屋敷　昇
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目７番１号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① ファンドの目的
４つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

② ファンドの基本的性格

１）商品分類

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

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

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

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

２）属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年１回	グローバル （含む日本）		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　）	年２回 年４回 年６回 （隔月） 年 12回 （毎月） 日々	日本 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　資産配分固定型（株式、債券）））		中近東 （中東）		
資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。
◇その他資産（投資信託証券（資産複合　資産配分固定型（株式、債券））
当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式および債券に投資を行ないます。よって、商品分類の「投資対象資産（収益の源泉）」においては、「資産複合」に分類されます。
「資産配分固定型」とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。
◇年１回
目論見書または投資信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいいます。
◇グローバル（含む日本）
目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
◇ファミリーファンド
目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
◇為替ヘッジあり（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。

③　ファンドの特色

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

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

2. インデックスファンドで構成しています。

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

<国内株式>

「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
主としてわが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）配当込みの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<海外株式>

「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」
主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジあり・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。

<国内債券>

「日本債券インデックスマザーファンド」
主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<海外債券>

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

「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」
主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・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。

著作権などについて

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

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

※NOMURA-BPI総合：同指数は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社（以下「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（除く日本）：同指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

3. 株式に80%、債券などに20%投資します。

資産の標準実質組入比率は、株式80%、債券など20%とします。
組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンドへの投資比率を調整することで行ないます。
各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

投　資　対　象	基本投資比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	60%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	10%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	10%
日本債券インデックスマザーファンド	5%
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	5%
海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	5%
短期金融資産	5%

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。
※基本投資比率からカイ離した場合は、一定のルールに従い基本投資比率になるように調整を行ないます。

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

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は、信託財産の総額の50%以下とします。

分配方針

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

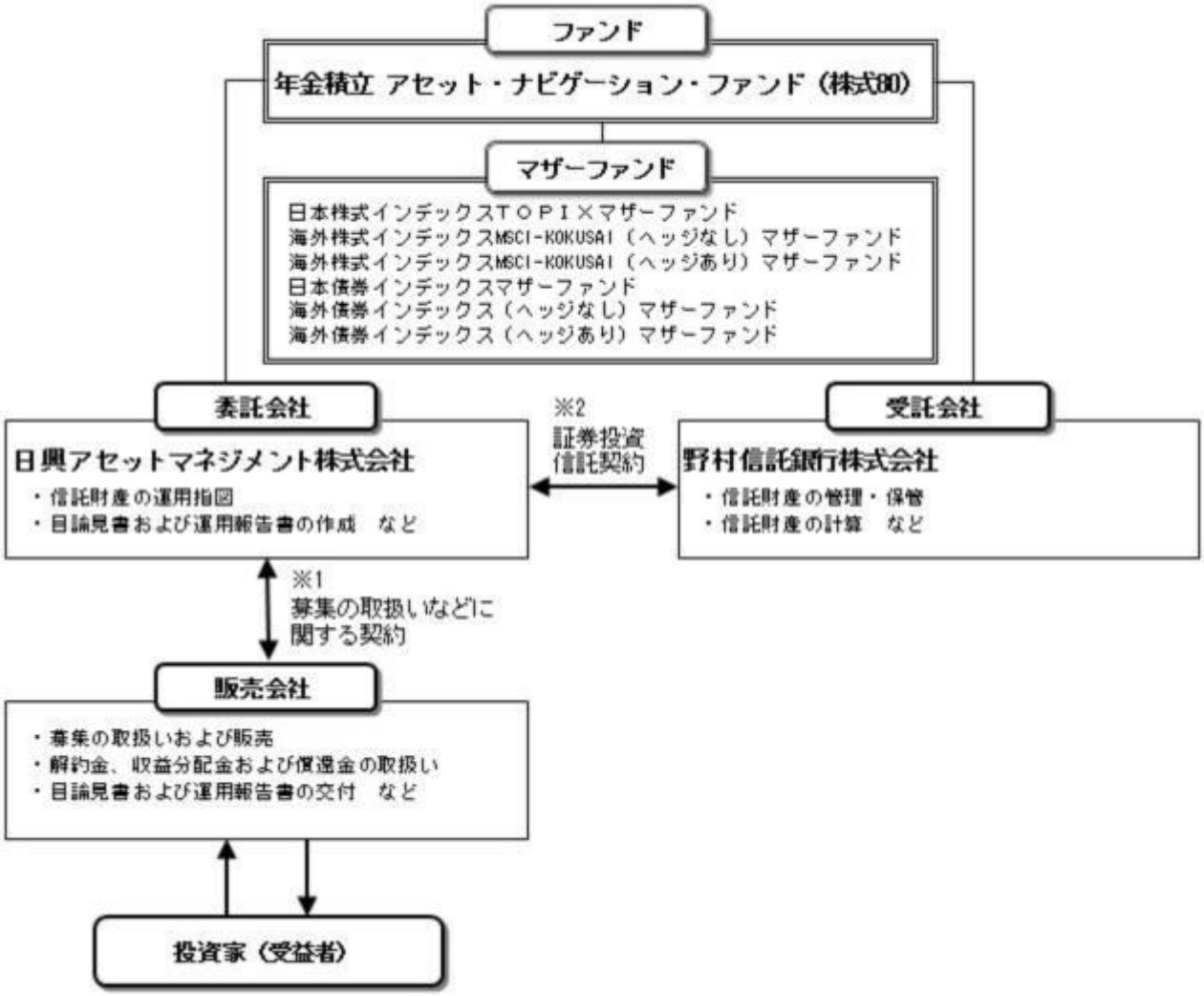
④　信託金限度額
・1兆円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

（2）【ファンドの沿革】

2001年10月17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】

① 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。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。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。

② 委託会社の概況（2024年10月末現在）

1）資本金
17,363百万円

2）沿革
1959年：日興證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
三井住友トラストグループ株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目４番１号	192,211,000株	97.562%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

・主として、以下に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。
証券投資信託「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」
証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」
証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」
・純資産総額に対する株式ならびに公社債および短期金融資産の実質組入比率については、次の標準実質組入比率を目処として投資を行ないます。
株式の標準実質組入比率……80%
公社債および短期金融資産の標準実質組入比率……20%

・組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないますが、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。
・また、資金動向などによっては組入比率を引き下げることもあります。
・株式以外の資産への実質投資割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした割合を含みます。）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、ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

＜年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）＞
以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。
証券投資信託 「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」
証券投資信託 「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
証券投資信託 「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」
証券投資信託 「日本債券インデックスマザーファンド」
証券投資信託 「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
証券投資信託 「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」

① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）有価証券
２）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。）
３）金銭債権
４）約束手形
５）為替手形

② 主として次のマザーファンドの受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
１）証券投資信託「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」受益証券
２）証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券
３）証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」受益証券
４）証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券
５）証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券
６）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」受益証券
７）株券または新株引受権証書
８）国債証券
９）地方債証券
10）特別の法律により法人の発行する債券
11）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。）
12）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。）
13）コマーシャル・ペーパー
14）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
15）外国または外国の者の発行する証券または証書で、７）～14）の証券または証書の性質を有するもの
16）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。）
17）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18）に定めるもの以外のもの
18）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
19）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。）
20）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。）
21）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。）
22）外国法人が発行する譲渡性預金証書
23）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。）
24）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
25）外国の者に対する権利で24）の有価証券の性質を有するもの

③ 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

④ 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。

① 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

② 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

③ 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

④ 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。

① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）有価証券
２）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。）
３）金銭債権
４）約束手形
５）為替手形

② 主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
１）外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
２）国債証券
３）地方債証券
４）特別の法律により法人の発行する債券
５）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
６）特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
７）コマーシャル・ペーパー

８）外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
９）外国または外国の者の発行する証券で、２）～７）の証券の性質を有するもの
10）投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
11）投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12）に定めるもの以外のもの
12）投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
13）外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
14）オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
15）預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
16）外国法人が発行する譲渡性預金証書
17）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
18）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
19）外国の者に対する権利で18）の有価証券の性質を有するもの

③　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

④　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

＜海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）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。

①　投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）有価証券
２）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。）
３）金銭債権
４）約束手形
５）為替手形

②　主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
１）外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
２）国債証券
３）地方債証券
４）特別の法律により法人の発行する債券
５）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
６）特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
７）コマーシャル・ペーパー
８）外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
９）外国または外国の者の発行する証券で、２）～７）の証券の性質を有するもの
10）投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
11）投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12）に定めるもの以外のもの
12）投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
13）外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
14）オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
15）預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
16）外国法人が発行する譲渡性預金証書
17）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
18）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

19）外国の者に対する権利で18）の有価証券の性質を有するもの
③　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
④　次の取引ができます。
1）信用取引
2）先物取引等
3）スワップ取引
4）金利先渡取引
5）為替先渡取引
6）有価証券の貸付
7）公社債の空売
8）公社債の借入
9）外国為替予約取引

＜日本債券インデックスマザーファンド＞
わが国の公社債を主要投資対象とします。
①　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
②　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
③　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
④　次の取引ができます。
1）先物取引等
2）スワップ取引
3）金利先渡取引
4）有価証券の貸付
5）公社債の空売
6）公社債の借入

＜海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞
内外の公社債を主要投資対象とします。
①　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
②　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
③　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
④　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

＜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。
①　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
②　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
③　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

④　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	・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	・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ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などＴＯＰＩＸに関するすべての権利・ノウハウおよびＴＯＰＩＸに係る標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有します。ＪＰＸは、ＴＯＰＩＸの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負いません。

＜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	・主として日本を除く世界各国の株式（ＤＲ（預託証券）およびカントリーファンド等を含みます。）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	・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。

＜海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（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	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	・主として日本を除く世界各国の株式（ＤＲ（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジあり・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、株価指数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、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、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額の合計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	・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。

＜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	・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	・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社

	受託会社	野村信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
	決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

＜海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞

運用の基本方針		
	基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）＊の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
	主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
	投資方針	・主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・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。

＜海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド＞

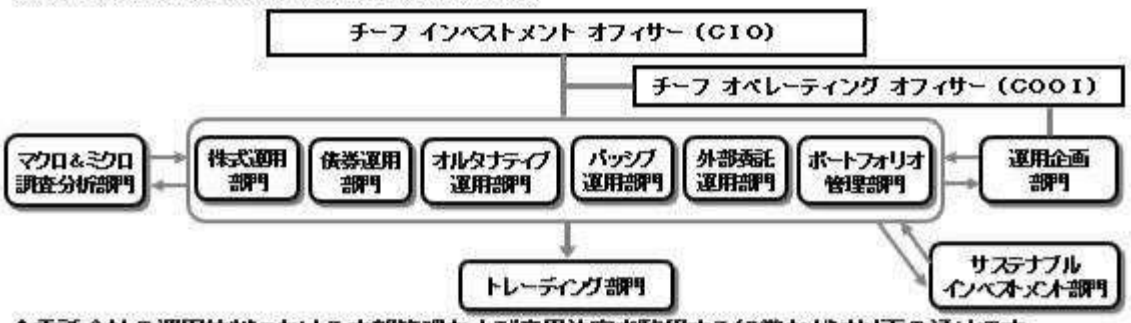
運用の基本方針		
	基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）＊の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

	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	・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	・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）

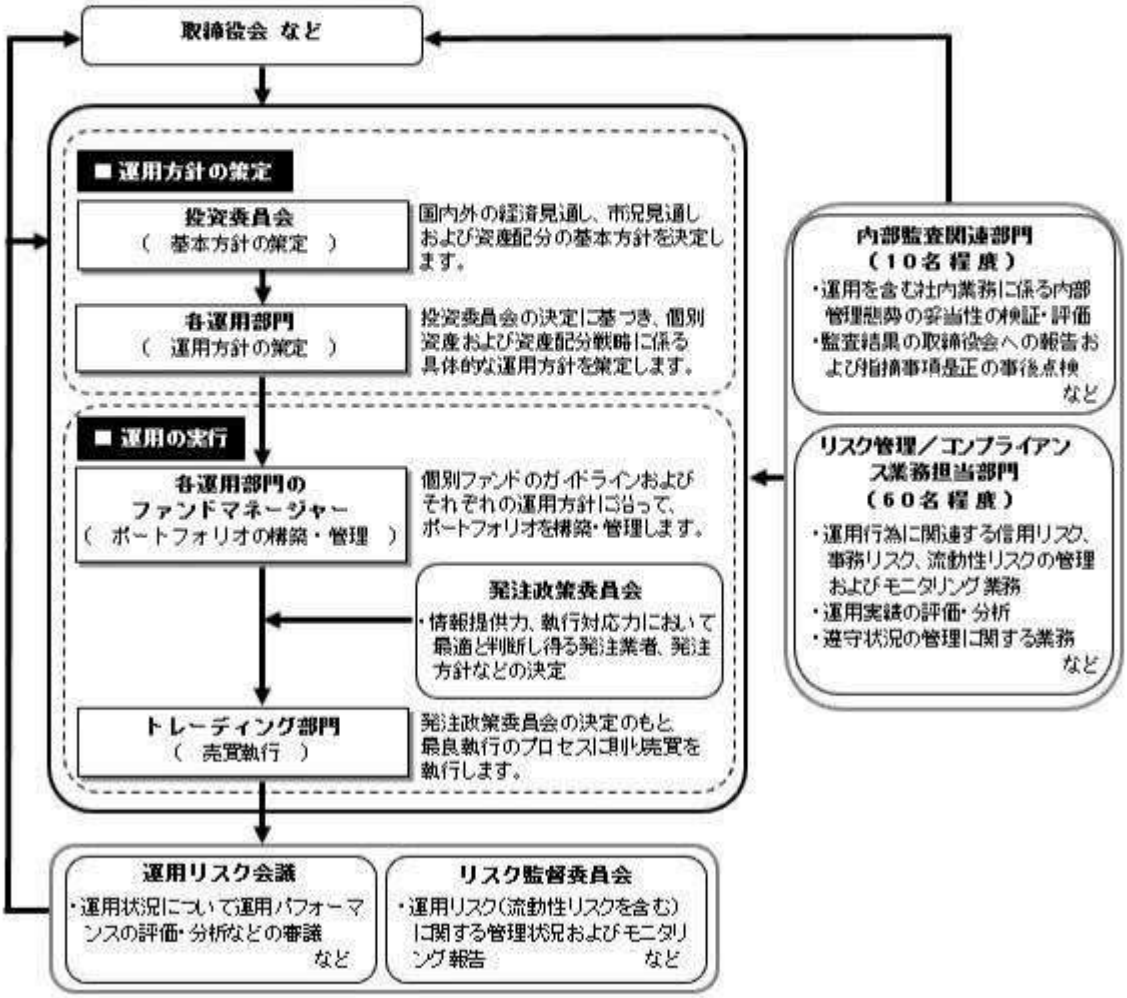
＊FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

（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。

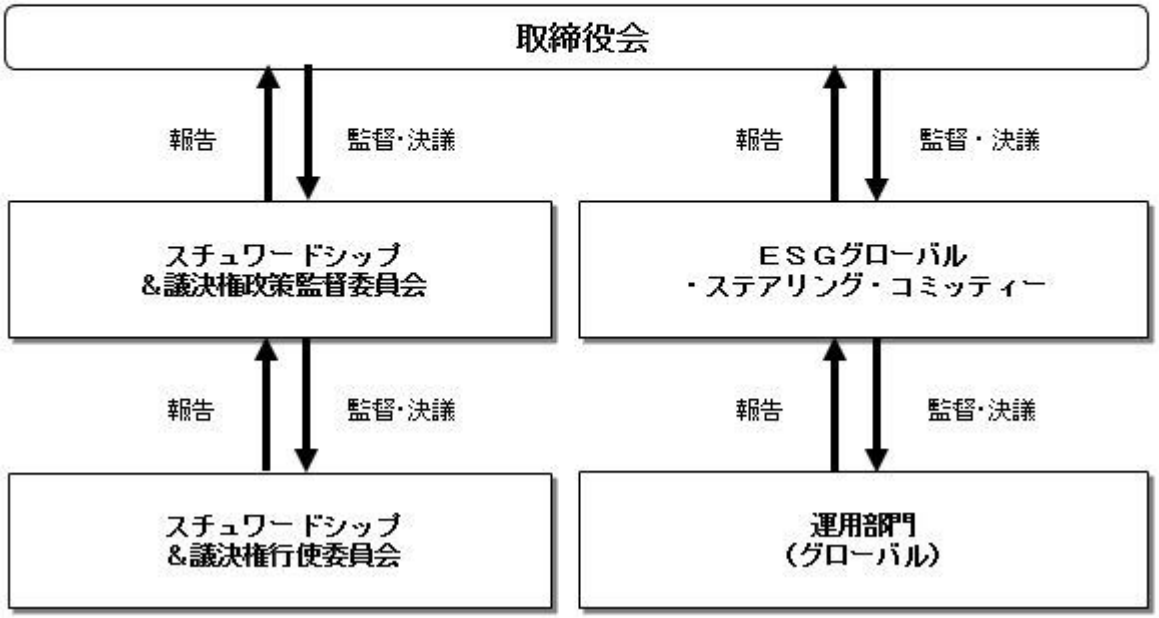


委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっております。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なっており、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・デューティー

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10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】

① 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なわないこともあります。
３）留保益の運用方針
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
② 収益分配金の支払い
原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

（５）【投資制限】

① 約款に定める投資制限
＜年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）＞
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。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
３）投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の５％以下とします。
４）外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50％以下とします。
５）信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
６）わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
７）わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
８）わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

９）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

10）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

11）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

イ）株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

ロ）公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

12）信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

13）信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

14）信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

15）信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴なう支払資金の手当て（解約に伴なう支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。

イ）解約に伴なう支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内

ロ）再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内

ハ）借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

ニ）解約に伴なう支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とします。

ホ）再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。

16）デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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

＜日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド＞

１）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。

２）投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

３）外貨建資産への投資は行ないません。

４）信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

５）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

６）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

７）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

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

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

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

＜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ます。
4）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的の

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

② 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ないます。お申込みの際は、当ファンドのリスクを充分に認識・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、主に株式および債券を実質的な投資対象としますので、株式および債券の価格の下落や、株式および債券の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 価格変動リスク
・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

② 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。

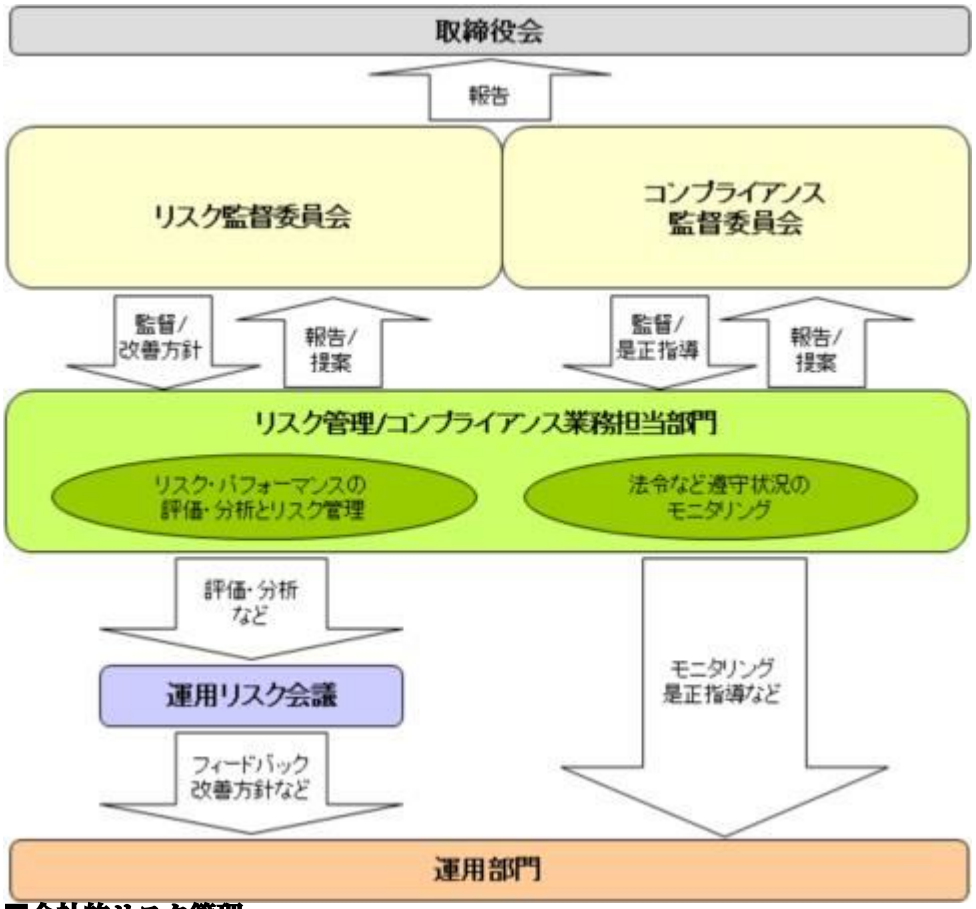
③ 信用リスク
・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れが生じた場合や廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。

・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

④　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。
・「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）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」は原則として為替ヘッジを行ないますが、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、為替ヘッジに伴なうヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。

＜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・設定などに伴な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な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10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	11.1%	14.5%	21.3%	11.4%	-1.5%	5.2%	6.7%
最大値	33.8%	42.1%	59.8%	62.7%	2.9%	15.3%	21.5%
最小値	-7.2%	-9.5%	-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11月から2024年10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して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。

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2019年11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して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。

<各資産クラスの指数>

日本株……TOPIX(東証株価指数)配当込み
先進国株…MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)
新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
日本国債…NOMURA-BPI国債
先進国債…FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ヘッジなし、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。
※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ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社に帰属します。

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc. に帰属します。

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

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

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし、円ベース）
当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社の照会先にお問い合わせください。
・販売会社における申込手数料率は1.1%（税抜１%）が上限となっております。
・申込手数料の額（１口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
・収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
※申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

（２）【換金（解約）手数料】

① 換金手数料
ありません。
② 信託財産留保額
解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額（１口当たり）が差し引かれます。
※「信託財産留保額」とは、投資信託を解約される受益者の解約代金から差し引いて、信託財産に繰り入れる金額のことです。

（３）【信託報酬等】

① 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0.836%（税抜0.76%）の率を乗じて得た額とします。
② 信託報酬の配分
信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.76%	0.21%	0.50%	0.05%

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

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。
③ 支払時期
信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

（４）【その他の手数料等】

信託財産に関する以下の費用およびそれに付随する消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払います。
① 組入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。
② 信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。
③ 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、解約に伴な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＞
・組入有価証券の売買時の売買委託手数料
・信託事務の処理に要する諸費用
・信託財産に関する租税　など

※監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。
＊監査費用、売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、あらかじめ見積もることができないため、表示することができません。

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

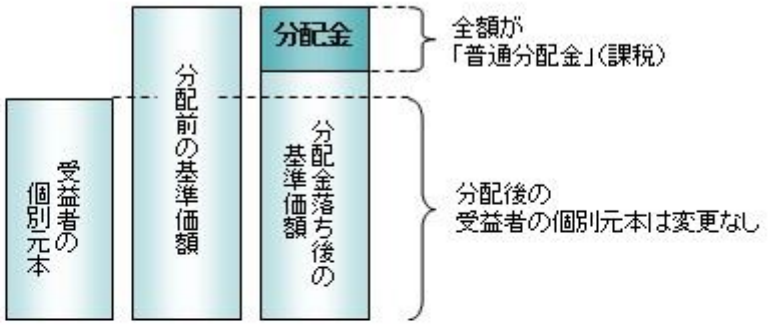
（５）【課税上の取扱い】

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

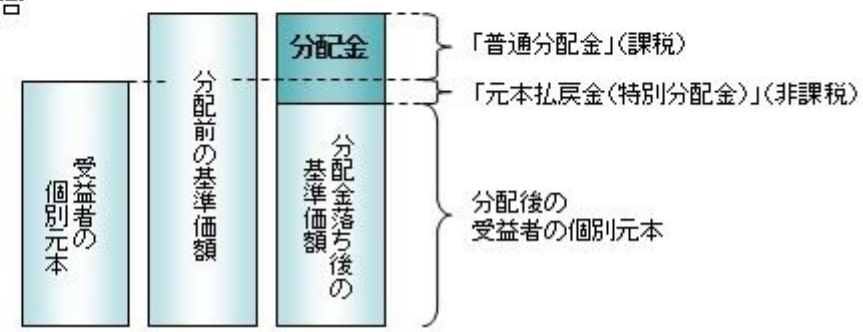
≪確定拠出年金の場合≫
確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会の場合、所得税および地方税はかかりません。
なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。
≪確定拠出年金でない場合≫
①　個人受益者の場合
１）収益分配金に対する課税
収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります。）のいずれかを選択することもできます。
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ます。）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ます。）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。
②　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。
③　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。
④　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2025年1月28日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

（参考情報）ファンドの総経費率

対象期間:2023年10月27日～2024年10月28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
0.84%	0.83%	0.01%

※対象期間の運用管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。
※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。
※運用管理費用の内訳等の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

【年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）】

以下の運用状況は2024年10月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	4,310,678,719	95.16
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	219,163,357	4.84
合計（純資産総額）		4,529,842,076	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド	966,895,833	2.7840	2,691,838,000	2.8237	2,730,223,763	60.27
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	66,347,225	6.9568	461,564,375	6.9588	461,697,069	10.19
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド	153,284,688	2.9400	450,656,983	2.9355	449,967,201	9.93
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	74,493,000	3.0537	227,479,275	3.0526	227,397,331	5.02
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	168,542,177	1.3157	221,751,026	1.3185	222,222,860	4.91
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	167,908,140	1.3093	219,857,140	1.3053	219,170,495	4.84

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.16
合　　計	95.16

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【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14計算期間末　(2015年10月26日)	2,522	2,523	1.7304	1.7314
第15計算期間末　(2016年10月26日)	2,390	2,392	1.6046	1.6056
第16計算期間末　(2017年10月26日)	2,827	2,829	1.9562	1.9572
第17計算期間末　(2018年10月26日)	2,688	2,689	1.8602	1.8612
第18計算期間末　(2019年10月28日)	2,897	2,899	1.9719	1.9729
第19計算期間末　(2020年10月26日)	2,872	2,873	2.0209	2.0219
第20計算期間末　(2021年10月26日)	3,353	3,354	2.4806	2.4816
第21計算期間末　(2022年10月26日)	3,297	3,299	2.3837	2.3847
第22計算期間末　(2023年10月26日)	3,681	3,681	2.6627	2.6627
第23計算期間末　(2024年10月28日)	4,506	4,506	3.1994	3.1994
2023年10月末日	3,716	—	2.6797	—
11月末日	3,896	—	2.8191	—
12月末日	3,888	—	2.8361	—
2024年 1月末日	4,126	—	2.9896	—
2月末日	4,298	—	3.0993	—
3月末日	4,444	—	3.2065	—
4月末日	4,419	—	3.1813	—

5月末日	4,493	—	3.2122	—
6月末日	4,582	—	3.2752	—
7月末日	4,537	—	3.2365	—
8月末日	4,492	—	3.1847	—
9月末日	4,474	—	3.1643	—
10月末日	4,529	—	3.2259	—

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第14期	2014年10月28日～2015年10月26日	0.0010
第15期	2015年10月27日～2016年10月26日	0.0010
第16期	2016年10月27日～2017年10月26日	0.0010
第17期	2017年10月27日～2018年10月26日	0.0010
第18期	2018年10月27日～2019年10月28日	0.0010
第19期	2019年10月29日～2020年10月26日	0.0010
第20期	2020年10月27日～2021年10月26日	0.0010
第21期	2021年10月27日～2022年10月26日	0.0010
第22期	2022年10月27日～2023年10月26日	0.0000
第23期	2023年10月27日～2024年10月28日	0.0000

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第14期	2014年10月28日～2015年10月26日	18.24
第15期	2015年10月27日～2016年10月26日	△7.21
第16期	2016年10月27日～2017年10月26日	21.97
第17期	2017年10月27日～2018年10月26日	△4.86
第18期	2018年10月27日～2019年10月28日	6.06
第19期	2019年10月29日～2020年10月26日	2.54
第20期	2020年10月27日～2021年10月26日	22.80
第21期	2021年10月27日～2022年10月26日	△3.87
第22期	2022年10月27日～2023年10月26日	11.70
第23期	2023年10月27日～2024年10月28日	20.16

(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14期	2014年10月28日～2015年10月26日	252,136,652	280,292,717
第15期	2015年10月27日～2016年10月26日	167,302,143	134,892,000
第16期	2016年10月27日～2017年10月26日	192,729,809	236,965,185
第17期	2017年10月27日～2018年10月26日	205,679,708	206,091,581
第18期	2018年10月27日～2019年10月28日	177,399,102	153,210,855
第19期	2019年10月29日～2020年10月26日	200,492,596	248,535,646

第20期	2020年10月27日～2021年10月26日	205,104,086	274,700,939
第21期	2021年10月27日～2022年10月26日	235,557,729	203,925,995
第22期	2022年10月27日～2023年10月26日	164,337,374	164,967,633
第23期	2023年10月27日～2024年10月28日	197,173,252	171,364,036

（参考）

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

以下の運用状況は2024年10月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	61,138,024,180	98.48
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	944,980,323	1.52
合計（純資産総額）		62,083,004,503	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	943,075,000	1.52

(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。

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	841,100	2,707.00	2,276,857,700	2,682.50	2,256,250,750	3.63
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	1,022,000	1,565.73	1,600,181,860	1,628.50	1,664,327,000	2.68
日本	株式	日立製作所	電気機器	411,500	4,030.27	1,658,457,950	3,924.00	1,614,726,000	2.60
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	554,100	2,698.00	1,494,961,800	2,723.50	1,509,091,350	2.43
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	126,900	9,234.20	1,171,820,520	9,533.00	1,209,737,700	1.95
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,800	66,350.00	1,048,330,000	69,780.00	1,102,524,000	1.78
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	325,100	3,160.00	1,027,316,000	3,273.00	1,064,052,300	1.71
日本	株式	三菱商事	卸売業	321,400	2,805.00	901,527,000	2,835.50	911,329,700	1.47
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	112,500	7,539.00	848,137,500	7,653.00	860,962,500	1.39
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	152,200	5,521.00	840,296,200	5,568.00	847,449,600	1.37
日本	株式	信越化学工業	化学	142,100	5,593.00	794,765,300	5,755.00	817,785,500	1.32
日本	株式	任天堂	その他製品	99,900	8,160.00	815,184,000	8,145.00	813,685,500	1.31
日本	株式	三井物産	卸売業	250,800	3,152.00	790,521,600	3,162.00	793,029,600	1.28
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	33,500	23,860.00	799,310,000	23,400.00	783,900,000	1.26
日本	株式	第一三共	医薬品	149,800	4,895.67	733,371,940	4,981.00	746,153,800	1.20
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	78,300	9,009.00	705,404,700	9,498.00	743,693,400	1.20
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4,720,700	146.80	692,998,760	147.70	697,247,390	1.12

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	210,300	3,115.00	655,084,500	3,212.00	675,483,600	1.09
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	31,200	20,100.00	627,120,000	20,725.00	646,620,000	1.04
日本	株式	三菱重工業	機械	279,500	2,082.00	581,919,000	2,193.00	612,943,500	0.99
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	141,200	4,133.00	583,579,600	4,264.00	602,076,800	0.97
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	374,900	1,582.00	593,091,800	1,557.50	583,906,750	0.94
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	116,700	4,764.00	555,958,800	4,778.00	557,592,600	0.90
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,539,200	188.20	477,877,440	192.80	489,557,760	0.79
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	9,400	50,430.00	474,042,000	49,520.00	465,488,000	0.75
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	49,900	8,212.52	409,804,758	9,148.00	456,485,200	0.74
日本	株式	富士通	電気機器	147,100	2,971.00	437,034,100	2,963.00	435,857,300	0.70
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	184,900	2,275.55	420,750,422	2,199.00	406,595,100	0.65
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	94,700	4,133.00	391,395,100	4,281.00	405,410,700	0.65
日本	株式	キヤノン	電気機器	78,900	5,046.00	398,129,400	5,004.00	394,815,600	0.64

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.26
		建設業	2.08
		食料品	3.18
		繊維製品	0.39
		パルプ・紙	0.14
		化学	5.51
		医薬品	4.78
		石油・石炭製品	0.54
		ゴム製品	0.57
		ガラス・土石製品	0.66
		鉄鋼	0.82
		非鉄金属	0.78
		金属製品	0.50
		機械	5.55
		電気機器	17.33
		輸送用機器	7.24
		精密機器	2.51
		その他製品	2.47
		電気・ガス業	1.38
		陸運業	2.28
		海運業	0.67
		空運業	0.35
		倉庫・運輸関連業	0.15
		情報・通信業	7.42
		卸売業	6.93
		小売業	4.36

		銀行業	7.67
		証券、商品先物取引業	0.80
		保険業	3.11
		その他金融業	1.19
		不動産業	1.84
		サービス業	4.93
合　　計			98.48

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１２月	買建	35	日本円	933,434,000	943,075,000	1.52

(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。

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10月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	326,390,973,269	72.10
	カナダ	14,674,702,032	3.24
	ドイツ	10,383,316,526	2.29
	イタリア	2,482,938,504	0.55
	フランス	11,746,676,142	2.59
	オランダ	7,380,187,993	1.63
	スペイン	3,120,049,953	0.69
	ベルギー	923,717,323	0.20
	オーストリア	209,554,514	0.05
	ルクセンブルク	174,185,898	0.04
	フィンランド	1,136,636,228	0.25
	アイルランド	8,874,757,180	1.96
	ポルトガル	155,024,363	0.03
	イギリス	15,954,692,937	3.52
	スイス	12,570,455,295	2.78
	スウェーデン	3,684,386,044	0.81
	ノルウェー	664,509,628	0.15
	デンマーク	3,843,783,882	0.85
	ケイマン	604,785,624	0.13
	オーストラリア	7,817,085,957	1.73
	バミューダ	445,811,419	0.10

	ニュージーランド	270,290,637	0.06
	香港	1,859,660,842	0.41
	シンガポール	1,266,713,400	0.28
	イスラエル	941,430,260	0.21
	ジャージー	679,064,528	0.15
	アラブ首長国連邦	0	0.00
	マン島	38,332,367	0.01
	小計	438,293,722,745	96.82
新株予約権証券	カナダ	0	0.00
投資証券	アメリカ	7,706,995,832	1.70
	カナダ	14,586,499	0.00
	フランス	153,744,765	0.03
	ベルギー	28,534,539	0.01
	イギリス	139,045,168	0.03
	オーストラリア	547,363,751	0.12
	香港	75,368,301	0.02
	シンガポール	95,096,707	0.02
	小計	8,760,735,562	1.94
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	5,628,014,294	1.24
合計（純資産総額）		452,682,472,601	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,720,281,720	1.04
	買建	ドイツ	766,616,203	0.17

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	4,724,321,420	1.04
	売建	—	26,663,606	△0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,086,420	21,746.20	23,625,512,688	21,407.42	23,257,459,449	5.14
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	643,644	35,553.83	22,884,010,901	35,352.56	22,754,465,703	5.03
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	311,884	65,780.96	20,516,030,800	66,453.90	20,725,911,017	4.58
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	413,920	28,858.20	11,944,986,641	29,611.03	12,256,600,518	2.71

アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	96,790	88,074.13	8,524,695,043	90,924.15	8,800,548,672	1.94
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	259,790	25,392.08	6,596,609,191	26,804.03	6,963,420,097	1.54
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	223,110	25,656.34	5,724,186,820	27,062.14	6,037,836,197	1.33
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	195,160	26,579.71	5,187,298,155	27,138.96	5,296,441,307	1.17
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	126,915	41,358.35	5,248,995,194	39,569.98	5,022,024,266	1.11
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	35,659	137,154.42	4,890,789,748	130,106.96	4,639,484,129	1.02
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	126,780	34,155.70	4,330,260,711	34,478.35	4,371,165,517	0.97
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	58,535	69,754.09	4,083,056,032	69,900.05	4,091,599,684	0.90
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	198,509	18,358.44	3,644,316,281	17,928.25	3,558,919,297	0.79
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	40,650	86,738.99	3,525,940,285	86,493.17	3,515,947,539	0.78
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	69,752	43,284.99	3,019,215,125	44,580.18	3,109,556,883	0.69
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	36,610	77,950.79	2,853,778,437	78,923.33	2,889,383,170	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	104,529	25,845.32	2,701,585,538	25,528.82	2,668,502,277	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	43,925	61,288.53	2,692,098,785	60,306.77	2,648,974,995	0.59
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	19,584	136,927.04	2,681,579,167	135,063.38	2,645,081,383	0.58
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	106,491	24,717.60	2,632,202,283	24,676.12	2,627,784,738	0.58
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	142,520	17,529.10	2,498,248,045	17,243.02	2,457,475,923	0.54
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	195,256	12,676.83	2,475,228,368	12,504.75	2,441,629,340	0.54
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	77,866	28,861.27	2,247,311,961	30,958.45	2,410,611,446	0.53
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	19,065	115,949.03	2,210,568,356	115,804.61	2,207,814,958	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	311,349	6,435.97	2,003,835,813	6,500.50	2,023,926,790	0.45
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	72,973	26,659.61	1,945,431,924	26,819.39	1,957,091,959	0.43
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	42,956	44,626.27	1,916,966,244	45,538.89	1,956,168,817	0.43
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	17,697	110,725.39	1,959,507,280	105,706.82	1,870,693,594	0.41
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	180,712	10,281.58	1,858,006,476	10,127.94	1,830,241,884	0.40

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	112,083	15,975.48	1,790,580,532	16,106.08	1,805,217,899	0.40

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	4.06
		素材	3.51
		資本財	6.99
		商業・専門サービス	1.58
		運輸	1.55
		自動車・自動車部品	1.68
		耐久消費財・アパレル	1.21
		消費者サービス	1.93
		メディア・娯楽	6.56
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.78
		生活必需品流通・小売り	1.73
		食品・飲料・タバコ	2.99
		家庭用品・パーソナル用品	1.49
		ヘルスケア機器・サービス	3.92
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.40
		銀行	5.60
		金融サービス	6.92
		保険	3.06
		ソフトウェア・サービス	9.85
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.55
		電気通信サービス	1.16
		公益事業	2.68
		半導体・半導体製造装置	9.31
		不動産管理・開発	0.29
新株予約権証券	—	—	—
投資証券	—	—	1.94
合　　計			98.76

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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 EMINI2412	買建	105	米ドル	30,712,750	4,718,706,910	30,723,000	4,720,281,720	1.04
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2412	買建	105	ユーロ	4,677,290	779,844,561	4,597,950	766,616,203	0.17

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	26,700,000.00	4,069,393,070	4,084,553,630	0.90
	ユーロ	買建	3,850,000.00	635,354,410	639,767,790	0.14
	加ドル	売建	119,000.00	13,132,483	13,132,756	△0.00
	英ポンド	売建	68,000.00	13,525,941	13,530,850	△0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド

以下の運用状況は2024年10月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	19,391,271,477	71.84
	カナダ	879,789,210	3.26
	ドイツ	615,132,128	2.28
	イタリア	147,660,240	0.55
	フランス	702,041,836	2.60
	オランダ	437,524,445	1.62
	スペイン	183,547,938	0.68
	ベルギー	46,369,827	0.17
	オーストリア	11,397,896	0.04
	ルクセンブルク	12,523,807	0.05
	フィンランド	63,268,885	0.23
	アイルランド	526,820,983	1.95
	ポルトガル	10,838,009	0.04
	イギリス	952,610,986	3.53
	スイス	743,044,889	2.75
	スウェーデン	214,289,751	0.79
	ノルウェー	41,555,290	0.15
	デンマーク	230,033,947	0.85
	ケイマン	35,661,191	0.13
	オーストラリア	465,364,817	1.72
	バミューダ	25,876,915	0.10
	ニュージーランド	14,429,564	0.05
	香港	105,628,700	0.39
	シンガポール	74,250,301	0.28
	イスラエル	51,962,950	0.19
	ジャージー	45,658,880	0.17
	マン島	2,554,976	0.01
	小計	26,031,109,838	96.45
新株予約権証券	カナダ	0	0.00

投資証券	アメリカ	470,365,456	1.74
	フランス	4,433,644	0.02
	イギリス	7,519,025	0.03
	オーストラリア	30,950,586	0.11
	香港	4,833,527	0.02
	シンガポール	8,872,088	0.03
	小計	526,974,326	1.95
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	432,416,411	1.60
合計（純資産総額）		26,990,500,575	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	404,595,576	1.50
	買建	ドイツ	65,709,960	0.24

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	—	26,944,827,943	△99.83

(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	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	64,600	21,746.20	1,404,804,882	21,407.42	1,382,919,939	5.12
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	38,260	35,553.83	1,360,289,628	35,352.56	1,352,589,099	5.01
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	18,550	65,780.96	1,220,236,920	66,453.90	1,232,720,016	4.57
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	24,620	28,858.20	710,488,914	29,611.03	729,023,736	2.70
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	5,760	88,074.13	507,306,989	90,924.15	523,723,116	1.94
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	15,420	25,392.08	391,545,916	26,804.03	413,318,210	1.53
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	13,330	25,656.34	341,999,060	27,062.14	360,738,454	1.34
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	11,610	26,579.71	308,590,549	27,138.96	315,083,437	1.17
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	7,560	41,358.35	312,669,138	39,569.98	299,149,064	1.11
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	2,120	137,154.42	290,767,388	130,106.96	275,826,758	1.02
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	7,500	34,155.70	256,167,813	34,478.35	258,587,643	0.96
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	3,470	69,754.09	242,046,715	69,900.05	242,553,189	0.90

アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	11,730	18,358.44	215,344,543	17,928.25	210,298,391	0.78
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	2,410	86,738.99	209,040,986	86,493.17	208,448,550	0.77
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	4,140	43,284.99	179,199,888	44,580.18	184,561,955	0.68
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	2,190	77,950.79	170,712,231	78,923.33	172,842,096	0.64
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	2,610	61,288.53	159,963,070	60,306.77	157,400,677	0.58
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	6,150	25,845.32	158,948,723	25,528.82	157,002,258	0.58
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	1,160	136,927.04	158,835,368	135,063.38	156,673,530	0.58
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	6,280	24,717.60	155,226,548	24,676.12	154,966,036	0.57
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	8,510	17,529.10	149,172,684	17,243.02	146,738,143	0.54
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	11,510	12,676.83	145,910,387	12,504.75	143,929,783	0.53
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	4,630	28,861.27	133,627,699	30,958.46	143,337,670	0.53
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	1,130	115,949.03	131,022,409	115,804.61	130,859,213	0.48
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	18,410	6,435.97	118,486,385	6,500.50	119,674,360	0.44
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	4,360	26,659.61	116,235,912	26,819.39	116,932,577	0.43
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	2,560	44,626.27	114,243,263	45,538.89	116,579,574	0.43
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	1,060	110,725.39	117,368,916	105,706.81	112,049,229	0.42
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	10,630	10,281.58	109,293,289	10,127.94	107,660,096	0.40
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	6,650	15,975.48	106,236,990	16,106.08	107,105,440	0.40

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	4.05
		素材	3.53
		資本財	6.95
		商業・専門サービス	1.56
		運輸	1.53
		自動車・自動車部品	1.68
		耐久消費財・アパレル	1.22
		消費者サービス	1.93

		メディア・娯楽	6.54
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.77
		生活必需品流通・小売り	1.73
		食品・飲料・タバコ	2.95
		家庭用品・パーソナル用品	1.50
		ヘルスケア機器・サービス	3.90
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.36
		銀行	5.64
		金融サービス	6.90
		保険	3.01
		ソフトウェア・サービス	9.83
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.51
		電気通信サービス	1.14
		公益事業	2.64
		半導体・半導体製造装置	9.29
		不動産管理・開発	0.28
新株予約権証券	—	—	—
投資証券	—	—	1.95
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

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 EMINI2412	買建	9	米ドル	2,630,700	404,180,748	2,633,400	404,595,576	1.50
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2412	買建	9	ユーロ	400,590	66,790,370	394,110	65,709,960	0.24

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	売建	136,300,000.00	20,762,237,587	20,800,116,009	△77.06
	加ドル	売建	7,833,000.00	859,687,203	859,186,761	△3.18
	ユーロ	売建	14,272,000.00	2,350,867,596	2,366,535,204	△8.77
	英ポンド	売建	5,115,000.00	1,008,837,388	1,009,379,600	△3.74
	スイスフラン	売建	3,771,000.00	664,579,747	667,514,185	△2.47
	スウェーデンクローナ	売建	14,963,000.00	214,698,473	213,831,771	△0.79
	ノルウェークローネ	売建	3,004,000.00	41,541,739	41,717,438	△0.15
	デンマーククローネ	売建	10,304,000.00	227,667,129	229,195,583	△0.85
	豪ドル	売建	5,119,000.00	514,341,005	512,057,869	△1.90
	ニュージーランドドル	売建	93,000.00	8,453,631	8,448,191	△0.03

	香港ドル	売建	6,487,000.00	127,088,522	127,283,052	△0.47
	シンガポールドル	売建	719,000.00	82,889,791	83,018,837	△0.31
	イスラエルシュケル	売建	646,000.00	26,010,721	26,543,443	△0.10

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2024年10月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	48,766,430,910	87.84
地方債証券	日本	2,496,772,056	4.50
特殊債券	日本	1,991,295,000	3.59
社債券	日本	2,120,940,304	3.82
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	141,220,977	0.25
合計（純資産総額）		55,516,659,247	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	99.95	699,678,000	99.98	699,881,000	0.300	2025/12/20	1.26
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	700,000,000	99.36	695,527,000	99.41	695,870,000	0.100	2026/9/20	1.25
日本	国債証券	第３４７回利付国債（１０年）	680,000,000	99.08	673,784,800	99.15	674,240,400	0.100	2027/6/20	1.21
日本	国債証券	第３４５回利付国債（１０年）	660,000,000	99.26	655,162,200	99.32	655,531,800	0.100	2026/12/20	1.18
日本	国債証券	第３４３回利付国債（１０年）	645,000,000	99.47	641,581,500	99.51	641,858,850	0.100	2026/6/20	1.16
日本	国債証券	第３４２回利付国債（１０年）	630,000,000	99.61	627,561,900	99.64	627,788,700	0.100	2026/3/20	1.13
日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	590,000,000	98.85	583,238,600	98.93	583,704,700	0.100	2027/12/20	1.05
日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	580,000,000	97.09	563,168,400	97.21	563,835,400	0.100	2030/9/20	1.02
日本	国債証券	第３５７回利付国債（１０年）	560,000,000	97.55	546,302,400	97.65	546,868,000	0.100	2029/12/20	0.99
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	540,000,000	98.71	533,066,400	98.80	533,525,400	0.100	2028/3/20	0.96
日本	国債証券	第３７２回利付国債（１０年）	500,000,000	99.62	498,135,000	99.91	499,585,000	0.800	2033/9/20	0.90
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	500,000,000	98.97	494,860,000	99.04	495,225,000	0.100	2027/9/20	0.89
日本	国債証券	第３６３回利付国債（１０年）	500,000,000	96.46	482,335,000	96.62	483,125,000	0.100	2031/6/20	0.87
日本	国債証券	第３６４回利付国債（１０年）	500,000,000	96.21	481,060,000	96.40	482,035,000	0.100	2031/9/20	0.87
日本	国債証券	第３６９回利付国債（１０年）	490,000,000	97.93	479,861,900	98.15	480,974,200	0.500	2032/12/20	0.87

日本	国債証券	第３７１回利付国債（１０年）	480,000,000	96.57	463,540,800	96.80	464,683,200	0.400	2033/6/20	0.84
日本	国債証券	第３６６回利付国債（１０年）	480,000,000	96.41	462,811,200	96.62	463,804,800	0.200	2032/3/20	0.84
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	460,000,000	99.18	456,246,400	99.24	456,527,000	0.100	2027/3/20	0.82
日本	国債証券	第３６１回利付国債（１０年）	460,000,000	96.89	445,712,400	97.04	446,388,600	0.100	2030/12/20	0.80
日本	国債証券	第３６８回利付国債（１０年）	450,000,000	95.86	431,392,500	96.08	432,378,000	0.200	2032/9/20	0.78
日本	国債証券	第３７３回利付国債（１０年）	440,000,000	97.58	429,391,600	97.88	430,672,000	0.600	2033/12/20	0.78
日本	国債証券	第３５１回利付国債（１０年）	435,000,000	98.56	428,775,150	98.66	429,171,000	0.100	2028/6/20	0.77
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	420,000,000	98.39	413,267,400	98.51	413,754,600	0.100	2028/9/20	0.75
日本	国債証券	第３７０回利付国債（１０年）	420,000,000	97.67	410,251,800	97.91	411,230,400	0.500	2033/3/20	0.74
日本	国債証券	第３５９回利付国債（１０年）	420,000,000	97.27	408,538,200	97.38	409,000,200	0.100	2030/6/20	0.74
日本	国債証券	第３７４回利付国債（１０年）	410,000,000	99.04	406,096,800	99.34	407,330,900	0.800	2034/3/20	0.73
日本	国債証券	第３６７回利付国債（１０年）	420,000,000	96.12	403,741,800	96.34	404,636,400	0.200	2032/6/20	0.73
日本	国債証券	第３６５回利付国債（１０年）	410,000,000	95.95	393,399,100	96.15	394,219,100	0.100	2031/12/20	0.71
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	400,000,000	98.23	392,948,000	98.33	393,356,000	0.100	2028/12/20	0.71
日本	国債証券	第３６２回利付国債（１０年）	400,000,000	96.68	386,740,000	96.83	387,348,000	0.100	2031/3/20	0.70

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	87.84
地方債証券	4.50
特殊債券	3.59
社債券	3.82
合　　計	99.75

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2024年10月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	77,863,437,658	46.29
	カナダ	3,179,425,065	1.89
	メキシコ	1,205,369,200	0.72
	ドイツ	9,931,663,714	5.90
	イタリア	11,503,154,614	6.84

	フランス	12,674,014,955	7.53
	オランダ	2,215,822,869	1.32
	スペイン	7,541,430,153	4.48
	ベルギー	2,639,745,737	1.57
	オーストリア	1,938,125,701	1.15
	フィンランド	826,529,085	0.49
	アイルランド	804,689,986	0.48
	イギリス	8,837,608,869	5.25
	スウェーデン	263,156,422	0.16
	ノルウェー	253,838,832	0.15
	デンマーク	441,687,472	0.26
	ポーランド	871,928,782	0.52
	オーストラリア	2,124,334,114	1.26
	ニュージーランド	443,866,601	0.26
	シンガポール	692,926,303	0.41
	マレーシア	834,270,634	0.50
	中国	18,927,485,026	11.25
	イスラエル	508,999,789	0.30
	小計	166,523,511,581	98.99
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	1,696,542,870	1.01
合計（純資産総額）		168,220,054,451	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	—	87,543,400	△0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（%）	償還期限	投資比率（%）
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,450,000	15,583.64	1,316,817,896	15,552.14	1,314,156,467	4.625	2027/6/15	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,750,000	15,243.36	1,028,926,926	15,230.16	1,028,036,083	3.625	2026/5/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,940,000	13,774.17	955,928,049	13,728.56	952,762,318	1.750	2029/11/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	15,313.88	935,678,229	15,258.06	932,267,785	4.125	2032/11/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,950,000	15,392.19	915,835,480	15,349.58	913,300,520	4.125	2028/7/31	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,540,000	15,683.57	868,869,844	15,629.25	865,860,974	4.500	2033/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,020,000	13,166.22	792,606,799	13,120.01	789,824,661	1.625	2031/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	15,474.11	773,705,689	15,426.40	771,320,428	4.250	2029/2/28	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,870,000	13,159.31	772,451,620	13,113.40	769,756,842	1.875	2032/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	15,057.31	752,865,960	15,027.91	751,395,625	3.250	2027/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,910,000	12,741.90	753,046,464	12,695.10	750,280,658	0.875	2030/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,900,000	15,282.37	748,836,183	15,225.95	746,071,769	4.000	2030/7/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	15,532.03	747,090,934	15,482.82	744,723,891	4.375	2034/5/15	0.44

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,830,000	12,770.11	744,497,485	12,725.70	741,908,851	1.375	2031/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,980,000	14,824.44	738,257,463	14,774.63	735,776,921	3.250	2029/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	15,524.83	729,667,027	15,493.31	728,185,983	4.500	2027/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	14,787.85	715,731,940	14,780.64	715,383,183	1.625	2026/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	13,911.01	709,461,569	13,860.29	706,875,024	2.750	2032/8/15	0.42
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	2,192.31	701,539,999	2,192.67	701,654,849	3.020	2025/10/22	0.42
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	2,183.00	698,560,141	2,183.37	698,678,618	2.180	2026/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	14,294.51	687,566,025	14,248.29	685,343,088	2.375	2029/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,930,000	13,885.50	684,555,491	13,845.29	682,573,257	1.500	2028/11/30	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	14,076.95	675,693,971	14,026.54	673,274,325	2.875	2032/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,490,000	14,955.88	671,519,285	14,949.87	671,249,556	2.250	2026/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,590,000	14,493.46	665,249,832	14,448.45	663,184,279	2.625	2029/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,630,000	14,314.31	662,752,838	14,269.60	660,682,800	2.375	2029/3/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,090,000	12,623.07	642,514,658	12,578.66	640,253,816	0.625	2030/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	15,182.30	637,656,824	15,180.33	637,574,227	3.000	2025/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	15,460.62	618,424,968	15,452.51	618,100,480	4.875	2025/11/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,450,000	13,902.00	618,639,349	13,874.39	617,410,744	0.375	2027/7/31	0.37

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.99
合　　計	98.99

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	570,000.00	87,428,200	87,543,400	△0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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10月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	11,041,166,487	46.77
	カナダ	439,848,830	1.86
	メキシコ	164,258,550	0.70
	ドイツ	1,384,722,543	5.87
	イタリア	1,601,828,232	6.79
	フランス	1,780,860,575	7.54
	オランダ	307,533,796	1.30
	スペイン	1,049,907,372	4.45

	ベルギー	377,577,725	1.60
	オーストリア	258,095,335	1.09
	フィンランド	97,817,549	0.41
	アイルランド	127,186,796	0.54
	イギリス	1,249,875,176	5.29
	スウェーデン	58,493,411	0.25
	ノルウェー	44,032,681	0.19
	デンマーク	75,760,067	0.32
	ポーランド	113,554,312	0.48
	オーストラリア	281,829,550	1.19
	ニュージーランド	40,799,734	0.17
	シンガポール	98,522,961	0.42
	マレーシア	289,860,701	1.23
	中国	2,669,049,002	11.31
	イスラエル	48,620,430	0.21
	小計	23,601,201,815	99.98
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	4,555,640	0.02
合計（純資産総額）		23,605,757,455	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	—	24,626,691,843	△104.32

(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	14,744.03	471,809,019	14,726.02	471,232,808	2.000	2026/11/15	2.00
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,100,000	14,787.85	310,544,850	14,780.64	310,393,530	1.625	2026/5/15	1.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,200,000	14,071.85	309,580,851	14,048.74	309,072,487	0.500	2027/4/30	1.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,100,000	13,481.29	283,107,205	13,432.68	282,086,359	1.500	2030/2/15	1.19
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	15,044.42	240,710,860	15,040.09	240,641,538	2.250	2025/11/15	1.02
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,740,000	13,843.19	240,871,584	13,811.99	240,328,629	0.625	2027/11/30	1.02
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	14,867.66	237,882,656	14,862.25	237,796,126	1.625	2026/2/15	1.01
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	14,294.51	228,712,190	14,248.29	227,972,752	2.375	2029/5/15	0.97
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	15,082.51	226,237,743	15,077.72	226,165,839	2.625	2025/12/31	0.96
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	14,730.23	220,953,525	14,728.42	220,926,331	0.375	2025/11/30	0.94
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	14,740.43	221,106,551	14,715.22	220,728,366	2.375	2027/5/15	0.94
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	14,723.02	220,845,439	14,679.21	220,188,167	2.875	2028/8/15	0.93
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	12,736.51	216,520,674	12,690.29	215,735,020	0.625	2030/5/15	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	15,532.03	186,384,435	15,482.82	185,793,903	4.375	2034/5/15	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	14,459.55	173,514,624	14,449.35	173,392,204	0.625	2026/7/31	0.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	15,344.79	168,792,745	15,288.07	168,168,782	4.125	2031/7/31	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	13,732.77	164,793,280	13,697.35	164,368,312	1.000	2028/7/31	0.70

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	14,753.63	162,289,978	14,732.03	162,052,358	2.250	2027/2/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	14,633.59	160,969,550	14,604.18	160,646,076	2.250	2027/8/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,150,000	13,897.50	159,821,321	13,861.20	159,403,812	1.250	2028/6/30	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	13,829.99	152,129,965	13,799.08	151,789,929	0.500	2027/10/31	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	16,467.67	148,209,057	16,404.66	147,641,987	5.375	2031/2/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	14,626.40	146,264,050	14,623.39	146,233,937	0.500	2026/2/28	0.62
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	950,000	15,490.18	147,156,748	15,377.10	146,082,523	1.500	2031/5/25	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	950,000	15,300.97	145,359,281	15,246.35	144,840,400	4.000	2030/2/28	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,270,000	11,306.62	143,594,186	11,332.44	143,921,992	2.875	2052/5/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	14,365.34	143,653,400	14,344.92	143,449,212	1.125	2027/2/28	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	14,030.45	140,304,509	13,987.83	139,878,312	1.875	2029/2/28	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	13,959.02	139,590,237	13,926.02	139,260,218	1.250	2028/4/30	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	14,982.29	134,840,671	14,930.67	134,376,064	3.875	2033/8/15	0.57

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.98
合　　計	99.98

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	74,954,000.00	11,433,908,926	11,450,592,233	△48.51
	加ドル	売建	4,250,000.00	467,350,558	467,028,657	△1.98
	メキシコペソ	売建	22,409,000.00	169,005,533	167,307,248	△0.71
	ユーロ	売建	43,993,000.00	7,259,039,890	7,307,075,202	△30.95
	英ポンド	売建	6,539,000.00	1,293,189,178	1,293,950,010	△5.48
	スウェーデンクローナ	売建	4,133,000.00	59,458,000	59,192,249	△0.25
	ノルウェークローネ	売建	3,271,000.00	45,346,175	45,532,966	△0.19
	デンマーククローネ	売建	3,613,000.00	79,803,399	80,344,766	△0.34
	ポーランドズロチ	売建	3,049,000.00	115,518,793	115,980,704	△0.49
	豪ドル	売建	2,847,000.00	285,845,818	284,503,619	△1.21
	ニュージーランドドル	売建	458,000.00	41,853,887	41,838,753	△0.18
	シンガポールドル	売建	894,000.00	103,088,168	103,256,760	△0.44
	マレーシアリンギット	売建	10,590,000.00	371,823,372	370,266,642	△1.57
	中国元	売建	129,554,000.00	2,784,521,484	2,788,338,031	△11.81
	イスラエルシュケル	売建	1,248,000.00	50,372,913	51,484,003	△0.22

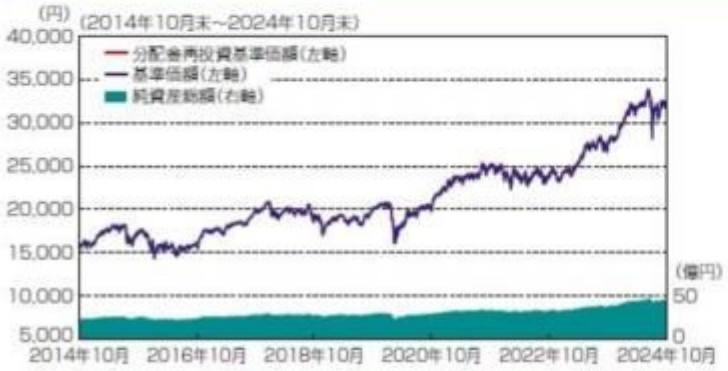
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

≪参考情報≫

運用実績

2024年10月31日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額……32,259円
純資産総額……45.29億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2014年10月末の基準価額を起点として指数化しています。
※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものとして計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2020年10月	2021年10月	2022年10月	2023年10月	2024年10月	設定来累計
10円	10円	10円	0円	0円	180円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比　率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	60.27%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	10.19%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	9.93%
日本債券インデックスマザーファンド	4.91%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	5.02%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	4.84%
現金その他	4.84%

※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産		銘　柄	業　種　・　種　類	比　率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.63%
	2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.68%
	3	日立製作所	電気機器	2.60%
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	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	5.14%
	2	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.03%
	3	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.58%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	1	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	5.12%
	2	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.01%
	3	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.57%
日本債券インデックスマザーファンド	1	第341回利付国債(10年)	国債証券	1.26%
	2	第344回利付国債(10年)	国債証券	1.25%
	3	第347回利付国債(10年)	国債証券	1.21%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	1	US TREASURY N/B(クーポン4.625%)	国債証券	0.78%
	2	US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	国債証券	0.61%
	3	US TREASURY N/B(クーポン1.750%)	国債証券	0.57%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	1	US TREASURY N/B(クーポン2.000%)	国債証券	2.00%
	2	US TREASURY N/B(クーポン1.625%)	国債証券	1.31%
	3	US TREASURY N/B(クーポン0.500%)	国債証券	1.31%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

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。なお、確定拠出年金制度上の取得申込みを行なう場合は、当該規定に従うものとします。

（２）申込みの受付
販売会社の営業日に受け付けます。

（３）取扱時間
原則として、午後3時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。

（４）申込金額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。

（５）申込単位
販売会社の照会先にお問い合わせください。ただし、確定拠出年金制度上の取得申込みを行なう場合は、１円以上１円単位とします。

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

（７）受付の中止および取消
委託会社は、金融商品取引所※における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。
※金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号ロ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）解約制限
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（４）解約価額
解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額）を控除した価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞
日興アセットマネジメント株式会社
ホームページ アドレス　www.nikkoam.com/
コールセンター 電話番号　0120-25-1404
午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

（５）手取額
１口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。
※確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関でない場合、解約価額から解約に係る所定の税金が差し引かれます。
※税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、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。

（６）解約単位

１口単位
※販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。

（７）解約代金の支払い
原則として、解約請求受付日から起算して５営業日目からお支払いします。

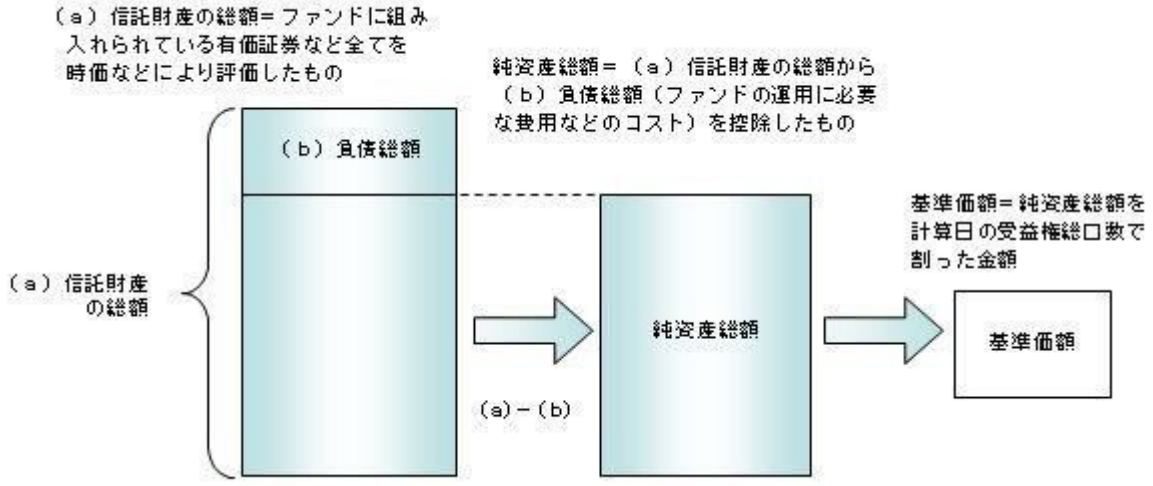
（８）受付の中止および取消
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

① 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１万口当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＞



② 有価証券などの評価基準
・信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。
＜主な資産の評価方法＞
◇マザーファンド受益証券
基準価額計算日の基準価額で評価します。
◇国内上場株式
原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。
◇外国株式
原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。
◇公社債（国内・外国）
原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。
・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
・価格情報会社の提供する価額
※残存期間１年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。
＊外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。
・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

③ 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（2001年10月17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10月27日から翌年10月26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】

① 信託の終了（繰上償還）

１）委託会社は、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。

２）この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。

３）この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（１ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）

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

イ）信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合

ロ）監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ハ）委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）

ニ）受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

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

② 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。

③ 信託約款の変更

１）委託会社は、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

２）この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。

３）この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）

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

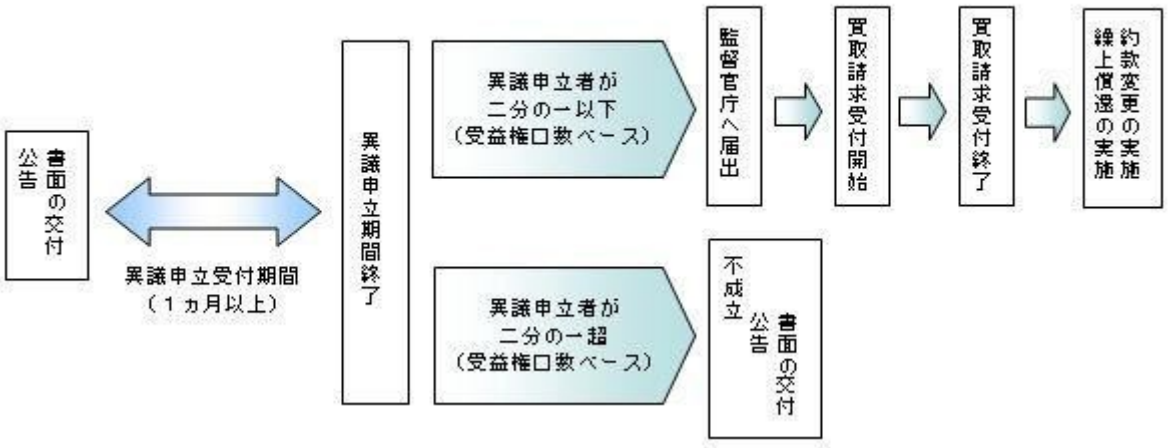
④ 異議の申立て

１）繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。

２）委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。

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

＜繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ＞



⑤　公告
公告は日本経済新聞に掲載します。

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

⑦　関係法人との契約について
販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より１年間とします。ただし、期間満了の３ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に１年間延長されるものとし、以後も同様とします。

４【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

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

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

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

第３【ファンドの経理状況】

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

（２）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第23期計算期間（2023年10月27日から2024年10月28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】

【年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第22期 2023年10月26日現在	第23期 2024年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	202,341,920	239,720,332
親投資信託受益証券	3,495,477,929	4,288,569,673
未収入金	-	5,200,336
未収利息	-	1,537
流動資産合計	3,697,819,849	4,533,491,878
資産合計	3,697,819,849	4,533,491,878
負債の部		
流動負債		
未払解約金	233,452	7,827,324
未払受託者報酬	1,023,833	1,243,156
未払委託者報酬	14,539,340	17,653,695
未払利息	72	-
その他未払費用	81,852	99,395
流動負債合計	15,878,549	26,823,570
負債合計	15,878,549	26,823,570
純資産の部		
元本等		
元本	1,382,789,841	1,408,599,057
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,299,151,459	3,098,069,251
（分配準備積立金）	1,120,144,609	1,668,208,778
元本等合計	3,681,941,300	4,506,668,308
純資産合計	3,681,941,300	4,506,668,308
負債純資産合計	3,697,819,849	4,533,491,878

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第22期 自　2022年10月27日 至　2023年10月26日	第23期 自　2023年10月27日 至　2024年10月28日
営業収益		
受取利息	-	198,859
有価証券売買等損益	416,159,783	775,057,619
営業収益合計	416,159,783	775,256,478
営業費用		
支払利息	67,146	4,647
受託者報酬	1,944,186	2,368,040
委託者報酬	27,609,272	33,627,995
その他費用	155,656	189,336
営業費用合計	29,776,260	36,190,018
営業利益又は営業損失（△）	386,383,523	739,066,460
経常利益又は経常損失（△）	386,383,523	739,066,460
当期純利益又は当期純損失（△）	386,383,523	739,066,460
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（△）	29,886,955	62,048,397
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,914,305,009	2,299,151,459
剰余金増加額又は欠損金減少額	256,480,194	409,601,878
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	256,480,194	409,601,878
剰余金減少額又は欠損金増加額	228,130,312	287,702,149
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	228,130,312	287,702,149
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（△）	2,299,151,459	3,098,069,251

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2.その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年10月27日から翌年10月26日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2023年10月27日から2024年10月28日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

		第22期 2023年10月26日現在	第23期 2024年10月28日現在
１．	期首元本額	1,383,420,100円	1,382,789,841円
	期中追加設定元本額	164,337,374円	197,173,252円
	期中一部解約元本額	164,967,633円	171,364,036円
２．	受益権の総数	1,382,789,841口	1,408,599,057口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第22期 自 2022年10月27日 至 2023年10月26日			第23期 自 2023年10月27日 至 2024年10月28日		
	分配金の計算過程			分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の配当等収益	71,306,699円	A	計算期末における費用控除後の配当等収益	85,201,841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	145,627,398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	591,816,222円
C	信託約款に定める収益調整金	1,551,994,631円	C	信託約款に定める収益調整金	1,732,347,123円
D	信託約款に定める分配準備積立金	903,210,512円	D	信託約款に定める分配準備積立金	991,190,715円
E	分配対象収益（A+B+C+D）	2,672,139,240円	E	分配対象収益（A+B+C+D）	3,400,555,901円
F	分配対象収益(1万口当たり)	19,324円	F	分配対象収益(1万口当たり)	24,141円
G	分配金額	0円	G	分配金額	0円
H	分配金額(1万口当たり)	0円	H	分配金額(1万口当たり)	0円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	第22期 自 2022年10月27日 至 2023年10月26日	第23期 自 2023年10月27日 至 2024年10月28日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	第22期 2023年10月26日現在	第23期 2024年10月28日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）

第22期（2023年10月26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	391,460,397
合計	391,460,397

第23期（2024年10月28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	725,653,473
合計	725,653,473

（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22期 2023年10月26日現在		第23期 2024年10月28日現在	
1口当たり純資産額	2.6627円	1口当たり純資産額	3.1994円
(1万口当たり純資産額)	(26,627円)	(1万口当たり純資産額)	(31,994円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド	68,162,879	474,195,516	
	海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド	153,483,896	451,242,654	
	日本債券インデックスマザーファンド	167,700,410	220,643,429	
	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	74,871,387	228,634,754	
	海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	166,638,873	218,196,940	
	日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド	968,267,378	2,695,656,380	
合計		1,599,124,823	4,288,569,673	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

当ファンドは、「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」「海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド」「海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド」「日本債券インデックスマザーファンド」「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」「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ＴＯＰＩＸマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	199,216,513	167,237,454
株式	49,297,077,010	60,171,635,490
派生商品評価勘定	29,450	444,450
未収配当金	475,719,551	594,014,867
未収利息	-	1,072
前払金	22,607,100	20,423,200
流動資産合計	49,994,649,624	60,953,756,533
資産合計	49,994,649,624	60,953,756,533
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	31,323,050	10,609,150
未払解約金	5,851,369	677,316
未払利息	71	-
流動負債合計	37,174,490	11,286,466
負債合計	37,174,490	11,286,466
純資産の部		
元本等		
元本	21,954,159,010	21,889,889,956
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	28,003,316,124	39,052,580,111
元本等合計	49,957,475,134	60,942,470,067
純資産合計	49,957,475,134	60,942,470,067
負債純資産合計	49,994,649,624	60,953,756,533

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）

		2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
1．	期首	2022年10月27日	2023年10月27日
	期首元本額	22,875,362,128円	21,954,159,010円
	期首からの追加設定元本額	1,794,794,202円	2,901,079,093円
	期首からの一部解約元本額	2,715,997,320円	2,965,348,147円
	元本の内訳　※ ＤＣインデックスバランス（株式２０）	745,167,154円	722,868,655円

		2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	2,067,436,177円	2,043,518,570円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	4,402,676,540円	4,579,248,616円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	5,228,953,333円	5,884,659,978円
	インデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）	1,811,645,166円	1,943,042,190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	2,707,551,045円	2,251,785,274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）	493,098,615円	433,981,686円
	Ｔｒａｃｅｒｓ　グローバル３分法（おとなのバランス）	922,892円	2,449,262円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	580,795円	1,383,466円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）	322,580円	587,392円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	1,753,076,468円	1,382,191,474円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	208,302,656円	181,462,903円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	604,003,733円	567,479,340円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	961,323,653円	926,963,772円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	969,098,203円	968,267,378円
	計	21,954,159,010円	21,889,889,956円
２．	受益権の総数	21,954,159,010口	21,889,889,956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	702,225,000円	717,847,000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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2022年10月27日 至 2023年10月26日	自 2023年10月27日 至 2024年10月28日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2023年10月26日現在	2024年10月28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

	2023年10月26日現在	2024年10月28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。	同左

（有価証券に関する注記）

（2023年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	6,510,114,601
合計	6,510,114,601

（2024年10月28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	9,089,075,960
合計	9,089,075,960

(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)

（2023年10月26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	698,327,100	－	667,050,000	△31,277,100
合計		698,327,100	－	667,050,000	△31,277,100

（2024年10月28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	808,748,200	－	798,600,000	△10,148,200
合計		808,748,200	－	798,600,000	△10,148,200

（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）

2023年10月26日現在		2024年10月28日現在	
1口当たり純資産額	2.2755円	1口当たり純資産額	2.7840円

2023年10月26日現在		2024年10月28日現在	
(1万口当たり純資産額)	(22,755円)	(1万口当たり純資産額)	(27,840円)

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	900	4,170.00	3,753,000	
ニッスイ	22,600	905.30	20,459,780	
マルハニチロ	3,300	2,969.00	9,797,700	
雪国まいたけ	1,900	1,040.00	1,976,000	
カネコ種苗	800	1,390.00	1,112,000	
サカタのタネ	2,500	3,510.00	8,775,000	
ホクト	1,800	1,808.00	3,254,400	
ホクリヨウ	300	1,023.00	306,900	
住石ホールディングス	3,200	965.00	3,088,000	
日鉄鉱業	900	4,360.00	3,924,000	
ＩＮＰＥＸ	68,300	1,961.50	133,970,450	
石油資源開発	12,900	1,111.00	14,331,900	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	1,000	3,160.00	3,160,000	
ショーボンドホールディングス	3,000	5,327.00	15,981,000	
ミライト・ワン	6,800	2,125.00	14,450,000	
タマホーム	1,400	3,775.00	5,285,000	
日本アクア	400	793.00	317,200	
キャンディル	400	524.00	209,600	
ダイセキ環境ソリューション	300	1,253.00	375,900	
第一カッター興業	600	1,465.00	879,000	
安藤・間	13,000	1,106.00	14,378,000	
東急建設	7,000	687.00	4,809,000	
コムシスホールディングス	7,200	3,080.00	22,176,000	
ビーアールホールディングス	3,300	349.00	1,151,700	
高松コンストラクショングループ	1,700	2,908.00	4,943,600	
東建コーポレーション	600	10,620.00	6,372,000	
ヤマウラ	1,200	1,193.00	1,431,600	
オリエンタル白石	8,200	379.00	3,107,800	
大成建設	14,500	6,368.00	92,336,000	
大林組	56,400	1,875.00	105,750,000	
清水建設	44,700	977.00	43,671,900	
長谷工コーポレーション	14,500	1,840.50	26,687,250	
松井建設	1,400	850.00	1,190,000	
鹿島建設	35,000	2,604.50	91,157,500	
不動テトラ	1,100	2,082.00	2,290,200	

鉄建建設	1,100	2,387.00	2,625,700	
西松建設	3,000	4,955.00	14,865,000	
三井住友建設	11,700	389.00	4,551,300	
大豊建設	500	3,405.00	1,702,500	
奥村組	2,600	4,220.00	10,972,000	
東鉄工業	2,000	3,235.00	6,470,000	
イチケン	100	2,435.00	243,500	
淺沼組	5,900	655.00	3,864,500	
戸田建設	21,300	897.90	19,125,270	
熊谷組	2,600	3,525.00	9,165,000	
北野建設	100	3,950.00	395,000	
植木組	200	1,481.00	296,200	
矢作建設工業	2,100	1,499.00	3,147,900	
ピーエス・コンストラクション	2,000	987.00	1,974,000	
日本ハウスホールディングス	3,300	338.00	1,115,400	
新日本建設	2,200	1,532.00	3,370,400	
東亜道路工業	3,000	1,258.00	3,774,000	
日本道路	1,900	1,542.00	2,929,800	
東亜建設工業	4,800	978.00	4,694,400	
日本国土開発	4,500	509.00	2,290,500	
若築建設	500	3,520.00	1,760,000	
東洋建設	4,000	1,298.00	5,192,000	
五洋建設	22,300	625.70	13,953,110	
世紀東急工業	2,000	1,465.00	2,930,000	
福田組	600	5,810.00	3,486,000	
住友林業	13,600	6,033.00	82,048,800	
巴コーポレーション	600	833.00	499,800	
大和ハウス工業	43,600	4,550.00	198,380,000	
ライト工業	2,900	2,206.00	6,397,400	
積水ハウス	47,800	3,728.00	178,198,400	
日特建設	1,500	1,009.00	1,513,500	
北陸電気工事	1,100	1,180.00	1,298,000	
ユアテック	3,500	1,457.00	5,099,500	
日本リーテック	1,300	1,022.00	1,328,600	
四電工	2,100	1,245.00	2,614,500	
中電工	2,500	3,160.00	7,900,000	
関電工	9,900	2,054.00	20,334,600	
きんでん	11,000	3,116.00	34,276,000	
東京エネシス	1,500	1,121.00	1,681,500	
トーエネック	2,500	893.00	2,232,500	
住友電設	1,500	4,545.00	6,817,500	
日本電設工業	3,000	1,828.00	5,484,000	

エクシオグループ	15,500	1,538.50	23,846,750	
新日本空調	1,000	3,340.00	3,340,000	
九電工	3,400	6,030.00	20,502,000	
三機工業	3,300	2,381.00	7,857,300	
日揮ホールディングス	15,600	1,290.00	20,124,000	
中外炉工業	500	2,602.00	1,301,000	
ヤマト	400	905.00	362,000	
太平電業	1,000	5,050.00	5,050,000	
高砂熱学工業	4,200	4,720.00	19,824,000	
三晃金属工業	100	3,900.00	390,000	
朝日工業社	1,500	1,280.00	1,920,000	
明星工業	3,100	1,270.00	3,937,000	
大氣社	1,800	4,725.00	8,505,000	
ダイダン	2,100	2,885.00	6,058,500	
日比谷総合設備	1,100	3,465.00	3,811,500	
飛島ホールディングス	1,600	1,535.00	2,456,000	
テスホールディングス	3,300	275.00	907,500	
インフロニア・ホールディングス	18,200	1,138.00	20,711,600	
東洋エンジニアリング	2,400	736.00	1,766,400	
レイズネクスト	2,300	1,539.00	3,539,700	
ニップン	4,700	2,173.00	10,213,100	
日清製粉グループ本社	14,700	1,763.50	25,923,450	
日東富士製粉	300	6,780.00	2,034,000	
昭和産業	1,500	2,852.00	4,278,000	
中部飼料	2,200	1,392.00	3,062,400	
フィード・ワン	2,300	821.00	1,888,300	
東洋精糖	200	1,350.00	270,000	
日本甜菜製糖	900	2,579.00	2,321,100	
DM三井製糖ホールディングス	1,600	3,180.00	5,088,000	
塩水港精糖	1,400	272.00	380,800	
ウェルネオシュガー	800	2,190.00	1,752,000	
森永製菓	6,600	2,808.00	18,532,800	
中村屋	400	3,235.00	1,294,000	
江崎グリコ	4,500	4,401.00	19,804,500	
名糖産業	600	1,829.00	1,097,400	
井村屋グループ	900	2,437.00	2,193,300	
不二家	1,100	2,644.00	2,908,400	
山崎製パン	10,600	2,635.00	27,931,000	
モロゾフ	500	4,630.00	2,315,000	
亀田製菓	900	4,250.00	3,825,000	
寿スピリッツ	7,400	1,984.00	14,681,600	
カルビー	7,200	3,379.00	24,328,800	

森永乳業	5,600	3,477.00	19,471,200	
六甲バター	1,200	1,450.00	1,740,000	
ヤクルト本社	22,600	3,314.00	74,896,400	
明治ホールディングス	19,400	3,512.00	68,132,800	
雪印メグミルク	3,800	2,600.00	9,880,000	
プリマハム	2,100	2,233.00	4,689,300	
日本ハム	6,800	5,160.00	35,088,000	
林兼産業	500	459.00	229,500	
丸大食品	1,600	1,645.00	2,632,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1,800	2,813.00	5,063,400	
柿安本店	600	2,627.00	1,576,200	
伊藤ハム米久ホールディングス	2,400	3,820.00	9,168,000	
サッポロホールディングス	5,200	7,328.00	38,105,600	
アサヒグループホールディングス	118,900	1,839.50	218,716,550	
キリンホールディングス	66,000	2,307.50	152,295,000	
シマダヤ	500	1,420.00	710,000	
宝ホールディングス	10,600	1,197.00	12,688,200	
オエノンホールディングス	5,100	412.00	2,101,200	
養命酒製造	500	2,517.00	1,258,500	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	11,200	1,917.00	21,470,400	
ライフドリンク　カンパニー	1,200	1,764.00	2,116,800	
サントリー食品インターナショナル	11,200	5,173.00	57,937,600	
ダイドーグループホールディングス	1,800	3,040.00	5,472,000	
伊藤園	5,300	3,306.00	17,521,800	
キーコーヒー	1,800	1,986.00	3,574,800	
ユニカフェ	300	936.00	280,800	
日清オイリオグループ	2,200	5,160.00	11,352,000	
不二製油グループ本社	3,700	3,192.00	11,810,400	
Ｊ－オイルミルズ	1,800	2,048.00	3,686,400	
キッコーマン	52,500	1,795.00	94,237,500	
味の素	37,200	5,790.00	215,388,000	
ブルドックソース	800	1,777.00	1,421,600	
キユーピー	8,500	3,470.00	29,495,000	
ハウス食品グループ本社	5,300	2,952.00	15,645,600	
カゴメ	6,800	3,128.00	21,270,400	
アリアケジャパン	1,600	5,160.00	8,256,000	
エバラ食品工業	400	2,920.00	1,168,000	
やまみ	100	3,910.00	391,000	
ニチレイ	7,300	4,108.00	29,988,400	
東洋水産	8,000	8,827.00	70,616,000	
イートアンドホールディングス	800	2,182.00	1,745,600	
大冷	200	1,901.00	380,200	

ヨシムラ・フード・ホールディングス	700	1,380.00	966,000	
日清食品ホールディングス	16,700	4,100.00	68,470,000	
フジッコ	1,600	1,687.00	2,699,200	
ロック・フィールド	1,900	1,465.00	2,783,500	
日本たばこ産業	96,300	4,133.00	398,007,900	
ケンコーマヨネーズ	1,100	2,135.00	2,348,500	
わらべや日洋ホールディングス	1,100	2,016.00	2,217,600	
なとり	1,000	2,109.00	2,109,000	
イフジ産業	200	1,380.00	276,000	
ファーマフーズ	2,100	878.00	1,843,800	
ユーグレナ	9,800	407.00	3,988,600	
紀文食品	1,400	1,104.00	1,545,600	
ピックルスホールディングス	900	1,091.00	981,900	
理研ビタミン	1,400	2,642.00	3,698,800	
片倉工業	1,500	1,997.00	2,995,500	
グンゼ	1,200	5,340.00	6,408,000	
東洋紡	7,000	965.00	6,755,000	
ユニチカ	5,200	289.00	1,502,800	
富士紡ホールディングス	700	4,585.00	3,209,500	
倉敷紡績	1,100	4,635.00	5,098,500	
シキボウ	1,200	1,012.00	1,214,400	
日本毛織	4,200	1,255.00	5,271,000	
ダイドーリミテッド	600	886.00	531,600	
帝国繊維	1,800	2,667.00	4,800,600	
帝人	15,400	1,365.00	21,021,000	
東レ	107,900	831.90	89,762,010	
住江織物	100	2,030.00	203,000	
セーレン	3,100	2,547.00	7,895,700	
小松マテーレ	2,400	758.00	1,819,200	
ワコールホールディングス	3,000	4,620.00	13,860,000	
ホギメディカル	1,900	4,510.00	8,569,000	
クラウディアホールディングス	400	341.00	136,400	
ＴＳＩホールディングス	4,900	894.00	4,380,600	
マツオカコーポレーション	200	1,735.00	347,000	
ワールド	2,300	1,952.00	4,489,600	
三陽商会	800	2,656.00	2,124,800	
オンワードホールディングス	9,500	520.00	4,940,000	
ルックホールディングス	500	2,539.00	1,269,500	
ゴールドウイン	2,900	7,932.00	23,002,800	
デサント	2,800	4,340.00	12,152,000	
特種東海製紙	900	3,740.00	3,366,000	
王子ホールディングス	67,300	564.70	38,004,310	

日本製紙	9,000	901.00	8,109,000	
三菱製紙	700	489.00	342,300	
北越コーポレーション	7,800	1,518.00	11,840,400	
中越パルプ工業	200	1,233.00	246,600	
大王製紙	7,000	865.00	6,055,000	
レンゴー	14,600	935.80	13,662,680	
トーモク	900	2,338.00	2,104,200	
ザ・パック	1,200	3,695.00	4,434,000	
北の達人コーポレーション	6,800	155.00	1,054,000	
クラレ	23,400	2,048.00	47,923,200	
旭化成	108,900	1,043.00	113,582,700	
レゾナック・ホールディングス	14,400	3,634.00	52,329,600	
住友化学	119,400	401.40	47,927,160	
住友精化	800	5,000.00	4,000,000	
日産化学	7,500	5,223.00	39,172,500	
ラサ工業	600	2,720.00	1,632,000	
クレハ	3,400	2,802.00	9,526,800	
多木化学	600	3,635.00	2,181,000	
テイカ	1,300	1,613.00	2,096,900	
石原産業	2,700	1,447.00	3,906,900	
日本曹達	3,800	2,504.00	9,515,200	
東ソー	21,500	1,887.50	40,581,250	
トクヤマ	5,200	2,730.50	14,198,600	
セントラル硝子	1,700	3,445.00	5,856,500	
東亞合成	7,700	1,567.50	12,069,750	
大阪ソーダ	5,500	1,646.00	9,053,000	
関東電化工業	3,100	960.00	2,976,000	
デンカ	5,900	2,137.50	12,611,250	
信越化学工業	144,500	5,593.00	808,188,500	代用有価証券 24,000株
日本カーバイド工業	900	1,641.00	1,476,900	
堺化学工業	1,200	2,608.00	3,129,600	
第一稀元素化学工業	1,800	783.00	1,409,400	
エア・ウォーター	15,200	1,917.00	29,138,400	
日本酸素ホールディングス	15,700	5,188.00	81,451,600	
日本化学工業	600	2,651.00	1,590,600	
東邦アセチレン	900	334.00	300,600	
日本パーカライジング	7,100	1,266.00	8,988,600	
高圧ガス工業	2,400	894.00	2,145,600	
四国化成ホールディングス	1,800	1,894.00	3,409,200	
戸田工業	500	1,683.00	841,500	
ステラ　ケミファ	900	4,430.00	3,987,000	
保土谷化学工業	500	4,240.00	2,120,000	

日本触媒	9,300	1,700.00	15,810,000	
大日精化工業	1,100	2,921.00	3,213,100	
カネカ	4,000	3,719.00	14,876,000	
三菱瓦斯化学	11,700	2,646.00	30,958,200	
三井化学	13,300	3,496.00	46,496,800	
東京応化工業	7,700	3,477.00	26,772,900	
大阪有機化学工業	1,400	2,896.00	4,054,400	
三菱ケミカルグループ	117,700	822.30	96,784,710	
ＫＨネオケム	2,900	2,037.00	5,907,300	
ダイセル	19,900	1,324.00	26,347,600	
住友ベークライト	4,500	4,011.00	18,049,500	
積水化学工業	32,000	2,146.50	68,688,000	
日本ゼオン	11,100	1,338.00	14,851,800	
アイカ工業	4,100	3,272.00	13,415,200	
ＵＢＥ	7,700	2,500.00	19,250,000	
積水樹脂	2,400	2,246.00	5,390,400	
旭有機材	1,100	4,065.00	4,471,500	
ニチバン	900	1,910.00	1,719,000	
リケンテクノス	3,000	1,046.00	3,138,000	
大倉工業	800	2,673.00	2,138,400	
積水化成品工業	2,300	390.00	897,000	
群栄化学工業	400	2,702.00	1,080,800	
タイガースポリマー	400	713.00	285,200	
ダイキョーニシカワ	3,600	629.00	2,264,400	
森六ホールディングス	800	2,295.00	1,836,000	
恵和	1,000	1,016.00	1,016,000	
日本化薬	12,200	1,190.00	14,518,000	
カーリット	1,800	1,240.00	2,232,000	
日本精化	1,100	2,312.00	2,543,200	
扶桑化学工業	1,700	3,700.00	6,290,000	
トリケミカル研究所	2,000	3,060.00	6,120,000	
ＡＤＥＫＡ	5,600	2,724.50	15,257,200	
日油	14,500	2,476.00	35,902,000	
ハリマ化成グループ	1,200	846.00	1,015,200	
花王	39,200	6,732.00	263,894,400	
第一工業製薬	700	3,060.00	2,142,000	
石原ケミカル	700	2,307.00	1,614,900	
三洋化成工業	1,000	4,090.00	4,090,000	
大日本塗料	1,800	1,022.00	1,839,600	
日本ペイントホールディングス	71,200	1,018.50	72,517,200	
関西ペイント	14,000	2,444.00	34,216,000	
中国塗料	3,300	2,173.00	7,170,900	

日本特殊塗料	400	1,131.00	452,400	
藤倉化成	2,200	464.00	1,020,800	
太陽ホールディングス	2,800	3,920.00	10,976,000	
ＤＩＣ	5,700	3,252.00	18,536,400	
サカタインクス	3,600	1,530.00	5,508,000	
ａｒｔｉｅｎｃｅ	2,900	3,675.00	10,657,500	
富士フイルムホールディングス	89,800	3,648.00	327,590,400	
資生堂	33,700	3,339.00	112,524,300	
ライオン	20,500	1,644.00	33,702,000	
高砂香料工業	1,200	5,020.00	6,024,000	
マンダム	3,500	1,244.00	4,354,000	
ミルボン	2,600	3,181.00	8,270,600	
ファンケル	4,000	2,791.00	11,164,000	
コーセー	3,300	8,319.00	27,452,700	
コタ	1,600	1,639.00	2,622,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	8,200	1,490.00	12,218,000	
ノエビアホールディングス	1,400	5,070.00	7,098,000	
新日本製薬	900	1,722.00	1,549,800	
Ｉ－ｎｅ	600	2,004.00	1,202,400	
アクシージア	1,300	558.00	725,400	
エステー	1,300	1,460.00	1,898,000	
アグロ　カネショウ	700	1,326.00	928,200	
コニシ	4,700	1,300.00	6,110,000	
長谷川香料	3,100	3,255.00	10,090,500	
小林製薬	4,200	5,648.00	23,721,600	
荒川化学工業	1,400	1,281.00	1,793,400	
メック	1,300	3,640.00	4,732,000	
日本高純度化学	400	3,100.00	1,240,000	
タカラバイオ	4,400	988.00	4,347,200	
ＪＣＵ	1,800	3,330.00	5,994,000	
ＯＡＴアグリオ	700	1,854.00	1,297,800	
デクセリアルズ	12,000	2,358.50	28,302,000	
アース製薬	1,500	5,190.00	7,785,000	
北興化学工業	1,500	1,253.00	1,879,500	
大成ラミック	500	2,599.00	1,299,500	
クミアイ化学工業	6,500	796.00	5,174,000	
日本農薬	3,000	621.00	1,863,000	
アキレス	1,000	1,491.00	1,491,000	
有沢製作所	2,800	1,387.00	3,883,600	
日東電工	51,000	2,434.50	124,159,500	
レック	2,100	1,284.00	2,696,400	
三光合成	2,100	605.00	1,270,500	

ＺＡＣＲＯＳ	1,300	4,250.00	5,525,000	
前澤化成工業	1,100	1,777.00	1,954,700	
未来工業	600	3,485.00	2,091,000	
ＪＳＰ	1,100	1,911.00	2,102,100	
エフピコ	3,100	2,653.50	8,225,850	
天馬	1,100	2,901.00	3,191,100	
信越ポリマー	3,500	1,516.00	5,306,000	
東リ	1,200	389.00	466,800	
ニフコ	4,800	3,455.00	16,584,000	
バルカー	1,400	3,255.00	4,557,000	
ユニ・チャーム	33,600	4,898.00	164,572,800	
協和キリン	19,500	2,564.50	50,007,750	
武田薬品工業	142,800	4,133.00	590,192,400	
アステラス製薬	141,500	1,735.50	245,573,250	
住友ファーマ	11,800	612.00	7,221,600	
塩野義製薬	58,900	2,114.00	124,514,600	
日本新薬	4,200	4,063.00	17,064,600	
中外製薬	50,500	7,855.00	396,677,500	
科研製薬	2,800	3,904.00	10,931,200	
エーザイ	19,600	5,184.00	101,606,400	
ロート製薬	15,600	3,337.00	52,057,200	
小野薬品工業	33,000	1,949.00	64,317,000	
久光製薬	3,600	4,338.00	15,616,800	
持田製薬	1,800	3,410.00	6,138,000	
参天製薬	28,500	1,794.00	51,129,000	
扶桑薬品工業	600	2,415.00	1,449,000	
ツムラ	5,100	4,950.00	25,245,000	
キッセイ薬品工業	2,700	3,705.00	10,003,500	
生化学工業	2,700	848.00	2,289,600	
栄研化学	2,800	2,455.00	6,874,000	
鳥居薬品	900	3,875.00	3,487,500	
ＪＣＲファーマ	5,400	656.00	3,542,400	
東和薬品	2,500	3,075.00	7,687,500	
富士製薬工業	1,200	1,312.00	1,574,400	
ゼリア新薬工業	2,200	2,308.00	5,077,600	
ネクセラファーマ	7,500	1,186.00	8,895,000	
第一三共	140,600	4,888.00	687,252,800	
杏林製薬	3,500	1,489.00	5,211,500	
大幸薬品	3,700	384.00	1,420,800	
ダイト	1,200	2,212.00	2,654,400	
大塚ホールディングス	40,300	9,150.00	368,745,000	
ペプチドリーム	7,800	2,781.00	21,691,800	

セルソース	1,100	1,174.00	1,291,400	
あすか製薬ホールディングス	1,600	2,125.00	3,400,000	
サワイグループホールディングス	11,100	2,022.00	22,444,200	
日本コークス工業	16,200	96.00	1,555,200	
ニチレキグループ	2,100	2,369.00	4,974,900	
ユシロ化学工業	800	1,543.00	1,234,400	
ビーピー・カストロール	300	862.00	258,600	
富士石油	4,700	331.00	1,555,700	
ＭＯＲＥＳＣＯ	200	1,201.00	240,200	
出光興産	83,700	1,012.00	84,704,400	
ＥＮＥＯＳホールディングス	255,300	759.40	193,874,820	
コスモエネルギーホールディングス	4,800	7,443.00	35,726,400	
横浜ゴム	8,200	3,113.00	25,526,600	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	9,300	2,167.50	20,157,750	
ブリヂストン	47,300	5,504.00	260,339,200	
住友ゴム工業	15,900	1,574.00	25,026,600	
藤倉コンポジット	1,500	1,186.00	1,779,000	
オカモト	700	5,260.00	3,682,000	
フコク	900	1,739.00	1,565,100	
ニッタ	1,600	3,665.00	5,864,000	
住友理工	2,500	1,470.00	3,675,000	
三ツ星ベルト	1,900	3,860.00	7,334,000	
バンドー化学	2,400	1,777.00	4,264,800	
日東紡績	2,000	6,900.00	13,800,000	
ＡＧＣ	15,700	4,579.00	71,890,300	
日本板硝子	7,600	364.00	2,766,400	
石塚硝子	100	2,390.00	239,000	
日本山村硝子	200	1,514.00	302,800	
日本電気硝子	6,000	3,344.00	20,064,000	
オハラ	700	1,322.00	925,400	
住友大阪セメント	2,700	3,735.00	10,084,500	
太平洋セメント	9,200	3,402.00	31,298,400	
日本ヒューム	1,500	1,232.00	1,848,000	
日本コンクリート工業	3,100	329.00	1,019,900	
三谷セキサン	700	6,140.00	4,298,000	
アジアパイルホールディングス	2,400	794.00	1,905,600	
東海カーボン	14,800	857.50	12,691,000	
日本カーボン	900	4,390.00	3,951,000	
東洋炭素	1,100	5,220.00	5,742,000	
ノリタケ	1,800	3,860.00	6,948,000	
ＴＯＴＯ	10,600	4,924.00	52,194,400	
日本碍子	18,800	1,860.00	34,968,000	

日本特殊陶業	13,300	4,327.00	57,549,100	
ＭＡＲＵＷＡ	600	39,300.00	23,580,000	
品川リフラクトリーズ	2,000	1,746.00	3,492,000	
黒崎播磨	1,300	2,241.00	2,913,300	
ヨータイ	900	1,661.00	1,494,900	
フジミインコーポレーテッド	4,400	2,303.00	10,133,200	
エーアンドエーマテリアル	200	1,141.00	228,200	
ニチアス	4,100	5,450.00	22,345,000	
ニチハ	2,000	3,400.00	6,800,000	
日本製鉄	78,700	3,028.00	238,303,600	
神戸製鋼所	33,400	1,639.50	54,759,300	
中山製鋼所	3,800	746.00	2,834,800	
合同製鐵	900	3,935.00	3,541,500	
ＪＦＥホールディングス	46,200	1,846.00	85,285,200	
東京製鐵	4,700	1,608.00	7,557,600	
共英製鋼	1,900	1,706.00	3,241,400	
大和工業	3,100	6,901.00	21,393,100	
東京鐵鋼	700	4,760.00	3,332,000	
大阪製鐵	800	3,280.00	2,624,000	
淀川製鋼所	1,700	5,400.00	9,180,000	
中部鋼鈑	1,100	2,430.00	2,673,000	
丸一鋼管	5,100	3,254.00	16,595,400	
モリ工業	400	5,060.00	2,024,000	
大同特殊鋼	10,400	1,326.50	13,795,600	
日本高周波鋼業	600	391.00	234,600	
日本冶金工業	1,200	4,310.00	5,172,000	
山陽特殊製鋼	1,600	1,812.00	2,899,200	
愛知製鋼	1,000	4,160.00	4,160,000	
大平洋金属	1,400	1,378.00	1,929,200	
新日本電工	9,900	290.00	2,871,000	
栗本鐵工所	800	3,810.00	3,048,000	
三菱製鋼	1,300	1,315.00	1,709,500	
日本精線	1,400	1,260.00	1,764,000	
エンビプロ・ホールディングス	2,000	516.00	1,032,000	
新家工業	100	4,595.00	459,500	
大紀アルミニウム工業所	2,100	1,092.00	2,293,200	
日本軽金属ホールディングス	4,900	1,586.00	7,771,400	
三井金属鉱業	4,800	4,857.00	23,313,600	
三菱マテリアル	11,900	2,480.00	29,512,000	
住友金属鉱山	19,200	4,257.00	81,734,400	
ＤＯＷＡホールディングス	4,100	5,198.00	21,311,800	
古河機械金属	2,200	1,650.00	3,630,000	

エス・サイエンス	11,200	22.00	246,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,900	2,245.00	6,510,500	
東邦チタニウム	3,500	1,059.00	3,706,500	
ＵＡＣＪ	2,300	5,030.00	11,569,000	
ＣＫサンエツ	400	3,580.00	1,432,000	
古河電気工業	5,500	3,501.00	19,255,500	
住友電気工業	62,100	2,311.00	143,513,100	
フジクラ	19,600	5,094.00	99,842,400	
ＳＷＣＣ	1,900	5,130.00	9,747,000	
カナレ電気	200	1,411.00	282,200	
平河ヒューテック	1,100	1,593.00	1,752,300	
リョービ	1,800	1,879.00	3,382,200	
アーレスティ	600	556.00	333,600	
ＡＲＥホールディングス	6,300	1,783.00	11,232,900	
稲葉製作所	900	1,785.00	1,606,500	
宮地エンジニアリンググループ	1,600	1,990.00	3,184,000	
トーカロ	4,800	1,764.00	8,467,200	
ＳＵＭＣＯ	31,600	1,500.00	47,400,000	
川田テクノロジーズ	1,200	2,387.00	2,864,400	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	1,300	3,960.00	5,148,000	
信和	400	733.00	293,200	
東洋製罐グループホールディングス	9,500	2,266.00	21,527,000	
ホッカンホールディングス	800	1,752.00	1,401,600	
コロナ	1,100	942.00	1,036,200	
横河ブリッジホールディングス	2,600	2,636.00	6,853,600	
三和ホールディングス	16,500	3,658.00	60,357,000	
文化シヤッター	4,400	1,792.00	7,884,800	
三協立山	2,100	763.00	1,602,300	
アルインコ	1,300	963.00	1,251,900	
東洋シヤッター	400	782.00	312,800	
ＬＩＸＩＬ	25,900	1,610.50	41,711,950	
ノーリツ	2,300	1,757.00	4,041,100	
長府製作所	1,900	1,935.00	3,676,500	
リンナイ	7,900	3,386.00	26,749,400	
日東精工	2,500	573.00	1,432,500	
三洋工業	100	3,125.00	312,500	
岡部	3,000	776.00	2,328,000	
ジーテクト	2,100	1,562.00	3,280,200	
東プレ	2,900	1,747.00	5,066,300	
高周波熱錬	2,500	984.00	2,460,000	
東京製綱	1,100	1,116.00	1,227,600	
サンコール	2,200	403.00	886,600	

パイオラックス	2,000	2,391.00	4,782,000	
エイチワン	1,700	937.00	1,592,900	
日本発條	14,700	1,861.00	27,356,700	
中央発條	1,300	1,258.00	1,635,400	
立川ブラインド工業	800	1,294.00	1,035,200	
日本ドライケミカル	100	3,245.00	324,500	
日本製鋼所	4,500	5,141.00	23,134,500	
三浦工業	6,800	3,598.00	24,466,400	
タクマ	5,500	1,565.00	8,607,500	
ツガミ	3,400	1,423.00	4,838,200	
オークマ	2,800	3,129.00	8,761,200	
芝浦機械	1,500	3,695.00	5,542,500	
アマダ	24,600	1,501.00	36,924,600	
アイダエンジニアリング	3,600	781.00	2,811,600	
ＦＵＪＩ	7,600	2,257.00	17,153,200	
牧野フライス製作所	1,800	5,800.00	10,440,000	
オーエスジー	7,100	1,818.00	12,907,800	
旭ダイヤモンド工業	3,700	845.00	3,126,500	
DMG森精機	10,300	2,888.00	29,746,400	
ソディック	4,300	755.00	3,246,500	
ディスコ	7,800	39,670.00	309,426,000	
日東工器	700	2,515.00	1,760,500	
日進工具	1,500	738.00	1,107,000	
冨士ダイス	1,200	789.00	946,800	
リケンＮＰＲ	1,800	2,330.00	4,194,000	
島精機製作所	2,600	1,121.00	2,914,600	
オプトラン	2,700	1,909.00	5,154,300	
イワキポンプ	1,100	2,862.00	3,148,200	
フリュー	1,500	1,083.00	1,624,500	
ヤマシンフィルタ	3,900	463.00	1,805,700	
日阪製作所	1,800	989.00	1,780,200	
やまびこ	2,700	2,457.00	6,633,900	
野村マイクロ・サイエンス	2,200	2,130.00	4,686,000	
平田機工	800	4,910.00	3,928,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	1,900	452.00	858,800	
マルマエ	700	1,505.00	1,053,500	
タツモ	1,200	3,635.00	4,362,000	
ナブテスコ	10,100	2,456.00	24,805,600	
三井海洋開発	2,000	3,255.00	6,510,000	
レオン自動機	1,900	1,396.00	2,652,400	
ＳＭＣ	4,900	63,830.00	312,767,000	
ホソカワミクロン	1,100	3,925.00	4,317,500	

ユニオンツール	700	6,820.00	4,774,000	
瑞光	1,200	1,353.00	1,623,600	
オイレス工業	2,200	1,955.00	4,301,000	
日精エー・エス・ビー機械	600	4,515.00	2,709,000	
サトーホールディングス	2,200	2,116.00	4,655,200	
技研製作所	1,500	1,742.00	2,613,000	
日本エアーテック	900	1,188.00	1,069,200	
日精樹脂工業	1,300	939.00	1,220,700	
オカダアイヨン	200	2,034.00	406,800	
ワイエイシイホールディングス	700	2,170.00	1,519,000	
小松製作所	76,100	4,005.00	304,780,500	
住友重機械工業	9,600	3,436.00	32,985,600	
日立建機	6,500	3,359.00	21,833,500	
日工	2,400	693.00	1,663,200	
巴工業	600	3,820.00	2,292,000	
井関農機	1,500	992.00	1,488,000	
ＴＯＷＡ	5,400	1,943.00	10,492,200	
北川鉄工所	700	1,248.00	873,600	
ローツェ	8,400	2,158.00	18,127,200	
タカキタ	300	402.00	120,600	
クボタ	84,800	1,970.50	167,098,400	
荏原実業	800	4,070.00	3,256,000	
三菱化工機	600	3,500.00	2,100,000	
月島ホールディングス	2,200	1,355.00	2,981,000	
帝国電機製作所	1,100	2,773.00	3,050,300	
新東工業	3,300	993.00	3,276,900	
澁谷工業	1,500	3,625.00	5,437,500	
アイチ　コーポレーション	2,200	1,183.00	2,602,600	
小森コーポレーション	4,000	1,098.00	4,392,000	
鶴見製作所	1,200	4,195.00	5,034,000	
酒井重工業	600	2,326.00	1,395,600	
荏原製作所	33,400	2,268.00	75,751,200	
石井鐵工所	100	8,330.00	833,000	
酉島製作所	1,400	2,762.00	3,866,800	
北越工業	1,600	1,837.00	2,939,200	
ダイキン工業	19,400	18,330.00	355,602,000	
オルガノ	2,000	6,940.00	13,880,000	
トーヨーカネツ	600	4,375.00	2,625,000	
栗田工業	9,100	5,646.00	51,378,600	
椿本チエイン	6,600	1,907.00	12,586,200	
木村化工機	1,400	732.00	1,024,800	
アネスト岩田	2,500	1,389.00	3,472,500	

ダイフク	27,400	2,870.50	78,651,700	
サムコ	400	3,215.00	1,286,000	
加藤製作所	300	1,223.00	366,900	
タダノ	9,300	971.20	9,032,160	
フジテック	3,800	4,858.00	18,460,400	
ＣＫＤ	4,500	2,604.00	11,718,000	
平和	4,800	2,090.00	10,032,000	
理想科学工業	1,300	3,520.00	4,576,000	
ＳＡＮＫＹＯ	15,600	2,043.00	31,870,800	
日本金銭機械	2,000	903.00	1,806,000	
マースグループホールディングス	800	3,160.00	2,528,000	
フクシマガリレイ	1,100	5,500.00	6,050,000	
オーイズミ	400	343.00	137,200	
ダイコク電機	800	3,450.00	2,760,000	
竹内製作所	3,000	4,790.00	14,370,000	
アマノ	4,600	4,368.00	20,092,800	
ＪＵＫＩ	2,600	402.00	1,045,200	
ジャノメ	1,600	907.00	1,451,200	
マックス	2,300	3,495.00	8,038,500	
グローリー	3,900	2,490.00	9,711,000	
新晃工業	1,600	4,360.00	6,976,000	
大和冷機工業	2,500	1,427.00	3,567,500	
セガサミーホールディングス	14,500	2,897.50	42,013,750	
ＴＰＲ	2,100	2,279.00	4,785,900	
ツバキ・ナカシマ	4,000	690.00	2,760,000	
ホシザキ	10,500	5,067.00	53,203,500	
大豊工業	1,600	630.00	1,008,000	
日本精工	30,000	698.60	20,958,000	
ＮＴＮ	35,100	253.50	8,897,850	
ジェイテクト	14,400	1,038.00	14,947,200	
不二越	1,200	3,170.00	3,804,000	
日本トムソン	4,400	478.00	2,103,200	
ＴＨＫ	9,300	2,533.50	23,561,550	
ユーシン精機	1,500	660.00	990,000	
前澤給装工業	1,200	1,265.00	1,518,000	
イーグル工業	1,800	2,030.00	3,654,000	
前澤工業	300	1,182.00	354,600	
ＰＩＬＬＡＲ	1,500	4,260.00	6,390,000	
キッツ	5,400	1,048.00	5,659,200	
マキタ	18,500	4,603.00	85,155,500	
三井Ｅ＆Ｓ	8,000	1,111.00	8,888,000	
カナデビア	14,300	1,056.00	15,100,800	

三菱重工業	284,100	2,082.00	591,496,200	
ＩＨＩ	12,100	7,680.00	92,928,000	
スター精密	2,700	1,935.00	5,224,500	
日清紡ホールディングス	12,200	966.00	11,785,200	
イビデン	8,500	4,904.00	41,684,000	
コニカミノルタ	36,300	637.80	23,152,140	
ブラザー工業	21,700	2,984.00	64,752,800	
ミネベアミツミ	28,300	2,735.00	77,400,500	
日立製作所	390,500	4,024.00	1,571,372,000	
三菱電機	178,000	2,340.50	416,609,000	
富士電機	9,900	7,823.00	77,447,700	
安川電機	17,600	4,367.00	76,859,200	
シンフォニアテクノロジー	1,800	4,975.00	8,955,000	
明電舎	3,000	4,020.00	12,060,000	
山洋電気	700	9,030.00	6,321,000	
デンヨー	1,200	2,489.00	2,986,800	
ＰＨＣホールディングス	3,100	1,004.00	3,112,400	
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	8,500	2,869.00	24,386,500	
ソシオネクスト	11,900	2,854.00	33,962,600	
東芝テック	2,100	3,360.00	7,056,000	
芝浦メカトロニクス	900	10,650.00	9,585,000	
マブチモーター	7,200	2,185.00	15,732,000	
ニデック	71,700	3,203.00	229,655,100	
トレックス・セミコンダクター	800	1,502.00	1,201,600	
東光高岳	1,000	1,788.00	1,788,000	
ダブル・スコープ	4,700	348.00	1,635,600	
ダイヘン	1,600	6,210.00	9,936,000	
ヤーマン	3,200	828.00	2,649,600	
ＪＶＣケンウッド	12,800	1,184.00	15,155,200	
ミマキエンジニアリング	1,600	1,332.00	2,131,200	
Ｉ－ＰＥＸ	900	1,533.00	1,379,700	
大崎電気工業	3,500	784.00	2,744,000	
オムロン	12,400	6,119.00	75,875,600	
日東工業	2,200	2,927.00	6,439,400	
ＩＤＥＣ	2,400	2,459.00	5,901,600	
正興電機製作所	300	1,264.00	379,200	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	6,400	2,735.50	17,507,200	
サクサ	100	2,385.00	238,500	
メルコホールディングス	500	2,351.00	1,175,500	
テクノメディカ	500	1,811.00	905,500	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	900	609.00	548,100	
日本電気	21,300	13,375.00	284,887,500	

富士通	149,500	2,971.00	444,164,500	
沖電気工業	7,300	1,003.00	7,321,900	
電気興業	600	1,970.00	1,182,000	
サンケン電気	1,500	6,142.00	9,213,000	
アイホン	900	2,891.00	2,601,900	
ルネサスエレクトロニクス	123,800	2,099.50	259,918,100	
セイコーエプソン	20,800	2,765.50	57,522,400	
ワコム	11,400	675.00	7,695,000	
アルバック	3,600	7,151.00	25,743,600	
アクセル	800	1,383.00	1,106,400	
ＥＩＺＯ	2,400	2,196.00	5,270,400	
日本信号	3,700	925.00	3,422,500	
京三製作所	3,500	540.00	1,890,000	
能美防災	2,200	2,931.00	6,448,200	
ホーチキ	1,200	2,106.00	2,527,200	
星和電機	500	517.00	258,500	
エレコム	3,900	1,432.00	5,584,800	
パナソニック　ホールディングス	192,000	1,244.50	238,944,000	
シャープ	27,400	946.70	25,939,580	
アンリツ	11,400	1,111.00	12,665,400	
富士通ゼネラル	4,600	1,862.00	8,565,200	
ソニーグループ	563,300	2,698.00	1,519,783,400	
ＴＤＫ	128,600	1,858.50	239,003,100	
帝国通信工業	700	2,604.00	1,822,800	
タムラ製作所	6,500	561.00	3,646,500	
アルプスアルパイン	14,500	1,574.00	22,823,000	
日本電波工業	2,000	1,046.00	2,092,000	
鈴木	900	1,872.00	1,684,800	
メイコー	1,600	6,080.00	9,728,000	
日本トリム	400	3,530.00	1,412,000	
フォスター電機	1,200	1,740.00	2,088,000	
ＳＭＫ	400	2,269.00	907,600	
ヨコオ	1,400	1,552.00	2,172,800	
ホシデン	3,700	2,243.00	8,299,100	
ヒロセ電機	2,400	18,040.00	43,296,000	
日本航空電子工業	3,900	2,761.00	10,767,900	
ＴＯＡ	1,900	966.00	1,835,400	
マクセル	3,600	1,847.00	6,649,200	
古野電気	2,100	2,443.00	5,130,300	
スミダコーポレーション	2,200	935.00	2,057,000	
アイコム	600	2,860.00	1,716,000	
リオン	700	2,207.00	1,544,900	

横河電機	17,800	3,464.00	61,659,200	
新電元工業	600	2,371.00	1,422,600	
アズビル	44,200	1,177.50	52,045,500	
東亜ディーケーケー	400	753.00	301,200	
日本光電工業	13,400	2,255.50	30,223,700	
チノー	700	2,189.00	1,532,300	
日本電子材料	1,000	2,493.00	2,493,000	
堀場製作所	3,100	9,251.00	28,678,100	
アドバンテスト	46,100	8,181.00	377,144,100	
エスペック	1,300	2,628.00	3,416,400	
キーエンス	16,100	66,350.00	1,068,235,000	
日置電機	900	8,210.00	7,389,000	
シスメックス	41,600	2,847.50	118,456,000	
日本マイクロニクス	2,700	3,740.00	10,098,000	
メガチップス	1,300	5,490.00	7,137,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	1,000	4,175.00	4,175,000	
原田工業	500	540.00	270,000	
コーセル	1,800	1,208.00	2,174,400	
イリソ電子工業	1,500	2,595.00	3,892,500	
オプテックスグループ	3,000	1,626.00	4,878,000	
千代田インテグレ	600	3,405.00	2,043,000	
レーザーテック	7,400	22,270.00	164,798,000	
スタンレー電気	10,100	2,628.00	26,542,800	
ウシオ電機	7,000	2,068.50	14,479,500	
岡谷電機産業	1,000	229.00	229,000	
日本セラミック	1,500	2,553.00	3,829,500	
遠藤照明	300	1,286.00	385,800	
古河電池	1,200	1,371.00	1,645,200	
山一電機	1,500	2,483.00	3,724,500	
図研	1,300	3,580.00	4,654,000	
日本電子	4,000	5,421.00	21,684,000	
カシオ計算機	11,400	1,123.50	12,807,900	
ファナック	77,800	4,016.00	312,444,800	
日本シイエムケイ	3,900	407.00	1,587,300	
エンプラス	500	6,520.00	3,260,000	
大真空	2,400	599.00	1,437,600	
ローム	29,100	1,710.50	49,775,550	
浜松ホトニクス	25,900	2,020.00	52,318,000	
三井ハイテック	7,100	846.10	6,007,310	
新光電気工業	5,700	5,437.00	30,990,900	
京セラ	99,900	1,719.50	171,778,050	
太陽誘電	7,900	2,771.00	21,890,900	

村田製作所	143,700	2,777.00	399,054,900	
双葉電子工業	3,100	497.00	1,540,700	
ニチコン	4,200	973.00	4,086,600	
日本ケミコン	1,700	1,082.00	1,839,400	
ＫＯＡ	2,500	1,068.00	2,670,000	
市光工業	2,900	449.00	1,302,100	
小糸製作所	16,700	2,010.50	33,575,350	
ミツバ	3,000	875.00	2,625,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	5,500	9,938.00	54,659,000	
キヤノン電子	1,500	2,363.00	3,544,500	
キヤノン	80,200	5,046.00	404,689,200	
リコー	40,300	1,652.50	66,595,750	
象印マホービン	4,800	1,575.00	7,560,000	
東京エレクトロン	34,000	23,860.00	811,240,000	代用有価証券 3,000株
イノテック	1,100	1,472.00	1,619,200	
トヨタ紡織	6,800	1,973.00	13,416,400	
芦森工業	100	2,474.00	247,400	
ユニプレス	2,900	1,111.00	3,221,900	
豊田自動織機	13,800	11,470.00	158,286,000	
モリタホールディングス	2,800	1,942.00	5,437,600	
三櫻工業	2,500	726.00	1,815,000	
デンソー	132,700	2,151.00	285,437,700	
東海理化電機製作所	4,500	2,015.00	9,067,500	
川崎重工業	13,100	5,587.00	73,189,700	
名村造船所	5,000	1,613.00	8,065,000	
日本車輌製造	500	2,118.00	1,059,000	
三菱ロジスネクスト	2,600	1,126.00	2,927,600	
日産自動車	211,500	409.80	86,672,700	
いすゞ自動車	45,100	1,986.00	89,568,600	
トヨタ自動車	855,300	2,707.00	2,315,297,100	代用有価証券 45,000株
日野自動車	24,100	458.50	11,049,850	
三菱自動車工業	62,700	427.50	26,804,250	
レシップホールディングス	500	510.00	255,000	
武蔵精密工業	3,900	1,963.00	7,655,700	
日産車体	1,600	1,021.00	1,633,600	
新明和工業	4,600	1,338.00	6,154,800	
極東開発工業	2,700	2,345.00	6,331,500	
トピー工業	1,300	1,938.00	2,519,400	
ティラド	400	3,430.00	1,372,000	
曙ブレーキ工業	9,500	121.00	1,149,500	
タチエス	3,000	1,776.00	5,328,000	

ＮＯＫ	6,300	2,194.50	13,825,350	
フタバ産業	4,300	713.00	3,065,900	
カヤバ	1,500	4,825.00	7,237,500	
大同メタル工業	3,200	502.00	1,606,400	
プレス工業	6,400	556.00	3,558,400	
ミクニ	800	320.00	256,000	
太平洋工業	3,700	1,362.00	5,039,400	
アイシン	34,000	1,683.00	57,222,000	
マツダ	53,200	1,102.50	58,653,000	
本田技研工業	381,200	1,582.00	603,058,400	
スズキ	118,200	1,530.00	180,846,000	
ＳＵＢＡＲＵ	49,900	2,734.50	136,451,550	
安永	400	511.00	204,400	
ヤマハ発動機	67,900	1,324.00	89,899,600	
エクセディ	2,600	3,795.00	9,867,000	
豊田合成	4,600	2,602.50	11,971,500	
愛三工業	2,700	1,420.00	3,834,000	
ヨロズ	1,500	1,169.00	1,753,500	
エフ・シー・シー	2,900	2,361.00	6,846,900	
シマノ	7,000	23,335.00	163,345,000	
テイ・エス　テック	5,700	1,722.00	9,815,400	
ジャムコ	900	1,245.00	1,120,500	
テルモ	89,700	2,886.50	258,919,050	
日機装	4,200	1,005.00	4,221,000	
日本エム・ディ・エム	1,500	667.00	1,000,500	
島津製作所	21,400	4,514.00	96,599,600	
ＪＭＳ	1,800	480.00	864,000	
長野計器	1,200	2,467.00	2,960,400	
ブイ・テクノロジー	800	2,448.00	1,958,400	
東京計器	1,200	2,960.00	3,552,000	
愛知時計電機	700	1,943.00	1,360,100	
インターアクション	1,000	1,082.00	1,082,000	
東京精密	3,300	8,030.00	26,499,000	
マニー	6,400	1,777.50	11,376,000	
ニコン	23,300	1,840.00	42,872,000	
トプコン	7,700	1,547.50	11,915,750	
オリンパス	92,100	2,678.00	246,643,800	
理研計器	2,300	4,310.00	9,913,000	
タムロン	2,200	4,335.00	9,537,000	
ＨＯＹＡ	31,700	20,100.00	637,170,000	
ノーリツ鋼機	1,500	3,830.00	5,745,000	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	2,400	2,174.00	5,217,600	

朝日インテック	19,600	2,449.00	48,000,400	
シチズン時計	14,700	925.00	13,597,500	
大研医器	600	497.00	298,200	
メニコン	5,500	1,655.00	9,102,500	
シンシア	500	470.00	235,000	
松風	1,400	2,262.00	3,166,800	
セイコーグループ	2,200	3,870.00	8,514,000	
ニプロ	13,400	1,404.50	18,820,300	
三井松島ホールディングス	1,300	4,370.00	5,681,000	
パラマウントベッドホールディングス	3,400	2,489.00	8,462,600	
トランザクション	1,100	2,514.00	2,765,400	
粧美堂	300	493.00	147,900	
ニホンフラッシュ	1,500	884.00	1,326,000	
前田工繊	2,900	1,734.00	5,028,600	
アートネイチャー	1,400	834.00	1,167,600	
フルヤ金属	1,500	3,930.00	5,895,000	
バンダイナムコホールディングス	43,700	3,228.00	141,063,600	
アイフィスジャパン	300	560.00	168,000	
ＳＨＯＥＩ	4,500	2,286.00	10,287,000	
フランスベッドホールディングス	2,100	1,253.00	2,631,300	
パイロットコーポレーション	2,500	4,764.00	11,910,000	
萩原工業	1,100	1,561.00	1,717,100	
フジシールインターナショナル	3,300	2,563.00	8,457,900	
タカラトミー	7,300	3,907.00	28,521,100	
広済堂ホールディングス	5,200	526.00	2,735,200	
プロネクサス	1,700	1,278.00	2,172,600	
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	19,200	4,367.00	83,846,400	
大日本印刷	33,300	2,620.00	87,246,000	
共同印刷	400	3,390.00	1,356,000	
ＮＩＳＳＨＡ	2,800	1,844.00	5,163,200	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	1,000	2,632.00	2,632,000	
アシックス	59,400	2,655.00	157,707,000	
ツツミ	400	2,120.00	848,000	
ローランド	1,200	3,850.00	4,620,000	
小松ウオール工業	1,400	1,502.00	2,102,800	
ヤマハ	29,300	1,250.00	36,625,000	
河合楽器製作所	500	2,792.00	1,396,000	
クリナップ	1,800	707.00	1,272,600	
ピジョン	10,200	1,629.50	16,620,900	
キングジム	1,600	854.00	1,366,400	
リンテック	3,200	3,155.00	10,096,000	
イトーキ	3,200	1,446.00	4,627,200	

任天堂	101,600	8,160.00	829,056,000	代用有価証券 18,000株
三菱鉛筆	2,200	2,454.00	5,398,800	
タカラスタンダード	3,300	1,634.00	5,392,200	
コクヨ	8,000	2,650.50	21,204,000	
ナカバヤシ	2,000	520.00	1,040,000	
グローブライド	1,400	1,868.00	2,615,200	
オカムラ	4,900	1,919.00	9,403,100	
美津濃	1,600	8,000.00	12,800,000	
グリムス	700	2,590.00	1,813,000	
東京電力ホールディングス	145,100	615.30	89,280,030	
中部電力	59,300	1,667.50	98,882,750	
関西電力	62,100	2,464.00	153,014,400	
中国電力	28,000	1,006.50	28,182,000	
北陸電力	16,400	898.00	14,727,200	
東北電力	42,400	1,423.50	60,356,400	
四国電力	15,000	1,224.00	18,360,000	
九州電力	37,100	1,620.00	60,102,000	
北海道電力	15,500	931.80	14,442,900	
沖縄電力	4,100	1,008.00	4,132,800	
電源開発	13,200	2,447.00	32,300,400	
イーレックス	2,900	634.00	1,838,600	
レノバ	4,300	850.00	3,655,000	
東京瓦斯	31,300	3,201.00	100,191,300	
大阪瓦斯	32,100	3,169.00	101,724,900	
東邦瓦斯	7,000	3,721.00	26,047,000	
北海道瓦斯	5,000	576.00	2,880,000	
広島ガス	3,600	382.00	1,375,200	
西部ガスホールディングス	1,700	1,744.00	2,964,800	
静岡ガス	3,700	1,001.00	3,703,700	
メタウォーター	1,900	1,791.00	3,402,900	
ＳＢＳホールディングス	1,400	2,486.00	3,480,400	
東武鉄道	17,600	2,449.00	43,102,400	
相鉄ホールディングス	5,800	2,275.50	13,197,900	
東急	45,100	1,855.50	83,683,050	
京浜急行電鉄	19,900	1,179.50	23,472,050	
小田急電鉄	26,600	1,587.50	42,227,500	
京王電鉄	7,700	3,398.00	26,164,600	
京成電鉄	10,400	3,879.00	40,341,600	
富士急行	2,000	2,515.00	5,030,000	
東日本旅客鉄道	88,700	3,006.00	266,632,200	
西日本旅客鉄道	38,100	2,664.00	101,498,400	
東海旅客鉄道	62,000	3,123.00	193,626,000	

西武ホールディングス	19,400	3,258.00	63,205,200	
鴻池運輸	2,700	2,473.00	6,677,100	
西日本鉄道	4,300	2,170.50	9,333,150	
ハマキョウレックス	5,600	1,259.00	7,050,400	
サカイ引越センター	1,800	2,424.00	4,363,200	
近鉄グループホールディングス	16,100	3,535.00	56,913,500	
阪急阪神ホールディングス	21,400	4,076.00	87,226,400	
南海電気鉄道	7,100	2,220.00	15,762,000	
京阪ホールディングス	8,900	2,802.00	24,937,800	
神戸電鉄	400	2,429.00	971,600	
名古屋鉄道	16,500	1,676.50	27,662,250	
山陽電気鉄道	1,200	2,028.00	2,433,600	
アルプス物流	1,300	5,780.00	7,514,000	
ヤマトホールディングス	19,500	1,605.00	31,297,500	
山九	3,900	4,688.00	18,283,200	
丸全昭和運輸	1,000	5,730.00	5,730,000	
センコーグループホールディングス	8,400	1,387.00	11,650,800	
トナミホールディングス	400	6,100.00	2,440,000	
ニッコンホールディングス	9,900	1,923.00	19,037,700	
福山通運	1,500	3,845.00	5,767,500	
セイノーホールディングス	9,100	2,410.50	21,935,550	
神奈川中央交通	400	3,325.00	1,330,000	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	4,100	1,010.00	4,141,000	
九州旅客鉄道	11,400	3,964.00	45,189,600	
ＳＧホールディングス	26,900	1,508.00	40,565,200	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	6,000	7,489.00	44,934,000	
日本郵船	41,600	5,041.00	209,705,600	
商船三井	34,900	4,989.00	174,116,100	
川崎汽船	36,700	2,113.00	77,547,100	
ＮＳユナイテッド海運	900	4,490.00	4,041,000	
飯野海運	5,900	1,220.00	7,198,000	
乾汽船	1,900	1,111.00	2,110,900	
日本航空	39,400	2,406.50	94,816,100	
ＡＮＡホールディングス	43,700	2,950.50	128,936,850	
パスコ	100	2,131.00	213,100	
トランコム	500	10,330.00	5,165,000	
日新	1,200	4,245.00	5,094,000	
三菱倉庫	3,800	5,161.00	19,611,800	
三井倉庫ホールディングス	1,500	6,950.00	10,425,000	
住友倉庫	4,300	2,648.00	11,386,400	
澁澤倉庫	700	3,150.00	2,205,000	
日本トランスシティ	3,200	919.00	2,940,800	

中央倉庫	900	1,622.00	1,459,800	
川西倉庫	300	1,067.00	320,100	
安田倉庫	1,100	1,678.00	1,845,800	
ファイズホールディングス	300	841.00	252,300	
上組	7,400	3,192.00	23,620,800	
キムラユニティー	300	1,461.00	438,300	
キユーソー流通システム	1,100	1,851.00	2,036,100	
エーアイテイー	1,000	1,772.00	1,772,000	
内外トランスライン	600	2,814.00	1,688,400	
日本コンセプト	600	1,784.00	1,070,400	
ＮＥＣネッツエスアイ	6,300	2,675.00	16,852,500	
クロスキャット	1,000	1,087.00	1,087,000	
システナ	24,400	360.00	8,784,000	
デジタルアーツ	1,000	5,080.00	5,080,000	
日鉄ソリューションズ	5,500	3,460.00	19,030,000	
キューブシステム	1,000	981.00	981,000	
コア	700	1,934.00	1,353,800	
手間いらず	300	3,275.00	982,500	
ラクーンホールディングス	1,500	745.00	1,117,500	
ソリトンシステムズ	1,000	1,267.00	1,267,000	
ソフトクリエイトホールディングス	1,300	2,014.00	2,618,200	
ＴＩＳ	17,000	3,722.00	63,274,000	
グリー	5,400	465.00	2,511,000	
コーエーテクモホールディングス	10,000	1,540.00	15,400,000	
三菱総合研究所	800	4,195.00	3,356,000	
電算	100	1,405.00	140,500	
ＡＧＳ	300	811.00	243,300	
ファインデックス	1,300	850.00	1,105,000	
ブレインパッド	1,300	801.00	1,041,300	
ＫＬａｂ	4,600	175.00	805,000	
ポールトゥウィンホールディングス	2,800	455.00	1,274,000	
ネクソン	35,400	2,658.00	94,093,200	
アイスタイル	5,300	435.00	2,305,500	
エムアップホールディングス	2,000	1,276.00	2,552,000	
エニグモ	2,400	310.00	744,000	
テクノスジャパン	500	629.00	314,500	
コロプラ	5,400	520.00	2,808,000	
ブロードリーフ	6,500	578.00	3,757,000	
クロス・マーケティンググループ	500	681.00	340,500	
デジタルハーツホールディングス	1,200	804.00	964,800	
メディアドゥ	700	1,280.00	896,000	
じげん	4,700	571.00	2,683,700	

フィックスターズ	1,600	1,436.00	2,297,600	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	900	1,421.00	1,278,900	
オプティム	1,600	580.00	928,000	
セレス	800	1,413.00	1,130,400	
ＳＨＩＦＴ	1,100	14,650.00	16,115,000	
ティーガイア	1,700	2,668.00	4,535,600	
セック	200	3,975.00	795,000	
テクマトリックス	2,900	2,198.00	6,374,200	
プロシップ	800	1,500.00	1,200,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,000	3,300.00	13,200,000	
GMOペイメントゲートウェイ	3,700	8,647.00	31,993,900	
システムリサーチ	1,100	1,359.00	1,494,900	
インターネットイニシアティブ	7,700	2,838.00	21,852,600	
さくらインターネット	2,000	4,355.00	8,710,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	2,735.00	1,367,500	
ＳＲＡホールディングス	800	4,215.00	3,372,000	
システムインテグレータ	400	323.00	129,200	
朝日ネット	1,900	628.00	1,193,200	
ｅＢＡＳＥ	2,300	633.00	1,455,900	
アバントグループ	2,000	2,122.00	4,244,000	
アドソル日進	800	1,813.00	1,450,400	
フリービット	800	1,217.00	973,600	
コムチュア	2,300	1,848.00	4,250,400	
アステリア	1,600	503.00	804,800	
アイル	900	3,175.00	2,857,500	
マークラインズ	900	2,736.00	2,462,400	
メディカル・データ・ビジョン	2,100	527.00	1,106,700	
ｇｕｍｉ	3,000	300.00	900,000	
テラスカイ	700	1,828.00	1,279,600	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	800	2,006.00	1,604,800	
ＰＣＩホールディングス	300	946.00	283,800	
ネオジャパン	600	1,894.00	1,136,400	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	400	1,548.00	619,200	
ラクス	7,600	2,035.00	15,466,000	
ランドコンピュータ	400	745.00	298,000	
ダブルスタンダード	600	1,602.00	961,200	
アカツキ	800	2,025.00	1,620,000	
ベネフィットジャパン	100	1,075.00	107,500	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	600	1,348.00	808,800	
カナミックネットワーク	2,100	539.00	1,131,900	
ノムラシステムコーポレーション	1,300	113.00	146,900	
チェンジホールディングス	3,500	1,206.00	4,221,000	

シンクロ・フード	700	467.00	326,900	
オークネット	700	2,477.00	1,733,900	
エイトレッド	100	1,594.00	159,400	
マクロミル	3,100	796.00	2,467,600	
ビーグリー	100	1,409.00	140,900	
オロ	700	2,280.00	1,596,000	
ユーザーローカル	700	1,783.00	1,248,100	
マネーフォワード	4,000	5,066.00	20,264,000	
Ｓｕｎ　Ａｓｔｅｒｉｓｋ	1,200	514.00	616,800	
プラスアルファ・コンサルティング	2,000	2,122.00	4,244,000	
電算システムホールディングス	700	2,638.00	1,846,600	
Ａｐｐｉｅｒ　Ｇｒｏｕｐ	4,900	1,627.00	7,972,300	
ビジョナル	1,900	7,830.00	14,877,000	
ソルクシーズ	700	285.00	199,500	
ハイマックス	600	1,386.00	831,600	
野村総合研究所	34,900	4,854.00	169,404,600	
ＣＥホールディングス	300	409.00	122,700	
日本システム技術	1,500	1,809.00	2,713,500	
インテージホールディングス	1,800	1,550.00	2,790,000	
東邦システムサイエンス	700	1,442.00	1,009,400	
ソースネクスト	7,200	199.00	1,432,800	
シンプレクス・ホールディングス	2,500	2,311.00	5,777,500	
ＨＥＲＯＺ	800	1,323.00	1,058,400	
ラクスル	3,900	1,220.00	4,758,000	
メルカリ	7,800	2,090.00	16,302,000	
ＩＰＳ	500	2,360.00	1,180,000	
システムサポート	600	1,807.00	1,084,200	
イーソル	1,300	711.00	924,300	
東海ソフト	100	1,224.00	122,400	
ウイングアーク１ｓｔ	1,700	3,140.00	5,338,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	700	793.00	555,100	
サーバーワークス	400	2,346.00	938,400	
東名	200	2,128.00	425,600	
トビラシステムズ	200	773.00	154,600	
Ｓａｎｓａｎ	5,300	2,172.00	11,511,600	
Ｌｉｎｋ－Ｕグループ	300	472.00	141,600	
ギフティ	1,400	912.00	1,276,800	
メドレー	1,800	3,875.00	6,975,000	
ベース	800	2,955.00	2,364,000	
ＪＭＤＣ	2,800	4,165.00	11,662,000	
フォーカスシステムズ	1,200	1,076.00	1,291,200	
クレスコ	2,600	1,245.00	3,237,000	

フジ・メディア・ホールディングス	15,400	1,672.50	25,756,500	
オービック	26,900	4,744.00	127,613,600	
ジャストシステム	2,300	3,410.00	7,843,000	
ＴＤＣソフト	3,000	1,171.00	3,513,000	
ＬＩＮＥヤフー	229,400	415.50	95,315,700	
トレンドマイクロ	8,500	8,067.00	68,569,500	
ＩＤホールディングス	1,100	1,406.00	1,546,600	
日本オラクル	3,100	14,805.00	45,895,500	
アルファシステムズ	400	3,190.00	1,276,000	
フューチャー	4,000	1,891.00	7,564,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,000	1,747.00	1,747,000	
オービックビジネスコンサルタント	2,300	7,122.00	16,380,600	
アイティフォー	2,000	1,384.00	2,768,000	
東計電算	500	4,665.00	2,332,500	
エックスネット	100	1,403.00	140,300	
大塚商会	18,200	3,372.00	61,370,400	
サイボウズ	2,200	2,040.00	4,488,000	
電通総研	1,600	5,300.00	8,480,000	
ＡＣＣＥＳＳ	1,700	1,254.00	2,131,800	
デジタルガレージ	2,600	3,020.00	7,852,000	
ＥＭシステムズ	2,600	527.00	1,370,200	
ウェザーニューズ	500	5,860.00	2,930,000	
ＣＩＪ	4,000	406.00	1,624,000	
ビジネスエンジニアリング	400	3,960.00	1,584,000	
WOWOW	1,200	1,011.00	1,213,200	
スカラ	1,700	462.00	785,400	
インテリジェント　ウェイブ	300	850.00	255,000	
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	2,200	2,153.00	4,736,600	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	1,900	515.00	978,500	
ネットワンシステムズ	6,300	3,431.00	21,615,300	
アルゴグラフィックス	1,500	5,070.00	7,605,000	
マーベラス	2,500	566.00	1,415,000	
エイベックス	2,700	1,526.00	4,120,200	
ＢＩＰＲＯＧＹ	4,900	4,722.00	23,137,800	
都築電気	800	2,558.00	2,046,400	
ＴＢＳホールディングス	8,100	3,735.00	30,253,500	
日本テレビホールディングス	14,200	2,302.00	32,688,400	
朝日放送グループホールディングス	1,500	618.00	927,000	
テレビ朝日ホールディングス	3,900	1,973.00	7,694,700	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	12,400	861.00	10,676,400	
テレビ東京ホールディングス	1,200	3,360.00	4,032,000	
ビジョン	2,400	1,046.00	2,510,400	

U－NEXT　HOLDINGS	1,800	4,805.00	8,649,000	
日本通信	15,600	142.00	2,215,200	
クロップス	200	974.00	194,800	
日本電信電話	4,798,800	146.80	704,463,840	代用有価証券 700,000株
ＫＤＤＩ	118,700	4,764.00	565,486,800	
ソフトバンク	2,579,900	188.20	485,537,180	
光通信	1,600	31,000.00	49,600,000	
エムティーアイ	1,200	1,129.00	1,354,800	
GMOインターネットグループ	5,300	2,569.00	13,615,700	
ファイバーゲート	800	1,010.00	808,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	8,500	3,248.00	27,608,000	
学研ホールディングス	2,900	988.00	2,865,200	
ゼンリン	2,700	829.00	2,238,300	
アイネット	1,000	1,551.00	1,551,000	
松竹	800	10,515.00	8,412,000	
東宝	8,900	5,833.00	51,913,700	
東映	2,700	4,855.00	13,108,500	
ＮＴＴデータグループ	42,100	2,399.00	100,997,900	
ピー・シー・エー	900	2,072.00	1,864,800	
ビジネスブレイン太田昭和	600	1,851.00	1,110,600	
ＤＴＳ	3,200	3,880.00	12,416,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,300	5,884.00	42,953,200	
シーイーシー	2,000	1,796.00	3,592,000	
カプコン	28,800	3,325.00	95,760,000	
アイ・エス・ビー	700	1,449.00	1,014,300	
ＳＣＳＫ	11,200	2,801.50	31,376,800	
ＮＳＷ	700	2,979.00	2,085,300	
アイネス	1,300	1,563.00	2,031,900	
ＴＫＣ	2,900	3,910.00	11,339,000	
富士ソフト	4,500	9,230.00	41,535,000	
ＮＳＤ	5,700	3,190.00	18,183,000	
コナミグループ	6,100	13,900.00	84,790,000	
福井コンピュータホールディングス	1,000	2,683.00	2,683,000	
ＪＢＣＣホールディングス	1,100	3,845.00	4,229,500	
ミロク情報サービス	1,500	1,848.00	2,772,000	
ソフトバンクグループ	79,600	9,009.00	717,116,400	
リョーサン菱洋ホールディングス	3,200	2,548.00	8,153,600	
高千穂交易	700	4,040.00	2,828,000	
オルバヘルスケアホールディングス	200	2,015.00	403,000	
伊藤忠食品	400	7,030.00	2,812,000	
エレマテック	1,500	1,697.00	2,545,500	
あらた	2,600	3,430.00	8,918,000	

トーメンデバイス	200	5,930.00	1,186,000	
東京エレクトロン　デバイス	1,700	3,440.00	5,848,000	
円谷フィールズホールディングス	2,800	2,146.00	6,008,800	
双日	18,900	3,259.00	61,595,100	
アルフレッサ　ホールディングス	17,000	2,186.50	37,170,500	
横浜冷凍	4,300	920.00	3,956,000	
神栄	200	1,627.00	325,400	
ラサ商事	900	1,400.00	1,260,000	
アルコニックス	2,200	1,356.00	2,983,200	
神戸物産	13,100	3,802.00	49,806,200	
あい　ホールディングス	2,700	2,327.00	6,282,900	
ダイワボウホールディングス	7,600	2,707.00	20,573,200	
マクニカホールディングス	12,000	1,963.50	23,562,000	
ラクト・ジャパン	700	2,683.00	1,878,100	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,600	1,277.00	3,320,200	
八洲電機	1,400	1,711.00	2,395,400	
メディアスホールディングス	1,200	862.00	1,034,400	
レスター	1,400	2,620.00	3,668,000	
ジオリーブグループ	300	1,075.00	322,500	
大光	500	619.00	309,500	
ＯＣＨＩホールディングス	200	1,334.00	266,800	
ＴＯＫＡＩホールディングス	9,200	927.00	8,528,400	
三洋貿易	1,700	1,443.00	2,453,100	
ビューティガレージ	600	1,477.00	886,200	
ウイン・パートナーズ	1,100	1,205.00	1,325,500	
シップヘルスケアホールディングス	6,100	2,317.00	14,133,700	
明治電機工業	700	1,368.00	957,600	
デリカフーズホールディングス	400	516.00	206,400	
スターティアホールディングス	200	1,910.00	382,000	
コメダホールディングス	4,200	2,840.00	11,928,000	
アセンテック	900	654.00	588,600	
フルサト・マルカホールディングス	1,400	2,188.00	3,063,200	
ヤマエグループホールディングス	1,500	1,890.00	2,835,000	
小野建	1,700	1,488.00	2,529,600	
南陽	300	1,094.00	328,200	
佐鳥電機	1,200	1,887.00	2,264,400	
エコートレーディング	200	913.00	182,600	
伯東	1,000	4,455.00	4,455,000	
コンドーテック	1,300	1,259.00	1,636,700	
ナガイレーベン	2,200	2,229.00	4,903,800	
三菱食品	1,600	4,835.00	7,736,000	
松田産業	1,300	3,140.00	4,082,000	

第一興商	6,600	1,868.50	12,332,100	
メディパルホールディングス	17,200	2,428.50	41,770,200	
ＳＰＫ	700	2,039.00	1,427,300	
萩原電気ホールディングス	700	3,340.00	2,338,000	
アズワン	5,300	2,837.00	15,036,100	
スズデン	600	1,784.00	1,070,400	
シモジマ	1,100	1,307.00	1,437,700	
ドウシシャ	1,600	2,140.00	3,424,000	
高速	1,000	2,554.00	2,554,000	
たけびし	700	2,068.00	1,447,600	
リックス	400	2,629.00	1,051,600	
丸文	1,500	1,043.00	1,564,500	
ハピネット	1,400	3,965.00	5,551,000	
橋本総業ホールディングス	800	1,239.00	991,200	
日本ライフライン	4,600	1,175.00	5,405,000	
タカショー	1,800	494.00	889,200	
ＩＤＯＭ	4,500	1,008.00	4,536,000	
進和	1,000	2,650.00	2,650,000	
エスケイジャパン	200	664.00	132,800	
ダイトロン	700	2,820.00	1,974,000	
シークス	2,400	1,114.00	2,673,600	
オーハシテクニカ	900	1,721.00	1,548,900	
白銅	500	2,367.00	1,183,500	
ダイコー通産	100	1,193.00	119,300	
伊藤忠商事	114,400	7,539.00	862,461,600	
丸紅	141,100	2,348.50	331,373,350	
高島	400	1,206.00	482,400	
長瀬産業	7,600	3,102.00	23,575,200	
蝶理	1,100	3,855.00	4,240,500	
豊田通商	44,700	2,666.50	119,192,550	
三共生興	2,300	588.00	1,352,400	
兼松	7,000	2,314.00	16,198,000	
三井物産	255,000	3,152.00	803,760,000	
日本紙パルプ商事	7,900	667.00	5,269,300	
カメイ	1,800	1,911.00	3,439,800	
ＯＵＧホールディングス	100	2,484.00	248,400	
スターゼン	1,200	2,900.00	3,480,000	
山善	5,200	1,308.00	6,801,600	
椿本興業	1,000	1,862.00	1,862,000	
住友商事	101,900	3,271.00	333,314,900	
内田洋行	700	6,520.00	4,564,000	
三菱商事	326,800	2,805.00	916,674,000	

第一実業	1,600	2,316.00	3,705,600	
キヤノンマーケティングジャパン	4,000	4,495.00	17,980,000	
西華産業	700	3,840.00	2,688,000	
佐藤商事	1,200	1,379.00	1,654,800	
東京産業	1,600	683.00	1,092,800	
ユアサ商事	1,300	4,645.00	6,038,500	
神鋼商事	400	6,230.00	2,492,000	
阪和興業	3,100	5,010.00	15,531,000	
正栄食品工業	1,100	4,465.00	4,911,500	
カナデン	1,300	1,492.00	1,939,600	
ＲＹＯＤＥＮ	1,400	2,470.00	3,458,000	
岩谷産業	15,500	1,981.50	30,713,250	
ナイス	200	1,586.00	317,200	
ニチモウ	200	1,827.00	365,400	
極東貿易	1,000	1,471.00	1,471,000	
アステナホールディングス	3,200	514.00	1,644,800	
三愛オブリ	4,000	1,854.00	7,416,000	
稲畑産業	3,300	3,230.00	10,659,000	
ＧＳＩクレオス	900	2,000.00	1,800,000	
明和産業	2,000	641.00	1,282,000	
ワキタ	2,800	1,574.00	4,407,200	
東邦ホールディングス	4,600	4,558.00	20,966,800	
サンゲツ	3,900	2,769.00	10,799,100	
ミツウロコグループホールディングス	2,200	1,694.00	3,726,800	
シナネンホールディングス	500	6,300.00	3,150,000	
伊藤忠エネクス	4,200	1,546.00	6,493,200	
サンリオ	13,800	4,075.00	56,235,000	
サンワテクノス	900	1,923.00	1,730,700	
新光商事	2,300	938.00	2,157,400	
トーホー	700	2,669.00	1,868,300	
三信電気	700	2,012.00	1,408,400	
東陽テクニカ	1,600	1,584.00	2,534,400	
モスフードサービス	2,500	3,560.00	8,900,000	
加賀電子	3,200	2,796.00	8,947,200	
ソーダニッカ	1,800	1,156.00	2,080,800	
立花エレテック	1,100	2,507.00	2,757,700	
フォーバル	800	1,373.00	1,098,400	
ＰＡＬＴＡＣ	2,300	4,230.00	9,729,000	
三谷産業	2,900	319.00	925,100	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	1,000	1,324.00	1,324,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	2,164.00	216,400	
コーア商事ホールディングス	1,500	604.00	906,000	

ＫＰＰグループホールディングス	4,400	658.00	2,895,200	
ヤマタネ	700	3,230.00	2,261,000	
泉州電業	1,200	4,685.00	5,622,000	
トラスコ中山	3,600	2,287.00	8,233,200	
オートバックスセブン	5,900	1,421.50	8,386,850	
モリト	1,300	1,399.00	1,818,700	
加藤産業	2,100	4,115.00	8,641,500	
イエローハット	2,700	2,471.00	6,671,700	
ＪＫホールディングス	1,300	1,045.00	1,358,500	
日伝	1,100	3,125.00	3,437,500	
杉本商事	1,600	1,384.00	2,214,400	
因幡電機産業	4,400	3,720.00	16,368,000	
東テク	1,700	2,552.00	4,338,400	
ミスミグループ本社	25,700	2,653.50	68,194,950	
蔵王産業	100	2,453.00	245,300	
スズケン	6,100	4,930.00	30,073,000	
ジェコス	1,000	873.00	873,000	
サンエー	2,600	2,896.00	7,529,600	
カワチ薬品	1,300	2,517.00	3,272,100	
エービーシー・マート	7,400	3,008.00	22,259,200	
ハードオフコーポレーション	700	1,908.00	1,335,600	
アスクル	4,100	1,950.00	7,995,000	
ゲオホールディングス	1,900	1,537.00	2,920,300	
アダストリア	2,100	3,500.00	7,350,000	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	300	534.00	160,200	
くら寿司	2,000	3,970.00	7,940,000	
キャンドゥ	600	3,190.00	1,914,000	
パルグループホールディングス	3,400	3,025.00	10,285,000	
エディオン	6,800	1,740.00	11,832,000	
サーラコーポレーション	3,600	864.00	3,110,400	
ハローズ	800	4,235.00	3,388,000	
フジオフードグループ本社	1,900	1,373.00	2,608,700	
あみやき亭	1,200	1,655.00	1,986,000	
大黒天物産	500	10,240.00	5,120,000	
ハニーズホールディングス	1,500	1,698.00	2,547,000	
ファーマライズホールディングス	300	626.00	187,800	
アルペン	1,400	2,030.00	2,842,000	
ハブ	400	741.00	296,400	
クオールホールディングス	2,300	1,389.00	3,194,700	
ジンズホールディングス	1,300	6,110.00	7,943,000	
ビックカメラ	10,100	1,638.00	16,543,800	
ＤＣＭホールディングス	8,700	1,426.00	12,406,200	

ＭｏｎｏｔａＲＯ	24,100	2,298.00	55,381,800	
東京一番フーズ	400	498.00	199,200	
Ｊ．フロント　リテイリング	19,500	1,605.00	31,297,500	
ドトール・日レスホールディングス	3,000	2,222.00	6,666,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	30,900	2,058.00	63,592,200	
ブロンコビリー	1,000	3,670.00	3,670,000	
ＺＯＺＯ	10,900	4,953.00	53,987,700	
トレジャー・ファクトリー	1,200	1,334.00	1,600,800	
物語コーポレーション	3,000	3,560.00	10,680,000	
三越伊勢丹ホールディングス	28,200	2,311.50	65,184,300	
Ｈａｍｅｅ	900	1,025.00	922,500	
ウエルシアホールディングス	8,800	1,937.00	17,045,600	
クリエイトＳＤホールディングス	2,400	3,015.00	7,236,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	900	321.00	288,900	
ティーライフ	200	1,161.00	232,200	
シュッピン	1,600	1,056.00	1,689,600	
オイシックス・ラ・大地	2,300	1,312.00	3,017,600	
ネクステージ	3,900	1,422.00	5,545,800	
ジョイフル本田	4,700	2,015.00	9,470,500	
エターナルホスピタリティグループ	600	3,570.00	2,142,000	
ホットランド	1,300	2,234.00	2,904,200	
すかいらーくホールディングス	23,200	2,330.00	54,056,000	
ＳＦＰホールディングス	800	1,925.00	1,540,000	
綿半ホールディングス	1,300	1,687.00	2,193,100	
ヨシックスホールディングス	400	3,300.00	1,320,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,800	813.00	3,902,400	
ＢＥＥＮＯＳ	1,000	2,947.00	2,947,000	
あさひ	1,600	1,505.00	2,408,000	
日本調剤	1,200	1,396.00	1,675,200	
コスモス薬品	2,900	7,292.00	21,146,800	
トーエル	400	805.00	322,000	
セブン&アイ・ホールディングス	172,300	2,279.00	392,671,700	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	11,400	1,204.00	13,725,600	
ツルハホールディングス	3,600	8,541.00	30,747,600	
サンマルクホールディングス	1,400	2,297.00	3,215,800	
トリドールホールディングス	4,800	3,885.00	18,648,000	
ウイルプラスホールディングス	200	1,020.00	204,000	
ＪＭホールディングス	1,300	2,944.00	3,827,200	
アレンザホールディングス	1,300	1,072.00	1,393,600	
串カツ田中ホールディングス	600	1,549.00	929,400	
バロックジャパンリミテッド	1,300	760.00	988,000	

クスリのアオキホールディングス	5,700	3,210.00	18,297,000	
力の源ホールディングス	1,100	1,098.00	1,207,800	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥ	9,100	2,976.50	27,086,150	
メディカルシステムネットワーク	2,300	427.00	982,100	
一家ホールディングス	300	668.00	200,400	
ノジマ	5,000	1,968.00	9,840,000	
カッパ・クリエイト	2,700	1,602.00	4,325,400	
良品計画	20,200	2,376.00	47,995,200	
アドヴァングループ	1,500	924.00	1,386,000	
アルビス	600	2,705.00	1,623,000	
ハウス　オブ　ローゼ	100	1,485.00	148,500	
Ｇ－７ホールディングス	1,900	1,579.00	3,000,100	
イオン北海道	5,100	884.00	4,508,400	
コジマ	3,300	1,046.00	3,451,800	
コーナン商事	2,100	3,595.00	7,549,500	
エコス	600	2,094.00	1,256,400	
ワタミ	1,900	1,030.00	1,957,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	34,300	3,766.00	129,173,800	
西松屋チェーン	3,400	2,230.00	7,582,000	
ゼンショーホールディングス	8,600	7,549.00	64,921,400	
幸楽苑	1,300	1,251.00	1,626,300	
サイゼリヤ	2,500	5,510.00	13,775,000	
ＶＴホールディングス	6,700	456.00	3,055,200	
魚力	600	2,423.00	1,453,800	
フジ・コーポレーション	800	1,855.00	1,484,000	
ユナイテッドアローズ	2,000	2,195.00	4,390,000	
ハイデイ日高	2,500	2,718.00	6,795,000	
コロワイド	8,700	1,674.50	14,568,150	
壱番屋	6,700	1,035.00	6,934,500	
スギホールディングス	10,200	2,606.50	26,586,300	
薬王堂ホールディングス	800	2,205.00	1,764,000	
スクロール	2,500	949.00	2,372,500	
ヨンドシーホールディングス	1,600	1,837.00	2,939,200	
木曽路	2,600	2,289.00	5,951,400	
ＳＲＳホールディングス	2,800	1,159.00	3,245,200	
千趣会	3,600	314.00	1,130,400	
リテールパートナーズ	2,500	1,300.00	3,250,000	
上新電機	1,700	2,556.00	4,345,200	
日本瓦斯	8,800	2,122.50	18,678,000	
ロイヤルホールディングス	3,000	2,441.00	7,323,000	
いなげや	1,700	1,115.00	1,895,500	
チヨダ	1,700	1,300.00	2,210,000	

ライフコーポレーション	1,800	3,315.00	5,967,000	
リンガーハット	2,200	2,255.00	4,961,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	2,200	692.00	1,522,400	
ＡＯＫＩホールディングス	3,700	1,172.00	4,336,400	
オークワ	2,500	914.00	2,285,000	
コメリ	2,600	3,285.00	8,541,000	
青山商事	3,700	1,301.00	4,813,700	
しまむら	4,000	7,772.00	31,088,000	
はせがわ	700	304.00	212,800	
高島屋	21,700	1,212.00	26,300,400	
松屋	2,900	837.00	2,427,300	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	8,600	2,063.00	17,741,800	
近鉄百貨店	700	2,110.00	1,477,000	
丸井グループ	11,200	2,370.00	26,544,000	
アクシアル　リテイリング	4,700	888.00	4,173,600	
イオン	57,600	3,768.00	217,036,800	
イズミ	3,000	3,181.00	9,543,000	
平和堂	2,900	2,194.00	6,362,600	
フジ	2,600	2,023.00	5,259,800	
ヤオコー	2,000	9,164.00	18,328,000	
ゼビオホールディングス	2,300	1,151.00	2,647,300	
ケーズホールディングス	11,400	1,449.50	16,524,300	
日産東京販売ホールディングス	900	430.00	387,000	
シルバーライフ	700	744.00	520,800	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	1,500	3,180.00	4,770,000	
ナルミヤ・インターナショナル	200	1,226.00	245,200	
ブックオフグループホールディングス	1,200	1,492.00	1,790,400	
ギフトホールディングス	900	3,180.00	2,862,000	
アインホールディングス	2,400	4,950.00	11,880,000	
Ｇｅｎｋｉ　Ｇｌｏｂａｌ　Ｄｉｎｉｎｇ	1,000	4,175.00	4,175,000	
ヤマダホールディングス	52,300	432.30	22,609,290	
アークランズ	5,100	1,665.00	8,491,500	
ニトリホールディングス	6,200	19,510.00	120,962,000	
グルメ杵屋	1,400	1,025.00	1,435,000	
ケーユーホールディングス	1,000	1,054.00	1,054,000	
吉野家ホールディングス	6,300	3,076.00	19,378,800	
松屋フーズホールディングス	800	6,770.00	5,416,000	
サガミホールディングス	2,600	1,760.00	4,576,000	
王将フードサービス	3,900	2,970.00	11,583,000	
ミニストップ	1,300	1,707.00	2,219,100	
アークス	3,100	2,482.00	7,694,200	
バローホールディングス	3,300	2,080.00	6,864,000	

ベルク	900	6,410.00	5,769,000	
大庄	1,100	1,022.00	1,124,200	
ファーストリテイリング	9,600	50,430.00	484,128,000	
サンドラッグ	5,800	3,826.00	22,190,800	
サックスバー　ホールディングス	1,500	898.00	1,347,000	
やまや	100	2,871.00	287,100	
ベルーナ	4,100	708.00	2,902,800	
いよぎんホールディングス	18,800	1,416.00	26,620,800	
しずおかフィナンシャルグループ	34,900	1,221.50	42,630,350	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	13,300	1,433.00	19,058,900	
楽天銀行	7,400	3,035.00	22,459,000	
京都フィナンシャルグループ	19,900	2,252.00	44,814,800	
じもとホールディングス	1,100	297.00	326,700	
めぶきフィナンシャルグループ	73,400	563.70	41,375,580	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	4,100.00	8,200,000	
九州フィナンシャルグループ	30,600	691.50	21,159,900	
ゆうちょ銀行	174,100	1,342.00	233,642,200	
富山第一銀行	5,000	1,045.00	5,225,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	84,300	744.00	62,719,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	8,800	1,656.00	14,572,800	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,636.00	2,290,400	
第四北越フィナンシャルグループ	5,000	2,410.00	12,050,000	
ひろぎんホールディングス	22,300	1,109.00	24,730,700	
おきなわフィナンシャルグループ	1,300	2,236.00	2,906,800	
十六フィナンシャルグループ	2,100	4,000.00	8,400,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,600	4,340.00	6,944,000	
プロクレアホールディングス	1,800	1,789.00	3,220,200	
あいちフィナンシャルグループ	3,300	2,244.00	7,405,200	
あおぞら銀行	11,400	2,558.50	29,166,900	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	965,000	1,562.00	1,507,330,000	代用有価証券 90,000株
りそなホールディングス	181,700	992.60	180,355,420	
三井住友トラストグループ	56,400	3,320.00	187,248,000	
三井住友フィナンシャルグループ	330,500	3,160.00	1,044,380,000	
千葉銀行	44,100	1,106.50	48,796,650	
群馬銀行	30,700	854.60	26,236,220	
武蔵野銀行	2,200	2,629.00	5,783,800	
千葉興業銀行	3,700	1,120.00	4,144,000	
筑波銀行	6,800	225.00	1,530,000	
七十七銀行	4,600	3,880.00	17,848,000	
秋田銀行	1,100	2,080.00	2,288,000	
山形銀行	1,800	978.00	1,760,400	
岩手銀行	1,000	2,286.00	2,286,000	

東邦銀行	12,400	259.00	3,211,600	
東北銀行	300	1,060.00	318,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	13,800	3,465.00	47,817,000	
スルガ銀行	11,900	1,081.00	12,863,900	
八十二銀行	34,000	824.90	28,046,600	
山梨中央銀行	1,800	1,619.00	2,914,200	
大垣共立銀行	3,000	1,820.00	5,460,000	
福井銀行	1,400	1,799.00	2,518,600	
清水銀行	600	1,440.00	864,000	
滋賀銀行	2,600	3,265.00	8,489,000	
南都銀行	2,400	2,989.00	7,173,600	
百五銀行	14,900	548.00	8,165,200	
紀陽銀行	5,700	1,792.00	10,214,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	9,700	1,590.00	15,423,000	
山陰合同銀行	9,800	1,218.00	11,936,400	
鳥取銀行	200	1,221.00	244,200	
百十四銀行	1,600	2,502.00	4,003,200	
四国銀行	2,300	941.00	2,164,300	
阿波銀行	2,200	2,415.00	5,313,000	
大分銀行	1,000	3,040.00	3,040,000	
宮崎銀行	1,000	2,662.00	2,662,000	
佐賀銀行	900	2,040.00	1,836,000	
琉球銀行	3,400	990.00	3,366,000	
セブン銀行	49,500	320.80	15,879,600	
みずほフィナンシャルグループ	213,900	3,115.00	666,298,500	
山口フィナンシャルグループ	15,500	1,492.50	23,133,750	
名古屋銀行	1,000	5,940.00	5,940,000	
北洋銀行	23,900	394.00	9,416,600	
大光銀行	200	1,286.00	257,200	
愛媛銀行	2,100	1,029.00	2,160,900	
トマト銀行	200	1,103.00	220,600	
京葉銀行	6,500	682.00	4,433,000	
栃木銀行	7,800	260.00	2,028,000	
北日本銀行	500	2,454.00	1,227,000	
東和銀行	2,900	574.00	1,664,600	
大東銀行	400	699.00	279,600	
トモニホールディングス	14,900	398.00	5,930,200	
フィデアホールディングス	1,600	1,427.00	2,283,200	
池田泉州ホールディングス	22,000	341.00	7,502,000	
ＦＰＧ	5,700	2,334.00	13,303,800	
ジャパンインベストメントアドバイザー	2,600	1,022.00	2,657,200	
マーキュリアホールディングス	300	879.00	263,700	

ＳＢＩホールディングス	25,500	3,316.00	84,558,000	
ジャフコ　グループ	4,700	2,026.00	9,522,200	
大和証券グループ本社	122,700	1,006.50	123,497,550	
野村ホールディングス	266,500	783.70	208,856,050	
岡三証券グループ	13,800	608.00	8,390,400	
丸三証券	5,300	910.00	4,823,000	
東洋証券	4,300	508.00	2,184,400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,800	480.00	9,024,000	
水戸証券	4,300	448.00	1,926,400	
いちよし証券	3,000	672.00	2,016,000	
松井証券	7,700	786.00	6,052,200	
マネックスグループ	15,500	655.00	10,152,500	
極東証券	2,200	1,290.00	2,838,000	
岩井コスモホールディングス	1,800	1,971.00	3,547,800	
アイザワ証券グループ	2,300	1,701.00	3,912,300	
スパークス・グループ	1,700	1,368.00	2,325,600	
かんぽ生命保険	16,200	2,470.50	40,022,100	
ＦＰパートナー	700	2,759.00	1,931,300	
ＳＯＭＰＯホールディングス	71,500	3,222.00	230,373,000	
アニコム　ホールディングス	5,300	666.00	3,529,800	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	106,400	3,390.00	360,696,000	
第一生命ホールディングス	74,500	3,754.00	279,673,000	
東京海上ホールディングス	154,700	5,521.00	854,098,700	
Ｔ＆Ｄホールディングス	42,500	2,458.00	104,465,000	
アドバンスクリエイト	1,200	767.00	920,400	
ＮＥＸＹＺ．Ｇｒｏｕｐ	400	784.00	313,600	
全国保証	4,100	5,507.00	22,578,700	
あんしん保証	1,300	170.00	221,000	
ジェイリース	1,100	1,393.00	1,532,300	
イントラスト	400	726.00	290,400	
日本モーゲージサービス	700	416.00	291,200	
ＳＢＩアルヒ	1,500	804.00	1,206,000	
プレミアグループ	2,700	2,435.00	6,574,500	
ネットプロテクションズホールディングス	5,300	334.00	1,770,200	
クレディセゾン	10,000	3,419.00	34,190,000	
芙蓉総合リース	1,500	10,755.00	16,132,500	
みずほリース	13,100	997.00	13,060,700	
東京センチュリー	11,800	1,559.00	18,396,200	
日本証券金融	5,800	1,971.00	11,431,800	
アイフル	23,100	315.00	7,276,500	
リコーリース	1,500	4,900.00	7,350,000	
イオンフィナンシャルサービス	9,000	1,210.00	10,890,000	

アコム	28,200	354.40	9,994,080	
ジャックス	1,700	3,780.00	6,426,000	
オリエントコーポレーション	5,200	896.00	4,659,200	
オリックス	95,000	3,233.00	307,135,000	
三菱ＨＣキャピタル	70,600	1,010.00	71,306,000	
日本取引所グループ	81,700	1,806.50	147,591,050	
イー・ギャランティ	2,600	1,504.00	3,910,400	
ＮＥＣキャピタルソリューション	800	3,750.00	3,000,000	
大東建託	5,800	16,780.00	97,324,000	
サムティホールディングス	3,100	3,290.00	10,199,000	
いちご	16,000	410.00	6,560,000	
日本駐車場開発	18,800	222.00	4,173,600	
スター・マイカ・ホールディングス	1,700	659.00	1,120,300	
ＳＲＥホールディングス	700	3,865.00	2,705,500	
ヒューリック	36,900	1,360.00	50,184,000	
野村不動産ホールディングス	8,800	3,768.00	33,158,400	
三重交通グループホールディングス	3,400	518.00	1,761,200	
ディア・ライフ	2,700	823.00	2,222,100	
コーセーアールイー	300	675.00	202,500	
地主	1,400	2,115.00	2,961,000	
プレサンスコーポレーション	2,100	1,869.00	3,924,900	
ＴＨＥグローバル社	400	610.00	244,000	
ＪＰＭＣ	900	1,136.00	1,022,400	
サンセイランディック	300	941.00	282,300	
エストラスト	200	670.00	134,000	
フージャースホールディングス	2,400	1,016.00	2,438,400	
オープンハウスグループ	5,800	5,566.00	32,282,800	
東急不動産ホールディングス	47,600	971.50	46,243,400	
飯田グループホールディングス	15,200	2,152.00	32,710,400	
イーグランド	100	1,349.00	134,900	
ムゲンエステート	400	1,554.00	621,600	
ビーロット	300	1,140.00	342,000	
ファーストブラザーズ	300	1,110.00	333,000	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	1,100	1,034.00	1,137,400	
シーアールイー	700	1,219.00	853,300	
ケイアイスター不動産	800	3,915.00	3,132,000	
アグレ都市デザイン	200	1,498.00	299,600	
グッドコムアセット	1,300	896.00	1,164,800	
ジェイ・エス・ビー	700	2,717.00	1,901,900	
ロードスターキャピタル	900	2,322.00	2,089,800	
イノベーションホールディングス	300	915.00	274,500	
グローバル・リンク・マネジメント	100	2,234.00	223,400	

霞ヶ関キャピタル	700	15,370.00	10,759,000	
パーク２４	12,300	1,864.50	22,933,350	
パラカ	500	1,754.00	877,000	
ミガロホールディングス	200	1,615.00	323,000	
宮越ホールディングス	700	1,724.00	1,206,800	
三井不動産	219,800	1,322.00	290,575,600	
三菱地所	99,400	2,286.00	227,228,400	
平和不動産	2,600	4,120.00	10,712,000	
東京建物	13,800	2,499.00	34,486,200	
京阪神ビルディング	3,000	1,604.00	4,812,000	
住友不動産	22,900	4,602.00	105,385,800	
テーオーシー	2,900	615.00	1,783,500	
レオパレス２１	15,800	552.00	8,721,600	
スターツコーポレーション	2,300	3,540.00	8,142,000	
フジ住宅	2,000	698.00	1,396,000	
空港施設	2,300	574.00	1,320,200	
明和地所	1,100	975.00	1,072,500	
ゴールドクレスト	1,300	3,025.00	3,932,500	
エスリード	700	4,585.00	3,209,500	
日神グループホールディングス	2,500	498.00	1,245,000	
日本エスコン	3,000	966.00	2,898,000	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	8,100	491.00	3,977,100	
イオンモール	8,200	2,026.00	16,613,200	
毎日コムネット	300	719.00	215,700	
カチタス	4,300	1,925.00	8,277,500	
トーセイ	2,600	2,357.00	6,128,200	
サンフロンティア不動産	2,300	1,796.00	4,130,800	
ＦＪネクストホールディングス	1,700	1,138.00	1,934,600	
グランディハウス	1,800	554.00	997,200	
日本空港ビルデング	5,600	5,418.00	30,340,800	
明豊ファシリティワークス	300	847.00	254,100	
ＭＩＸＩ	3,600	2,793.00	10,054,800	
ジェイエイシーリクルートメント	6,000	714.00	4,284,000	
日本M&Aセンターホールディングス	26,400	594.10	15,684,240	
中広	400	441.00	176,400	
ＵＴグループ	2,200	2,559.00	5,629,800	
アイティメディア	600	1,600.00	960,000	
ケアネット	3,400	674.00	2,291,600	
Ｅ・Ｊホールディングス	1,000	1,703.00	1,703,000	
オープンアップグループ	5,000	1,965.00	9,825,000	
コシダカホールディングス	5,000	1,196.00	5,980,000	
アルトナー	200	1,727.00	345,400	

パソナグループ	2,000	2,064.00	4,128,000	
ＣＤＳ	200	1,755.00	351,000	
リンクアンドモチベーション	4,100	572.00	2,345,200	
エス・エム・エス	5,800	2,121.50	12,304,700	
サニーサイドアップグループ	300	538.00	161,400	
パーソルホールディングス	168,100	258.80	43,504,280	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	400	762.00	304,800	
学情	900	1,747.00	1,572,300	
スタジオアリス	800	2,030.00	1,624,000	
エプコ	200	751.00	150,200	
ＮＪＳ	400	4,030.00	1,612,000	
綜合警備保障	27,600	1,058.50	29,214,600	
カカクコム	10,700	2,335.50	24,989,850	
アイロムグループ	700	2,779.00	1,945,300	
セントケア・ホールディング	1,200	733.00	879,600	
ルネサンス	1,300	1,055.00	1,371,500	
ディップ	2,500	2,667.00	6,667,500	
デジタルホールディングス	1,000	973.00	973,000	
新日本科学	1,500	1,234.00	1,851,000	
キャリアデザインセンター	200	1,775.00	355,000	
エムスリー	32,700	1,705.00	55,753,500	
ツカダ・グローバルホールディング	700	393.00	275,100	
ウェルネット	500	692.00	346,000	
ワールドホールディングス	600	1,910.00	1,146,000	
ディー・エヌ・エー	5,900	1,802.00	10,631,800	
博報堂ＤＹホールディングス	21,000	1,223.00	25,683,000	
ぐるなび	3,100	306.00	948,600	
タカミヤ	2,300	442.00	1,016,600	
ファンコミュニケーションズ	2,600	413.00	1,073,800	
ライク	700	1,374.00	961,800	
エスプール	5,300	355.00	1,881,500	
ＷＤＢホールディングス	900	1,717.00	1,545,300	
ティア	900	429.00	386,100	
アドウェイズ	2,500	325.00	812,500	
バリューコマース	1,500	1,114.00	1,671,000	
インフォマート	15,600	363.00	5,662,800	
ＪＰホールディングス	4,200	719.00	3,019,800	
プレステージ・インターナショナル	7,700	677.00	5,212,900	
プロトコーポレーション	1,700	1,418.00	2,410,600	
アミューズ	1,000	1,365.00	1,365,000	
ドリームインキュベータ	500	2,164.00	1,082,000	
クイック	1,200	1,956.00	2,347,200	

電通グループ	17,900	4,710.00	84,309,000	
ぴあ	600	3,060.00	1,836,000	
イオンファンタジー	600	2,558.00	1,534,800	
シーティーエス	2,100	901.00	1,892,100	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	4,900	2,612.00	12,798,800	
アルプス技研	1,400	2,779.00	3,890,600	
日本空調サービス	1,800	1,021.00	1,837,800	
オリエンタルランド	87,500	3,614.00	316,225,000	
ダスキン	3,600	3,999.00	14,396,400	
明光ネットワークジャパン	2,100	666.00	1,398,600	
ファルコホールディングス	700	2,361.00	1,652,700	
ラウンドワン	15,500	952.00	14,756,000	
リゾートトラスト	7,200	2,756.00	19,843,200	
ビー・エム・エル	2,000	2,738.00	5,476,000	
リソー教育	8,400	275.00	2,310,000	
早稲田アカデミー	900	1,641.00	1,476,900	
ユー・エス・エス	37,000	1,272.00	47,064,000	
東京個別指導学院	2,300	397.00	913,100	
サイバーエージェント	36,500	1,016.50	37,102,250	
楽天グループ	116,300	907.80	105,577,140	
クリーク・アンド・リバー社	800	1,599.00	1,279,200	
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	3,300	580.00	1,914,000	
テー・オー・ダブリュー	3,300	324.00	1,069,200	
山田コンサルティンググループ	700	2,055.00	1,438,500	
セントラルスポーツ	600	2,422.00	1,453,200	
フルキャストホールディングス	1,400	1,549.00	2,168,600	
エン・ジャパン	2,700	2,406.00	6,496,200	
リソルホールディングス	100	5,030.00	503,000	
テクノプロ・ホールディングス	9,600	2,714.50	26,059,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	1,100	855.00	940,500	
ＫｅｅＰｅｒ技研	1,000	4,105.00	4,105,000	
楽待	300	698.00	209,400	
三機サービス	200	878.00	175,600	
Ｇｕｎｏｓｙ	1,500	714.00	1,071,000	
イー・ガーディアン	800	1,815.00	1,452,000	
リブセンス	1,000	164.00	164,000	
ジャパンマテリアル	5,100	1,817.00	9,266,700	
ベクトル	2,000	951.00	1,902,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,400	1,251.00	1,751,400	
キャリアリンク	600	2,471.00	1,482,600	
ＩＢＪ	1,600	659.00	1,054,400	
アサンテ	800	1,702.00	1,361,600	

バリューＨＲ	1,500	1,707.00	2,560,500	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	1,300	2,335.00	3,035,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	800	1,002.00	801,600	
ＥＲＩホールディングス	200	1,828.00	365,600	
シグマクシス・ホールディングス	2,200	1,695.00	3,729,000	
ウィルグループ	1,400	972.00	1,360,800	
メドピア	1,600	560.00	896,000	
レアジョブ	500	398.00	199,000	
リクルートホールディングス	119,100	9,217.00	1,097,744,700	
エラン	2,200	860.00	1,892,000	
日本郵政	172,800	1,375.00	237,600,000	
ベルシステム２４ホールディングス	1,800	1,287.00	2,316,600	
鎌倉新書	1,900	513.00	974,700	
一蔵	300	512.00	153,600	
エアトリ	1,200	1,021.00	1,225,200	
ストライク	800	4,385.00	3,508,000	
ソラスト	4,600	484.00	2,226,400	
セラク	700	1,296.00	907,200	
インソース	3,600	977.00	3,517,200	
ベイカレント	12,200	4,950.00	60,390,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	500	836.00	418,000	
アイモバイル	2,400	504.00	1,209,600	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	900	1,028.00	925,200	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,400	2,926.00	15,800,400	
グリーンズ	200	1,505.00	301,000	
エル・ティー・エス	300	1,788.00	536,400	
ミダックホールディングス	1,000	1,783.00	1,783,000	
キュービーネットホールディングス	1,000	1,015.00	1,015,000	
マネジメントソリューションズ	800	1,853.00	1,482,400	
プロレド・パートナーズ	700	483.00	338,100	
フロンティア・マネジメント	700	1,151.00	805,700	
コプロ・ホールディングス	200	1,378.00	275,600	
アンビスホールディングス	3,600	1,878.00	6,760,800	
カーブスホールディングス	4,500	803.00	3,613,500	
フォーラムエンジニアリング	2,300	874.00	2,010,200	
Ｆａｓｔ　Ｆｉｔｎｅｓｓ　Ｊａｐａｎ	700	1,316.00	921,200	
Ｍａｃｂｅｅ　Ｐｌａｎｅｔ	500	2,611.00	1,305,500	
ポピンズ	500	1,389.00	694,500	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	1,300	1,197.00	1,556,100	
コンフィデンス・インターワークス	100	1,692.00	169,200	
アドバンテッジリスクマネジメント	700	567.00	396,900	
リログループ	8,200	1,846.50	15,141,300	

東祥	1,400	672.00	940,800	
ＩＤ＆Ｅホールディングス	1,000	4,395.00	4,395,000	
ビーウィズ	400	1,551.00	620,400	
サンウェルズ	600	1,744.00	1,046,400	
ＴＲＥホールディングス	3,200	1,788.00	5,721,600	
人・夢・技術グループ	700	1,662.00	1,163,400	
ＮＩＳＳＯホールディングス	1,500	801.00	1,201,500	
大栄環境	3,000	3,120.00	9,360,000	
日本管財ホールディングス	1,700	2,630.00	4,471,000	
M＆A総研ホールディングス	1,800	2,754.00	4,957,200	
エイチ・アイ・エス	5,300	1,688.00	8,946,400	
ラックランド	800	1,936.00	1,548,800	
共立メンテナンス	5,200	2,439.00	12,682,800	
イチネンホールディングス	1,800	1,789.00	3,220,200	
建設技術研究所	900	4,510.00	4,059,000	
スペース	1,200	1,147.00	1,376,400	
燦ホールディングス	1,500	1,107.00	1,660,500	
スバル興業	600	3,100.00	1,860,000	
ナガワ	500	6,620.00	3,310,000	
東京都競馬	1,200	4,130.00	4,956,000	
カナモト	2,600	2,754.00	7,160,400	
ニシオホールディングス	1,400	3,730.00	5,222,000	
トランス・コスモス	1,900	3,370.00	6,403,000	
乃村工藝社	7,200	765.00	5,508,000	
藤田観光	700	8,560.00	5,992,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	1,000	1,260.00	1,260,000	
トーカイ	1,500	2,217.00	3,325,500	
白洋舎	100	2,331.00	233,100	
セコム	33,700	5,404.00	182,114,800	
セントラル警備保障	900	2,731.00	2,457,900	
丹青社	3,200	813.00	2,601,600	
メイテックグループホールディングス	5,700	3,086.00	17,590,200	
応用地質	1,600	2,545.00	4,072,000	
船井総研ホールディングス	3,300	2,396.00	7,906,800	
オオバ	400	1,008.00	403,200	
学究社	600	1,906.00	1,143,600	
イオンディライト	1,800	4,315.00	7,767,000	
ナック	1,700	559.00	950,300	
ダイセキ	3,400	3,965.00	13,481,000	
ステップ	600	2,018.00	1,210,800	
合　　計	29,824,500		60,171,635,490	

(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）

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
預金	286,898,610	196,781,854
コール・ローン	3,860,179,962	5,409,605,502
株式	292,245,103,382	438,182,602,948
投資証券	5,687,435,505	8,771,913,614
派生商品評価勘定	59,273,744	274,493,130
未収入金	81,153,485	9,718
未収配当金	214,263,884	252,361,121
未収利息	-	34,698
差入委託証拠金	414,214,306	815,107,993
流動資産合計	302,848,522,878	453,902,910,578
資産合計	302,848,522,878	453,902,910,578
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	83,210,703	6,259,956
未払解約金	1,877,026,677	2,845,585,499
未払利息	1,375	-
流動負債合計	1,960,238,755	2,851,845,455
負債合計	1,960,238,755	2,851,845,455
純資産の部		
元本等		
元本	60,617,205,489	64,836,376,772
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	240,271,078,634	386,214,688,351
元本等合計	300,888,284,123	451,051,065,123
純資産合計	300,888,284,123	451,051,065,123
負債純資産合計	302,848,522,878	453,902,910,578

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

		2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
１．	期首	2022年10月27日	2023年10月27日
	期首元本額	58,419,890,528円	60,617,205,489円
	期首からの追加設定元本額	10,020,807,446円	10,662,451,336円
	期首からの一部解約元本額	7,823,492,485円	6,443,280,053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）	33,033,504,086円	36,022,586,256円
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	113,435,960円	100,356,958円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	313,862,875円	290,891,069円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	674,344,956円	650,033,342円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	811,294,314円	835,188,038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	1,254,888,146円	969,197,889円
	日興五大陸株式ファンド	3,477,499,117円	3,418,980,544円
	インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）	13,258,596円	－円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	75,144,450円	62,045,402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）	5,869,865,622円	5,592,442,193円
	グローバル３倍３分法ファンド（適格機関投資家向け）	8,685,455,095円	6,883,396,555円
	Ｔｒａｃｅｒｓ　グローバル３分法（おとなのバランス）	7,448,649円	19,839,881円
	インデックスファンドＭＳＣＩオール・カントリー（全世界株式）	233,610,327円	4,097,981,363円
	Ｔｒａｃｅｒｓ　ＭＳＣＩオール・カントリー・インデックス（全世界株式）	300,017,123円	613,069,842円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	263,039円	574,085円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）	148,330円	240,690円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	1,338,394,962円	968,780,337円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	15,811,296円	12,378,193円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	46,137,440円	39,937,025円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	73,311,676円	64,723,731円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	73,782,515円	68,162,879円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,205,726,915円	4,125,570,500円
	計	60,617,205,489円	64,836,376,772円
２．	受益権の総数	60,617,205,489口	64,836,376,772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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2022年10月27日 至 2023年10月26日	自 2023年10月27日 至 2024年10月28日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在

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

（有価証券に関する注記）

（2023年10月26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	20,078,428,575
投資証券	△670,055,296
合計	19,408,373,279

（2024年10月28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	104,829,778,640
投資証券	2,117,399,462
合計	106,947,178,102

(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)

（2023年10月26日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,105,221,913	－	3,022,281,000	△82,940,913
合計		3,105,221,913	－	3,022,281,000	△82,940,913

（2024年10月28日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	4,123,723,947	－	4,178,121,320	54,397,373
合計		4,123,723,947	－	4,178,121,320	54,397,373

（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)

（2023年10月26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	2,398,406,226	－	2,456,192,930	57,786,704
	米ドル	2,007,327,400	－	2,061,665,290	54,337,890
	ユーロ	391,078,826	－	394,527,640	3,448,814
	売建	86,125,500	－	84,908,250	1,217,250
	豪ドル	86,125,500	－	84,908,250	1,217,250
合計		2,484,531,726	－	2,541,101,180	59,003,954

（2024年10月28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	3,272,090,160	－	3,488,457,135	216,366,975
	米ドル	2,795,176,030	－	2,993,232,360	198,056,330
	ユーロ	476,914,130	－	495,224,775	18,310,645
	売建	313,261,958	－	315,793,132	△2,531,174
	米ドル	228,120,000	－	230,145,000	△2,025,000
	ユーロ	72,432,968	－	72,879,532	△446,564
	豪ドル	12,708,990	－	12,768,600	△59,610
合計		3,585,352,118	－	3,804,250,267	213,835,801

（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。

①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。

②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）

2023年10月26日現在		2024年10月28日現在	
1口当たり純資産額	4.9637円	1口当たり純資産額	6.9568円
(1万口当たり純資産額)	(49,637円)	(1万口当たり純資産額)	(69,568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	18,890	24.82	468,849.80	
	BAKER HUGHES CO	47,175	37.52	1,770,006.00	
	CHENIERE ENERGY INC	9,880	184.93	1,827,108.40	
	CHEVRON CORP	77,801	150.81	11,733,168.81	
	CHORD ENERGY CORP	2,600	128.85	335,010.00	
	CONOCOPHILLIPS	51,626	104.56	5,398,014.56	
	COTERRA ENERGY INC	32,460	23.85	774,171.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	25,260	39.19	989,939.40	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,580	184.38	1,397,600.40	
	EOG RESOURCES INC	26,282	123.17	3,237,153.94	
	EQT CORP	23,250	37.48	871,410.00	
	EXPAND ENERGY CORP	8,220	84.79	696,973.80	
	EXXON MOBIL CORP	198,509	119.49	23,719,840.41	
	HALLIBURTON CO	37,607	28.25	1,062,397.75	
	HESS CORP	12,700	138.02	1,752,854.00	
	HF SINCLAIR CORP	5,940	43.01	255,479.40	
	KINDER MORGAN INC	91,790	24.95	2,290,160.50	
	MARATHON OIL CORP	28,380	26.46	750,934.80	
	MARATHON PETROLEUM CORP	15,742	152.36	2,398,451.12	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	28,351	51.58	1,462,344.58	
	ONEOK INC	26,380	96.66	2,549,890.80	
	OVINTIV INC	13,280	40.39	536,379.20	
	PHILLIPS 66	18,855	128.17	2,416,645.35	
	SCHLUMBERGER LTD	60,961	41.74	2,544,512.14	
	TARGA RESOURCES CORP	9,510	165.96	1,578,279.60	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	735	1,098.01	807,037.35	
	VALERO ENERGY CORP	14,682	132.40	1,943,896.80	
	WILLIAMS COS INC	55,354	52.50	2,906,085.00	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	10,125	318.02	3,219,952.50	
	ALBEMARLE CORP	4,750	93.51	444,172.50	
	AMCOR PLC	65,600	11.00	721,600.00	
	AVERY DENNISON CORP	3,040	207.16	629,766.40	
	BALL CORP	14,380	64.03	920,751.40	
	CELANESE CORP	4,090	128.87	527,078.30	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,820	83.19	650,545.80	
	CORTEVA INC	29,832	60.35	1,800,361.20	
	CRH PLC	29,300	92.39	2,707,027.00	
	CROWN HOLDINGS INC	6,535	93.70	612,329.50	

DOW INC	31,205	49.70	1,550,888.50	
DUPONT DE NEMOURS INC	19,162	83.30	1,596,194.60	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,815	105.43	507,645.45	
ECOLAB INC	11,060	253.49	2,803,599.40	
FREEPORT-MCMORAN INC	61,328	46.60	2,857,884.80	
INTERNATIONAL PAPER CO	13,670	48.57	663,951.90	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,755	101.45	1,192,544.75	
LINDE PLC	21,260	473.76	10,072,137.60	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,860	87.50	1,125,250.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,720	570.21	1,550,971.20	
MOSAIC CO/THE	13,580	26.94	365,845.20	
NEWMONT CORP	49,002	48.42	2,372,676.84	
NUCOR CORP	9,959	141.47	1,408,899.73	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	225.86	808,578.80	
PPG INDUSTRIES INC	10,334	126.45	1,306,734.30	
RELIANCE INC	2,770	283.54	785,405.80	
RPM INTERNATIONAL INC	4,960	128.45	637,112.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,626	359.04	3,815,159.04	
SMURFIT WESTROCK PLC	22,989	45.84	1,053,815.76	
STEEL DYNAMICS INC	7,090	129.58	918,722.20	
VULCAN MATERIALS CO	5,563	256.54	1,427,132.02	
WESTLAKE CORP	1,360	132.73	180,512.80	
3M CO	23,576	124.75	2,941,106.00	
AECOM	7,170	104.49	749,193.30	
AERCAP HOLDINGS NV	9,760	95.42	931,299.20	
ALLEGION PLC	3,340	142.60	476,284.00	
AMETEK INC	10,233	166.96	1,708,501.68	
AXON ENTERPRISE INC	3,320	444.52	1,475,806.40	
BOEING CO/THE	26,012	155.01	4,032,120.12	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	5,240	180.80	947,392.00	
CARLISLE COS INC	2,250	417.20	938,700.00	
CARRIER GLOBAL CORP	37,428	73.72	2,759,192.16	
CATERPILLAR INC	21,646	385.97	8,354,706.62	
CNH INDUSTRIAL NV	40,400	11.20	452,480.00	
CUMMINS INC	6,355	329.17	2,091,875.35	
DEERE & CO	11,625	407.93	4,742,186.25	
DOVER CORP	6,680	186.98	1,249,026.40	
EATON CORP PLC	17,676	344.49	6,089,205.24	
EMCOR GROUP INC	2,010	428.58	861,445.80	
EMERSON ELECTRIC CO	24,700	108.13	2,670,811.00	
FASTENAL CO	24,326	75.85	1,845,127.10	
FERGUSON ENTERPRISES INC	8,440	196.23	1,656,181.20	
FORTIVE CORP	14,854	74.97	1,113,604.38	

FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	5,050	85.49	431,724.50	
GE VERNOVA INC	11,966	293.54	3,512,499.64	
GENERAL DYNAMICS CORP	10,277	302.52	3,108,998.04	
GENERAL ELECTRIC CO	48,197	179.10	8,632,082.70	
GRACO INC	8,120	82.14	666,976.80	
HEICO CORP	1,800	253.80	456,840.00	
HEICO CORP-CLASS A	3,120	197.70	616,824.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	29,006	208.00	6,033,248.00	
HOWMET AEROSPACE INC	17,943	101.39	1,819,240.77	
HUBBELL INC	2,320	444.52	1,031,286.40	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,530	253.83	388,359.90	
IDEX CORP	3,640	202.82	738,264.80	
ILLINOIS TOOL WORKS	12,835	254.08	3,261,116.80	
INGERSOLL-RAND INC	16,398	96.12	1,576,175.76	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,570	37.05	243,418.50	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	29,834	76.74	2,289,461.16	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	8,570	252.81	2,166,581.70	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,385	609.18	843,714.30	
LOCKHEED MARTIN CORP	9,486	562.29	5,333,882.94	
MASCO CORP	9,849	81.26	800,329.74	
NORDSON CORP	2,345	248.10	581,794.50	
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,154	519.35	3,196,079.90	
OTIS WORLDWIDE CORP	17,124	101.26	1,733,976.24	
OWENS CORNING	3,550	181.90	645,745.00	
PACCAR INC	21,896	105.90	2,318,786.40	
PARKER HANNIFIN CORP	5,775	621.74	3,590,548.50	
PENTAIR PLC	6,918	98.96	684,605.28	
QUANTA SERVICES INC	6,700	308.17	2,064,739.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,178	269.86	1,397,335.08	
RTX CORP	58,476	125.16	7,318,856.16	
SMITH (A.O.) CORP	5,020	76.87	385,887.40	
SNAP-ON INC	2,525	326.58	824,614.50	
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,226	101.98	736,907.48	
TEXTRON INC	7,956	82.35	655,176.60	
TORO CO	4,950	81.70	404,415.00	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	10,066	392.57	3,951,609.62	
TRANSDIGM GROUP INC	2,560	1,354.83	3,468,364.80	
UNITED RENTALS INC	3,005	812.50	2,441,562.50	
VERTIV HOLDINGS CO	16,260	112.17	1,823,884.20	
WABTEC CORP	8,150	188.76	1,538,394.00	
WATSCO INC	1,540	475.90	732,886.00	
WW GRAINGER INC	1,847	1,090.94	2,014,966.18	
XYLEM INC	10,898	130.42	1,421,317.16	

AUTOMATIC DATA PROCESSING	18,051	287.96	5,197,965.96	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,910	181.93	1,075,206.30	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	5,230	214.03	1,119,376.90	
CINTAS CORP	15,528	207.41	3,220,662.48	
COPART INC	37,560	51.71	1,942,227.60	
DAYFORCE INC	7,010	64.84	454,528.40	
EQUIFAX INC	5,024	269.89	1,355,927.36	
JACOBS SOLUTIONS INC	6,200	140.52	871,224.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	5,950	168.71	1,003,824.50	
PAYCHEX INC	14,002	140.33	1,964,900.66	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,765	164.63	455,201.95	
REPUBLIC SERVICES INC	9,560	199.83	1,910,374.80	
ROLLINS INC	14,385	46.54	669,477.90	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	70.04	593,238.80	
TRANSUNION	7,940	103.59	822,504.60	
VERALTO CORP	11,363	104.05	1,182,320.15	
VERISK ANALYTICS INC	6,310	264.65	1,669,941.50	
WASTE CONNECTIONS INC	11,916	175.80	2,094,832.80	
WASTE MANAGEMENT INC	17,874	206.80	3,696,343.20	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,930	108.12	533,031.60	
CSX CORP	84,959	33.27	2,826,585.93	
DELTA AIR LINES INC	8,345	54.12	451,631.40	
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,467	119.84	775,005.28	
FEDEX CORP	10,298	272.12	2,802,291.76	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	77,000	4.07	313,390.00	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,750	174.83	655,612.50	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,140	52.55	322,657.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,745	251.09	2,446,872.05	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,450	197.79	1,671,325.50	
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	29.43	160,982.10	
U-HAUL HOLDING CO	3,375	65.56	221,265.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	83,530	77.62	6,483,598.60	
UNION PACIFIC CORP	26,946	230.30	6,205,663.80	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	32,557	137.43	4,474,308.51	
APTIV PLC	12,290	69.31	851,819.90	
FORD MOTOR COMPANY	177,905	11.07	1,969,408.35	
GENERAL MOTORS CORP	52,355	52.07	2,726,124.85	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	39,110	10.45	408,699.50	
TESLA INC	126,915	269.19	34,164,248.85	
DECKERS OUTDOOR CORP	7,320	168.11	1,230,565.20	
DR HORTON INC	12,896	179.24	2,311,479.04	
GARMIN LTD	7,025	162.30	1,140,157.50	
LENNAR CORP-CL A	10,040	173.28	1,739,731.20	

LULULEMON ATHLETICA INC	5,360	304.15	1,630,244.00	
NIKE INC -CL B	54,038	78.85	4,260,896.30	
NVR INC	148	9,329.74	1,380,801.52	
PULTE GROUP INC	8,850	132.47	1,172,359.50	
AIRBNB INC-CLASS A	18,550	134.58	2,496,459.00	
BOOKING HOLDINGS INC	1,498	4,347.82	6,513,034.36	
CARNIVAL CORP	43,817	20.91	916,213.47	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	60,100	59.44	3,572,344.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	4,853	159.92	776,091.76	
DOMINO'S PIZZA INC	1,375	413.81	568,988.75	
DOORDASH INC - A	12,760	153.88	1,963,508.80	
DRAFTKINGS INC-CL A	20,420	36.47	744,717.40	
EXPEDIA GROUP INC	6,032	158.39	955,408.48	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	7,820	224.92	1,758,874.40	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,650	236.11	2,514,571.50	
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,680	154.56	259,660.80	
LAS VEGAS SANDS CORP	16,310	52.76	860,515.60	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,673	262.12	2,797,606.76	
MCDONALD'S CORP	31,791	292.61	9,302,364.51	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	12,900	40.36	520,644.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,018	200.91	2,213,626.38	
STARBUCKS CORP	50,054	97.31	4,870,754.74	
WYNN RESORTS LTD	4,180	97.99	409,598.20	
YUM! BRANDS INC	13,354	133.04	1,776,616.16	
ALPHABET INC-CL A	259,790	165.27	42,935,493.30	
ALPHABET INC-CL C	223,110	166.99	37,257,138.90	
CHARTER COMMUNICATION-A	4,316	336.00	1,450,176.00	
COMCAST CORP-CLASS A	173,804	41.66	7,240,674.64	
ELECTRONIC ARTS INC	10,834	145.20	1,573,096.80	
FOX CORP - CLASS A	13,084	41.71	545,733.64	
FOX CORP- CLASS B	5,466	38.35	209,621.10	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,096	29.80	449,860.80	
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	10,280	79.15	813,662.00	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,420	116.32	746,774.40	
MATCH GROUP INC	10,912	37.21	406,035.52	
META PLATFORMS INC-CLASS A	96,790	573.25	55,484,867.50	
NETFLIX INC	19,065	754.68	14,387,974.20	
NEWS CORP - CLASS A	14,750	25.99	383,352.50	
OMNICOM GROUP	9,397	100.52	944,586.44	
PARAMOUNT GLOBAL	22,823	10.27	234,392.21	
PINTEREST INC- CLASS A	27,330	32.35	884,125.50	
ROBLOX CORP -CLASS A	21,110	42.14	889,575.40	
ROKU INC	6,620	75.27	498,287.40	

SEA LTD-ADR	16,470	99.15	1,633,000.50	
SNAP INC - A	45,300	10.45	473,385.00	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	7,240	161.79	1,171,359.60	
THE WALT DISNEY CO.	81,122	95.03	7,709,023.66	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	19,370	119.47	2,314,133.90	
WARNER BROS DISCOVERY INC	94,890	7.60	721,164.00	
AMAZON.COM INC	413,920	187.83	77,746,593.60	
AUTOZONE INC	722	3,130.96	2,260,553.12	
BATH & BODY WORKS INC	9,270	30.38	281,622.60	
BEST BUY CO INC	7,814	92.68	724,201.52	
BURLINGTON STORES INC	2,935	251.65	738,592.75	
CARMAX INC	8,089	72.00	582,408.00	
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,600	204.37	531,362.00	
EBAY INC	21,897	63.10	1,381,700.70	
GENUINE PARTS CO	5,751	114.24	656,994.24	
GLOBAL-E ONLINE LTD	5,190	37.95	196,960.50	
HOME DEPOT INC	43,925	398.91	17,522,121.75	
LKQ CORP	10,260	37.55	385,263.00	
LOWE'S COS INC	25,272	267.64	6,763,798.08	
MERCADOLIBRE INC	2,020	2,047.35	4,135,647.00	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,610	1,195.22	3,119,524.20	
POOL CORP	1,540	366.00	563,640.00	
ROSS STORES INC	14,742	144.22	2,126,091.24	
TJX COMPANIES INC	50,336	113.82	5,729,243.52	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,530	272.77	1,235,648.10	
ULTA BEAUTY INC	2,100	373.30	783,930.00	
WILLIAMS-SONOMA INC	6,000	134.76	808,560.00	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	17,570	18.41	323,463.70	
COSTCO WHOLESALE CORP	19,584	891.22	17,453,652.48	
DOLLAR GENERAL CORP	9,855	80.38	792,144.90	
DOLLAR TREE INC	8,986	66.45	597,119.70	
KROGER CO	30,580	57.37	1,754,374.60	
SYSCO CORP	20,636	73.92	1,525,413.12	
TARGET CORP	19,870	151.16	3,003,549.20	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	30,782	9.26	285,041.32	
WALMART INC	195,256	82.51	16,110,572.56	
ALTRIA GROUP INC	76,018	49.71	3,778,854.78	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,143	56.56	1,252,408.08	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	10,590	48.37	512,238.30	
BUNGE GLOBAL SA	5,847	89.78	524,943.66	
CAMPBELL SOUP CO	7,885	47.07	371,146.95	
CELSIUS HOLDINGS INC	6,050	31.66	191,543.00	
COCA-COLA CO/THE	180,712	66.92	12,093,247.04	

COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	10,150	77.98	791,497.00	
CONAGRA BRANDS INC	20,640	29.43	607,435.20	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,870	239.38	1,644,540.60	
GENERAL MILLS INC	25,189	68.30	1,720,408.70	
HERSHEY CO/THE	6,245	181.26	1,131,968.70	
HORMEL FOODS CORP	15,290	31.06	474,907.40	
JM SMUCKER CO/THE	4,100	116.07	475,887.00	
KELLANOVA	11,098	80.88	897,606.24	
KEURIG DR PEPPER INC	46,480	34.58	1,607,278.40	
KRAFT HEINZ CO/THE	38,121	34.74	1,324,323.54	
LAMB WESTON HOLDING INC	6,150	76.92	473,058.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,420	77.86	811,301.20	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,570	55.77	422,178.90	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	59,855	69.23	4,143,761.65	
MONSTER BEVERAGE CORP	31,880	53.37	1,701,435.60	
PEPSICO INC	61,051	171.79	10,487,951.29	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	68,418	129.86	8,884,761.48	
TYSON FOODS INC-CL A	12,336	58.67	723,753.12	
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,310	100.84	1,039,660.40	
CLOROX COMPANY	5,266	156.69	825,129.54	
COLGATE-PALMOLIVE CO	34,820	95.61	3,329,140.20	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	10,080	87.25	879,480.00	
KENVUE INC	89,200	22.64	2,019,488.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	14,753	135.52	1,999,326.56	
PROCTER & GAMBLE CO	104,529	168.22	17,583,868.38	
ABBOTT LABORATORIES	77,176	114.22	8,815,042.72	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,060	219.30	671,058.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC	23,599	35.97	848,856.03	
BECTON DICKINSON AND CO	12,277	238.13	2,923,522.01	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	65,518	84.73	5,551,340.14	
CARDINAL HEALTH INC	10,305	110.89	1,142,721.45	
CENCORA INC	8,304	234.47	1,947,038.88	
CENTENE CORP	22,367	64.22	1,436,408.74	
CIGNA GROUP/THE	12,530	316.85	3,970,130.50	
COOPER COS INC/THE	9,240	107.82	996,256.80	
CVS HEALTH CORP	54,808	56.49	3,096,103.92	
DAVITA INC	2,108	156.99	330,934.92	
DEXCOM INC	16,520	73.44	1,213,228.80	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	26,110	69.38	1,811,511.80	
ELEVANCE HEALTH INC	10,326	425.27	4,391,338.02	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	19,125	88.42	1,691,032.50	
HCA HEALTHCARE INC	8,580	363.55	3,119,259.00	
HENRY SCHEIN INC	5,280	70.00	369,600.00	

HOLOGIC INC	9,858	80.83	796,822.14	
HUMANA INC	5,055	260.73	1,317,990.15	
IDEXX LABORATORIES INC	3,720	451.41	1,679,245.20	
INSULET CORP	2,745	233.63	641,314.35	
INTUITIVE SURGICAL INC	15,745	511.27	8,049,946.15	
LABCORP HOLDINGS INC	4,005	228.63	915,663.15	
MCKESSON CORP	5,929	507.41	3,008,433.89	
MEDTRONIC PLC	58,348	90.59	5,285,745.32	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,655	325.54	864,308.70	
QUEST DIAGNOSTICS	5,276	155.04	817,991.04	
RESMED INC	6,510	256.07	1,667,015.70	
SOLVENTUM CORP	5,894	73.19	431,381.86	
STERIS PLC	4,240	224.12	950,268.80	
STRYKER CORP	15,243	352.82	5,378,035.26	
TELEFLEX INC	2,290	233.63	535,012.70	
UNITEDHEALTH GROUP INC	40,650	564.56	22,949,364.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,720	202.75	551,480.00	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	6,870	212.23	1,458,020.10	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,902	102.35	1,013,469.70	
ABBVIE INC	77,866	187.85	14,627,128.10	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,750	130.19	1,659,922.50	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,760	284.86	1,640,793.60	
AMGEN INC	23,641	316.98	7,493,724.18	
AVANTOR INC	27,110	22.43	608,077.30	
BIO-RAD LABORATORIES-A	950	320.23	304,218.50	
BIO-TECHNE CORP	6,730	68.68	462,216.40	
BIOGEN INC	6,663	181.69	1,210,600.47	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,380	69.73	584,337.40	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	90,215	51.92	4,683,962.80	
CATALENT INC	7,860	59.09	464,447.40	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,420	182.12	440,730.40	
DANAHER CORP	29,569	245.39	7,255,936.91	
ELI LILLY & CO	35,659	892.70	31,832,789.30	
EXACT SCIENCES CORP	7,370	69.11	509,340.70	
GILEAD SCIENCES INC	55,584	89.00	4,946,976.00	
ILLUMINA INC	6,855	141.95	973,067.25	
INCYTE CORP	7,670	65.07	499,086.90	
IQVIA HOLDINGS INC	8,208	214.63	1,761,683.04	
JOHNSON & JOHNSON	106,491	160.88	17,132,272.08	
MERCK & CO. INC.	112,083	103.98	11,654,390.34	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	965	1,292.77	1,247,523.05	
MODERNA INC	14,425	53.09	765,823.25	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,120	116.08	478,249.60	

PFIZER INC	251,520	28.45	7,155,744.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,815	933.02	4,492,491.30	
REVVITY INC	4,910	116.33	571,180.30	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,800	26.95	506,660.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	49,020	17.90	877,458.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	16,929	554.38	9,385,099.02	
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,900	348.65	662,435.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,465	477.70	5,476,830.50	
VIATRIS INC	53,899	11.44	616,604.56	
WATERS CORP	2,661	324.55	863,627.55	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,550	307.92	1,093,116.00	
ZOETIS INC	20,385	180.01	3,669,503.85	
BANK OF AMERICA CORP	311,349	41.89	13,042,409.61	
CITIGROUP INC	85,007	61.76	5,250,032.32	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,310	41.51	801,558.10	
FIFTH THIRD BANCORP	29,319	43.22	1,267,167.18	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	450	1,881.83	846,823.50	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	68,620	15.38	1,055,375.60	
JPMORGAN CHASE & CO	126,780	222.31	28,184,461.80	
KEYCORP	36,108	17.04	615,280.32	
M & T BANK CORP	8,063	192.57	1,552,691.91	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	17,950	185.82	3,335,469.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	40,884	23.50	960,774.00	
TRUIST FINANCIAL CORP	61,350	42.63	2,615,350.50	
US BANCORP	70,761	47.74	3,378,130.14	
WELLS FARGO & CO	154,290	64.53	9,956,333.70	
ALLY FINANCIAL INC	12,240	34.42	421,300.80	
AMERICAN EXPRESS CO	25,434	267.35	6,799,779.90	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,225	504.48	2,131,428.00	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	16,940	143.09	2,423,944.60	
ARES MANAGEMENT CORP-A	8,510	169.47	1,442,189.70	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	32,742	75.20	2,462,198.40	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	58,535	454.01	26,575,475.35	
BLACKROCK INC	6,620	974.07	6,448,343.40	
BLACKSTONE INC	31,620	167.50	5,296,350.00	
BLOCK INC	25,180	72.61	1,828,319.80	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,385	161.27	2,803,678.95	
CARLYLE GROUP INC/THE	12,810	50.22	643,318.20	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,570	212.82	972,587.40	
CME GROUP INC	15,350	226.14	3,471,249.00	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	8,570	205.04	1,757,192.80	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	12,150	31.55	383,332.50	
CORPAY INC	2,880	340.72	981,273.60	

DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,750	148.90	1,600,675.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,420	44.97	648,467.40	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,590	454.94	723,354.60	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	26,148	89.72	2,345,998.56	
FISERV INC	25,854	199.52	5,158,390.08	
FRANKLIN RESOURCES INC	11,755	20.37	239,449.35	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	92.58	231,450.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	10,989	99.13	1,089,339.57	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,193	512.60	7,275,331.80	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	25,540	165.31	4,222,017.40	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,200	182.44	583,808.00	
KKR & CO INC -A	27,920	139.88	3,905,449.60	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,185	260.93	831,062.05	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,545	286.45	442,565.25	
MASTERCARD INC - A	36,610	507.36	18,574,449.60	
MOODY'S CORP	7,072	462.80	3,272,921.60	
MORGAN STANLEY	54,193	116.88	6,334,077.84	
MSCI INC	3,715	588.72	2,187,094.80	
NASDAQ INC	19,695	74.69	1,471,019.55	
NORTHERN TRUST CORP	9,930	100.19	994,886.70	
PAYPAL HOLDINGS INC	42,267	81.70	3,453,213.90	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,470	144.91	1,227,387.70	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	23,380	27.06	632,662.80	
S&P GLOBAL INC	14,215	490.61	6,974,021.15	
SCHWAB (CHARLES) CORP	67,403	71.82	4,840,883.46	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,375	75.10	328,562.50	
STATE STREET CORP	12,947	90.38	1,170,149.86	
SYNCHRONY FINANCIAL	19,010	55.15	1,048,401.50	
T ROWE PRICE GROUP INC	10,315	111.33	1,148,368.95	
TOAST INC-CLASS A	18,170	29.49	535,833.30	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,200	132.50	556,500.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	69,752	281.73	19,651,230.96	
AFLAC INC	23,424	109.75	2,570,784.00	
ALLSTATE CORP	11,983	188.12	2,254,241.96	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,660	129.41	344,230.60	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	30,345	76.82	2,331,102.90	
AON PLC	8,567	375.44	3,216,394.48	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	16,205	105.30	1,706,386.50	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,950	282.97	2,815,551.50	
ASSURANT INC	2,470	191.77	473,671.90	
BROWN & BROWN INC	10,940	103.98	1,137,541.20	
CHUBB LTD	16,995	287.99	4,894,390.05	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,350	141.25	1,038,187.50	

ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,090	444.02	483,981.80	
EVEREST GROUP LTD	1,989	379.61	755,044.29	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	11,071	59.96	663,817.16	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,382	112.26	1,390,003.32	
LOEWS CORP	9,765	79.57	777,001.05	
MARKEL GROUP INC	530	1,549.80	821,394.00	
MARSH & MCLENNAN COS	21,888	221.31	4,844,033.28	
METLIFE INC	26,335	82.39	2,169,740.65	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,520	83.71	796,919.20	
PROGRESSIVE CORP	25,750	243.78	6,277,335.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,962	123.46	1,847,208.52	
TRAVELERS COS INC/THE	10,189	250.50	2,552,344.50	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,848	290.45	1,408,101.60	
WR BERKLEY CORP	12,136	58.16	705,829.76	
ACCENTURE PLC-CL A	27,723	360.80	10,002,458.40	
ADOBE INC	19,589	483.72	9,475,591.08	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,030	101.97	614,879.10	
ANSYS INC	3,935	322.81	1,270,257.35	
APPLOVIN CORP-CLASS A	9,200	161.63	1,486,996.00	
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,300	236.77	307,801.00	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	6,850	188.73	1,292,800.50	
AUTODESK INC	9,390	286.04	2,685,915.60	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	9,480	49.15	465,942.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	11,820	257.30	3,041,286.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,840	207.16	795,494.40	
CLOUDFLARE INC-CLASS A	13,050	88.76	1,158,318.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	21,758	74.82	1,627,933.56	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,980	300.62	3,000,187.60	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,920	290.04	556,876.80	
DATADOG INC-CLASS A	11,930	126.60	1,510,338.00	
DOCUSIGN INC	8,320	68.99	573,996.80	
DYNATRACE INC	12,980	54.07	701,828.60	
EPAM SYSTEMS INC	2,500	191.52	478,800.00	
FAIR ISAAC CORP	1,120	1,999.97	2,239,966.40	
FORTINET INC	28,035	80.34	2,252,331.90	
GARTNER INC	3,490	513.36	1,791,626.40	
GEN DIGITAL INC	24,365	26.97	657,124.05	
GODADDY INC-CLASS A	6,020	160.53	966,390.60	
HUBSPOT INC	2,075	565.67	1,173,765.25	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	40,692	214.67	8,735,351.64	
INTUIT INC	12,401	609.27	7,555,557.27	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	3,220	275.70	887,754.00	
MICROSOFT CORP	311,884	428.15	133,533,134.60	

MICROSTRATEGY INC-CL A	7,160	234.34	1,677,874.40	
MONDAY.COM LTD	1,970	299.61	590,231.70	
MONGODB INC	3,420	268.74	919,090.80	
OKTA INC	7,610	72.24	549,746.40	
ORACLE CORP	72,973	173.52	12,662,274.96	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	90,090	44.86	4,041,437.40	
PALO ALTO NETWORKS INC	14,395	366.44	5,274,903.80	
PTC INC	5,250	187.01	981,802.50	
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,990	542.00	2,704,580.00	
SALESFORCE INC	42,956	290.46	12,476,999.76	
SAMSARA INC-CL A	9,840	47.69	469,269.60	
SERVICENOW INC	9,040	950.85	8,595,684.00	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	13,900	116.04	1,612,956.00	
SYNOPSYS INC	6,732	501.58	3,376,636.56	
TWILIO INC - A	7,225	70.47	509,145.75	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,830	605.86	1,108,723.80	
VERISIGN INC	4,530	181.26	821,107.80	
WIX.COM LTD	2,280	164.27	374,535.60	
WORKDAY INC-CLASS A	9,170	237.71	2,179,800.70	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	12,150	72.63	882,454.50	
ZSCALER INC	3,630	184.96	671,404.80	
AMPHENOL CORP-CL A	53,530	69.41	3,715,517.30	
APPLE INC	643,644	231.41	148,945,658.04	
ARISTA NETWORKS INC	11,860	394.09	4,673,907.40	
CDW CORP/DE	5,895	217.01	1,279,273.95	
CISCO SYSTEMS INC	177,400	55.74	9,888,276.00	
CORNING INC	38,258	46.25	1,769,432.50	
DELL TECHNOLOGIES -C	12,542	122.55	1,537,022.10	
F5 INC	2,385	216.87	517,234.95	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	57,545	19.46	1,119,825.70	
HP INC	45,695	36.88	1,685,231.60	
JABIL INC	5,590	124.72	697,184.80	
JUNIPER NETWORKS INC	13,453	39.08	525,743.24	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,160	155.98	1,116,816.80	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,290	462.32	3,370,312.80	
NETAPP INC	9,416	119.41	1,124,364.56	
PURE STORAGE INC - CLASS A	13,200	54.05	713,460.00	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	9,164	103.01	943,983.64	
SUPER MICRO COMPUTER INC	22,800	47.27	1,077,756.00	
TE CONNECTIVITY PLC	14,145	149.13	2,109,443.85	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,020	469.19	947,763.80	
TRIMBLE INC	11,410	60.90	694,869.00	
WESTERN DIGITAL CORP	14,028	69.45	974,244.60	

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,075	360.09	747,186.75	
AT&T INC	316,447	21.83	6,908,038.01	
T-MOBILE US INC	23,319	226.36	5,278,488.84	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	186,197	41.38	7,704,831.86	
AES CORP	27,958	16.96	474,167.68	
ALLIANT ENERGY CORP	12,150	60.74	737,991.00	
AMEREN CORPORATION	12,892	87.80	1,131,917.60	
AMERICAN ELECTRIC POWER	22,348	98.19	2,194,350.12	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,295	137.66	1,279,549.70	
ATMOS ENERGY CORP	6,760	140.72	951,267.20	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,272	29.31	916,582.32	
CMS ENERGY CORP	15,200	70.76	1,075,552.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	16,506	104.60	1,726,527.60	
CONSTELLATION ENERGY	14,338	264.41	3,791,110.58	
DOMINION ENERGY INC	36,341	59.58	2,165,196.78	
DTE ENERGY COMPANY	8,318	126.57	1,052,809.26	
DUKE ENERGY CORP	34,456	117.21	4,038,587.76	
EDISON INTERNATIONAL	16,329	83.91	1,370,166.39	
ENTERGY CORP	9,247	135.38	1,251,858.86	
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,210	38.84	435,396.40	
EVERGY INC	8,720	60.77	529,914.40	
EVERSOURCE ENERGY	14,310	65.84	942,170.40	
EXELON CORP	43,056	40.07	1,725,253.92	
FIRSTENERGY CORP	23,295	43.41	1,011,235.95	
NEXTERA ENERGY INC	91,420	81.43	7,444,330.60	
NISOURCE INC	23,010	34.82	801,208.20	
NRG ENERGY INC	9,770	87.53	855,168.10	
P G & E CORP	85,070	20.36	1,732,025.20	
PPL CORP	30,338	32.43	983,861.34	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	22,058	89.63	1,977,058.54	
SEMPRA	27,094	84.38	2,286,191.72	
SOUTHERN CO	48,275	91.88	4,435,507.00	
VISTRA CORP	14,720	124.03	1,825,721.60	
WEC ENERGY GROUP INC	14,270	97.19	1,386,901.30	
XCEL ENERGY INC	26,934	64.46	1,736,165.64	
ADVANCED MICRO DEVICES	71,644	156.23	11,192,942.12	
ANALOG DEVICES INC	22,067	230.17	5,079,161.39	
APPLIED MATERIALS INC	36,743	186.52	6,853,304.36	
BROADCOM INC	195,160	173.00	33,762,680.00	
ENPHASE ENERGY INC	6,430	83.83	539,026.90	
ENTEGRIS INC	6,650	105.01	698,316.50	
FIRST SOLAR INC	4,560	198.47	905,023.20	
INTEL CORP	189,542	22.68	4,298,812.56	

	KLA CORP	5,909	673.07	3,977,170.63	
	LAM RESEARCH CORP	57,770	77.68	4,487,573.60	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	40,254	81.61	3,285,128.94	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	23,418	76.29	1,786,559.22	
	MICRON TECHNOLOGY INC	48,957	107.91	5,282,949.87	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,200	901.29	1,982,838.00	
	NVIDIA CORP	1,086,420	141.54	153,771,886.80	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	10,887	243.16	2,647,282.92	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	20,910	71.25	1,489,837.50	
	QORVO INC	4,240	99.01	419,802.40	
	QUALCOMM INC	49,502	170.27	8,428,705.54	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,440	95.20	613,088.00	
	TERADYNE INC	6,880	111.75	768,840.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	40,182	206.93	8,314,861.26	
	CBRE GROUP INC - A	14,480	132.54	1,919,179.20	
	COSTAR GROUP INC	18,730	74.48	1,395,010.40	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,500	3.93	159,165.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	6,370	59.65	379,970.50	
米ドル小計		16,260,221		2,199,318,926.75 (337,485,489,309)	
加ドル	ARC RESOURCES LTD	25,510	24.02	612,750.20	
	CAMECO CORP	19,282	74.76	1,441,522.32	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,918	49.39	4,638,610.02	
	CENOVUS ENERGY INC	68,613	23.48	1,611,033.24	
	ENBRIDGE INC	95,987	56.93	5,464,539.91	
	IMPERIAL OIL LTD	8,922	105.72	943,233.84	
	KEYERA CORP	8,460	42.94	363,272.40	
	MEG ENERGY CORP	11,500	26.07	299,805.00	
	PARKLAND CORP	6,170	34.44	212,494.80	
	PEMBINA PIPELINE CORP	29,072	59.07	1,717,283.04	
	SUNCOR ENERGY INC	53,489	54.16	2,896,964.24	
	TC ENERGY CORP	45,033	65.68	2,957,767.44	
	TOURMALINE OIL CORP	15,980	64.81	1,035,663.80	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	21,496	120.79	2,596,501.84	
	BARRICK GOLD CORP	84,324	27.26	2,298,672.24	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	82.73	475,697.50	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	18.91	428,311.50	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,125	188.50	1,531,562.50	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	24,510	19.25	471,817.50	
	KINROSS GOLD CORP	55,925	14.62	817,623.50	
	LUNDIN MINING CORP	25,010	14.17	354,391.70	
	NUTRIEN LTD	24,688	66.60	1,644,220.80	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	16,410	34.37	564,011.70	

TECK RESOURCES LTD-CLS B	21,725	65.80	1,429,505.00	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,450	135.46	331,877.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,165	91.91	1,761,455.15	
CAE INC	12,305	25.81	317,592.05	
STANTEC INC	5,720	113.64	650,020.80	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,260	126.09	411,053.40	
WSP GLOBAL INC	5,800	248.34	1,440,372.00	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	21,040	28.58	601,323.20	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	11,710	55.68	652,012.80	
RB GLOBAL INC	7,560	118.00	892,080.00	
THOMSON REUTERS CORP	7,350	229.02	1,683,297.00	
AIR CANADA	7,190	18.92	136,034.80	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	23,418	154.25	3,612,226.50	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	41,421	107.18	4,439,502.78	
TFI INTERNATIONAL INC	3,210	185.88	596,674.80	
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,668	58.35	622,477.80	
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,570	70.47	110,637.90	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,040	66.81	470,342.40	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	12,858	98.06	1,260,855.48	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,250	156.92	353,070.00	
DOLLARAMA INC	12,990	141.66	1,840,163.40	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	34,600	71.43	2,471,478.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	39.91	277,374.50	
LOBLAW COMPANIES LTD	6,339	173.00	1,096,647.00	
METRO INC	9,570	81.71	781,964.70	
WESTON (GEORGE) LTD	2,808	218.33	613,070.64	
SAPUTO INC	9,620	27.25	262,145.00	
BANK OF MONTREAL	30,681	128.95	3,956,314.95	
BANK OF NOVA SCOTIA	52,339	71.99	3,767,884.61	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	42,300	87.32	3,693,636.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	16,550	131.67	2,179,138.50	
ROYAL BANK OF CANADA	61,789	170.22	10,517,723.58	
TORONTO-DOMINION BANK	77,700	78.30	6,083,910.00	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	13,859	72.91	1,010,459.69	
BROOKFIELD CORP	57,209	74.35	4,253,489.15	
IGM FINANCIAL INC	3,335	41.64	138,869.40	
ONEX CORPORATION	2,765	96.88	267,873.20	
TMX GROUP LTD	10,850	42.85	464,922.50	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	1,736.70	1,563,030.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	11,324	47.01	532,341.24	
IA FINANCIAL CORP INC	4,075	112.94	460,230.50	
INTACT FINANCIAL CORP	7,215	267.38	1,929,146.70	
MANULIFE FINANCIAL CORP	84,561	41.41	3,501,671.01	

	POWER CORP OF CANADA	27,929	44.15	1,233,065.35	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	24,774	78.40	1,942,281.60	
	CGI INC	9,510	157.25	1,495,447.50	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	870	4,281.75	3,725,122.50	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,740	144.62	540,878.80	
	OPEN TEXT CORP	11,190	46.23	517,313.70	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	53,850	109.84	5,914,884.00	
	BCE INC	3,000	45.57	136,710.00	
	QUEBECOR INC -CL B	6,110	35.37	216,110.70	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	16,655	51.60	859,398.00	
	TELUS CORP	12,662	22.00	278,564.00	
	ALTAGAS LTD	11,170	33.71	376,540.70	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	46.34	252,321.30	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	35.96	163,977.60	
	EMERA INC	15,550	53.13	826,171.50	
	FORTIS INC	22,635	60.89	1,378,245.15	
	HYDRO ONE LTD	13,230	45.39	600,509.70	
	FIRSTSERVICE CORP	1,500	263.60	395,400.00	
加ドル小計		1,803,243		129,666,588.26 (14,325,564,670)	
ユーロ	ENI SPA	100,696	14.42	1,452,841.88	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	18,755	16.60	311,426.77	
	NESTE OYJ	18,710	14.79	276,720.90	
	OMV AG	5,480	38.98	213,610.40	
	REPSOL SA	54,849	11.96	656,268.28	
	TENARIS SA	23,455	14.81	347,485.82	
	TOTALENERGIES SE	94,227	60.27	5,679,061.29	
	AIR LIQUIDE SA	25,534	167.44	4,275,412.96	
	AKZO NOBEL	6,937	59.46	412,474.02	
	ARCELORMITTAL	20,552	22.23	456,870.96	
	ARKEMA	2,215	80.80	178,972.00	
	BASF SE	41,325	46.17	1,907,975.25	
	COVESTRO AG	7,410	58.20	431,262.00	
	DSM-FIRMENICH AG	8,752	114.75	1,004,292.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,230	20.60	334,338.00	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	5,715	99.02	565,899.30	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	25,365	10.70	271,405.50	
	SYENSQO SA	2,811	73.07	205,399.77	
	SYMRISE AG	5,790	113.60	657,744.00	
	UPM-KYMMENE OYJ	25,098	28.96	726,838.08	
	VOESTALPINE AG	4,249	20.12	85,489.88	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,876	43.76	344,653.76	
	AIRBUS GROUP SE	26,528	140.48	3,726,653.44	

ALSTOM	13,962	20.55	286,919.10	
BOUYGUES SA	8,460	29.38	248,554.80	
BRENNTAG SE	6,865	61.62	423,021.30	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	19,106	81.88	1,564,399.28	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	23,136	39.17	906,237.12	
DASSAULT AVIATION SA	900	192.80	173,520.00	
EIFFAGE	3,250	85.38	277,485.00	
FERROVIAL SE	24,155	37.20	898,566.00	
GEA GROUP AG	6,020	46.52	280,050.40	
IMCD NV	2,120	149.75	317,470.00	
KINGSPAN GROUP PLC	7,300	78.95	576,335.00	
KNORR-BREMSE AG	2,970	79.70	236,709.00	
KONE OYJ-B	13,614	51.22	697,309.08	
LEGRAND SA	11,128	104.50	1,162,876.00	
LEONARDO SPA	16,300	21.79	355,177.00	
METSO CORPORATION	24,200	9.03	218,574.40	
MTU AERO ENGINES AG	2,540	309.00	784,860.00	
PRYSMIAN SPA	12,035	68.00	818,380.00	
RATIONAL AG	230	924.50	212,635.00	
REXEL SA	11,150	25.80	287,670.00	
RHEINMETALL AG	2,090	485.80	1,015,322.00	
SAFRAN SA	14,810	211.50	3,132,315.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	24,348	242.35	5,900,737.80	
SIEMENS AG-REG	33,566	180.42	6,055,977.72	
SIEMENS ENERGY AG	31,643	38.35	1,213,509.05	
THALES SA	4,925	152.05	748,846.25	
VINCI SA	23,010	100.75	2,318,257.50	
WARTSILA OYJ ABP	25,650	20.06	514,539.00	
BUREAU VERITAS SA	16,910	29.26	494,786.60	
RANDSTAD NV	4,675	43.36	202,708.00	
TELEPERFORMANCE	2,240	96.06	215,174.40	
WOLTERS KLUWER	11,667	158.70	1,851,552.90	
ADP	1,630	109.30	178,159.00	
AENA SA	3,750	204.80	768,000.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	6.72	160,569.12	
DEUTSCHE POST AG-REG	46,023	37.72	1,735,987.56	
GETLINK	17,310	15.53	268,824.30	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,355	76.00	1,014,980.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,150	71.65	225,697.50	
CONTINENTAL AG	4,385	58.70	257,399.50	
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	4,380	70.28	307,826.40	
FERRARI NV	5,459	450.10	2,457,095.90	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	34,202	57.79	1,976,533.58	

MICHELIN (CGDE)	30,986	31.16	965,523.76	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	40.37	228,897.90	
RENAULT SA	8,247	43.10	355,445.70	
STELLANTIS NV	98,206	12.67	1,244,466.43	
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,083	92.28	838,179.24	
ADIDAS AG	7,481	217.00	1,623,377.00	
HERMES INTERNATIONAL	1,372	2,105.00	2,888,060.00	
KERING	3,537	234.95	831,018.15	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	12,164	627.00	7,626,828.00	
MONCLER SPA	10,320	54.06	557,899.20	
PUMA SE	4,200	42.54	178,668.00	
SEB SA	987	98.55	97,268.85	
ACCOR SA	10,106	41.79	422,329.74	
AMADEUS IT GROUP SA	21,100	67.24	1,418,764.00	
DELIVERY HERO SE	9,610	41.00	394,010.00	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	37.26	145,314.00	
SODEXO SA	3,240	80.10	259,524.00	
BOLLORE SE	33,530	5.81	194,809.30	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	2,660	97.55	259,483.00	
PUBLICIS GROUPE	9,305	99.38	924,730.90	
SCOUT24 SE	2,970	80.60	239,382.00	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	36,410	23.61	859,640.10	
VIVENDI SE	26,070	10.22	266,565.75	
D'IETEREN GROUP	1,050	190.60	200,130.00	
INDITEX	45,895	54.56	2,504,031.20	
PROSUS NV	62,794	39.70	2,493,235.77	
ZALANDO SE	8,260	29.13	240,613.80	
CARREFOUR SA	22,633	14.60	330,441.80	
JERONIMO MARTINS	10,585	16.80	177,828.00	
KESKO OYJ-B SHS	10,930	17.89	195,537.70	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	40,028	30.71	1,229,259.88	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	41,131	59.54	2,448,939.74	
DANONE	30,254	65.78	1,990,108.12	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	30,650	7.73	237,047.10	
HEINEKEN HOLDING NV	7,005	67.15	470,385.75	
HEINEKEN NV	12,733	79.62	1,013,801.46	
JDE PEET'S NV	6,290	21.58	135,738.20	
KERRY GROUP PLC-A	6,460	94.75	612,085.00	
LOTUS BAKERIES	20	12,220.00	244,400.00	
PERNOD-RICARD SA	9,916	123.35	1,223,138.60	
BEIERSDORF AG	4,375	129.00	564,375.00	
HENKEL AG & CO KGAA	4,520	74.20	335,384.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,793	81.98	556,890.14	

L'OREAL	10,646	355.65	3,786,249.90	
AMPLIFON SPA	4,830	27.46	132,631.80	
BIOMERIEUX	1,690	104.90	177,281.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	62.80	101,108.00	
DIASORIN ITALIA SPA	930	102.00	94,860.00	
ESSILORLUXOTTICA	12,675	219.50	2,782,162.50	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	9,583	39.02	373,928.66	
FRESENIUS SE & CO KGAA	20,905	33.86	707,843.30	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	38,028	29.48	1,121,065.44	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	13,430	51.32	689,227.60	
ARGENX SE	2,495	521.00	1,299,895.00	
BAYER AG-REG	43,824	25.75	1,128,468.00	
EUROFINS SCIENTIFIC	5,050	46.73	235,986.50	
IPSEN	1,600	115.30	184,480.00	
MERCK KGAA	5,940	156.30	928,422.00	
ORION OYJ-CLASS B	4,500	44.32	199,440.00	
QIAGEN N.V.	10,072	38.72	389,987.84	
RECORDATI SPA	3,720	53.75	199,950.00	
SANOFI	50,646	100.08	5,068,651.68	
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,230	244.60	300,858.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	188.80	203,904.00	
UCB SA	5,398	178.75	964,892.50	
ABN AMRO BANK NV-CVA	23,550	15.23	358,666.50	
AIB GROUP PLC	70,100	4.85	339,985.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	267,563	9.04	2,419,304.64	
BANCO BPM SPA	49,000	6.08	298,312.00	
BANCO DE SABADELL SA	232,000	1.80	418,760.00	
BANCO SANTANDER SA	694,189	4.57	3,176,261.76	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	44,790	8.85	396,749.82	
BNP PARIBAS	44,242	65.33	2,890,329.86	
CAIXABANK S.A	163,050	5.36	874,274.10	
COMMERZBANK AG	50,774	16.15	820,000.10	
CREDIT AGRICOLE SA	49,662	14.00	695,268.00	
ERSTE GROUP BANK AG	15,328	48.84	748,619.52	
FINECOBANK SPA	23,540	15.01	353,453.10	
ING GROEP NV-CVA	146,925	15.67	2,303,490.15	
INTESA SANPAOLO	621,793	3.87	2,410,069.66	
KBC GROEP NV	11,219	67.58	758,180.02	
MEDIOBANCA SPA	19,520	15.34	299,534.40	
NORDEA BANK ABP	131,132	10.84	1,421,470.88	
SOCIETE GENERALE	30,909	23.72	733,161.48	
UNICREDIT SPA	64,276	40.15	2,581,002.78	
ADYEN NV	935	1,417.60	1,325,456.00	

AMUNDI SA	2,140	68.65	146,911.00	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	80,935	15.67	1,268,737.06	
DEUTSCHE BOERSE AG	8,250	216.00	1,782,000.00	
EDENRED	9,626	28.93	278,480.18	
EURAZEO SE	2,497	70.80	176,787.60	
EURONEXT NV	3,470	103.00	357,410.00	
EXOR NV	4,164	99.80	415,567.20	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,452	67.90	234,390.80	
NEXI SPA	21,240	5.86	124,466.40	
SOFINA	655	229.80	150,519.00	
AEGON LTD	69,679	5.88	410,269.95	
AGEAS	5,924	48.30	286,129.20	
ALLIANZ SE-REG	17,203	293.80	5,054,241.40	
ASR NEDERLAND NV	5,880	44.06	259,072.80	
AXA SA	83,692	34.89	2,920,013.88	
GENERALI	50,398	25.96	1,308,332.08	
HANNOVER RUECK SE-REG	2,775	245.40	680,985.00	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,046	469.50	2,838,597.00	
NN GROUP NV	10,270	46.01	472,522.70	
POSTE ITALIANE SPA	19,560	13.04	255,160.20	
SAMPO OYJ-A SHS	19,639	40.62	797,736.18	
TALANX AG	2,500	71.20	178,000.00	
BECHTLE AG	3,070	33.92	104,134.40	
CAP GEMINI SA	6,509	175.05	1,139,400.45	
DASSAULT SYSTEMES SE	30,390	31.52	957,892.80	
NEMETSCHEK SE	2,350	101.90	239,465.00	
SAP SE	46,042	221.05	10,177,584.10	
NOKIA OYJ	251,336	4.41	1,109,522.77	
CELLNEX TELECOM SA	24,690	35.12	867,112.80	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	151,666	28.10	4,261,814.60	
ELISA OYJ	6,005	43.64	262,058.20	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	10.53	159,740.10	
KONINKLIJKE KPN NV	204,956	3.75	769,814.73	
ORANGE S.A.	83,604	10.10	844,818.42	
TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.24	96,203.22	
TELEFONICA SA	195,629	4.33	847,660.45	
ACCIONA SA	830	123.20	102,256.00	
E.ON SE	108,799	12.75	1,387,187.25	
EDP RENOVAVEIS SA	11,333	13.08	148,235.64	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	126,131	3.76	474,504.82	
ELIA GROUP SA/NV	1,356	92.00	124,752.00	
ENDESA SA	12,050	19.68	237,144.00	
ENEL SPA	344,237	7.18	2,474,375.55	

	ENGIE	82,214	15.65	1,286,649.10	
	FORTUM OYJ	16,755	14.22	238,256.10	
	IBERDROLA SA	272,062	13.95	3,795,264.90	
	REDEIA CORP SA	20,650	16.85	347,952.50	
	RWE AG	25,835	30.71	793,392.85	
	SNAM SPA	91,120	4.49	409,402.16	
	TERNA SPA	71,827	8.09	581,080.43	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	31,150	29.11	906,776.50	
	VERBUND AG	2,780	78.80	219,064.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	2,105	521.00	1,096,705.00	
	ASML HOLDING NV	17,697	664.10	11,752,577.70	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	3,290	105.65	347,588.50	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	56,495	30.70	1,734,396.50	
	STMICROELECTRONICS NV	29,593	26.17	774,448.81	
	LEG IMMOBILIEN SE	3,010	88.92	267,649.20	
	VONOVIA SE	33,969	30.98	1,052,359.62	
ユーロ小計		8,046,126		227,767,414.39 (37,729,672,193)	
英ポンド	BP PLC	739,418	4.04	2,993,903.48	
	SHELL PLC-NEW	282,377	25.50	7,202,025.38	
	ANGLO AMERICAN PLC	54,004	24.34	1,314,727.38	
	ANTOFAGASTA PLC	17,080	18.11	309,318.80	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,131	37.18	227,950.58	
	ENDEAVOUR MINING PLC	6,490	18.46	119,805.40	
	GLENCORE PLC	453,603	4.04	1,833,463.32	
	MONDI PLC	16,700	12.72	212,424.00	
	RIO TINTO PLC	49,485	50.22	2,485,136.70	
	ASHTEAD GROUP PLC	20,500	58.58	1,200,890.00	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	134,535	12.92	1,738,192.20	
	BUNZL PLC	17,316	34.72	601,211.52	
	DCC PLC	3,820	50.55	193,101.00	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	63,400	4.43	280,862.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	380,331	5.56	2,115,401.02	
	SMITHS GROUP PLC	13,603	15.88	216,015.64	
	SPIRAX GROUP PLC	2,890	67.70	195,653.00	
	EXPERIAN PLC	43,618	38.68	1,687,144.24	
	INTERTEK GROUP PLC	6,025	47.84	288,236.00	
	RELX PLC	83,125	36.44	3,029,075.00	
	RENTOKIL INITIAL PLC	115,300	3.76	434,450.40	
	BARRATT REDROW PLC	76,220	4.72	360,139.50	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,356	46.54	202,728.24	
	PERSIMMON PLC	12,440	15.74	195,805.60	
	TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.54	192,215.41	

COMPASS GROUP PLC	72,268	25.11	1,814,649.48	
ENTAIN PLC	24,860	7.15	177,848.44	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,473	85.06	635,653.38	
PEARSON PLC	26,089	10.43	272,108.27	
WHITBREAD PLC	8,110	32.93	267,062.30	
AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	8.80	321,169.92	
INFORMA PLC	56,580	8.20	463,956.00	
WPP PLC	41,144	8.22	338,450.54	
JD SPORTS FASHION PLC	97,350	1.31	128,453.32	
KINGFISHER PLC	78,137	3.10	242,459.11	
NEXT PLC	5,667	100.00	566,700.00	
SAINSBURY (J) PLC	70,601	2.72	192,599.52	
TESCO PLC	338,158	3.52	1,193,021.42	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,295	23.10	422,614.50	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	84,677	26.58	2,250,714.66	
COCA-COLA HBC AG-CDI	11,230	27.76	311,744.80	
DIAGEO PLC	95,292	25.65	2,444,716.26	
IMPERIAL BRANDS PLC	38,792	22.89	887,948.88	
HALEON PLC	298,551	3.74	1,118,372.04	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	30,695	48.49	1,488,400.55	
UNILEVER PLC	109,872	47.62	5,232,104.64	
NMC HEALTH PLC	8,090	—	—	
SMITH & NEPHEW PLC	33,906	10.88	368,897.28	
ASTRAZENECA PLC	68,352	116.06	7,932,933.12	
GSK PLC	182,410	14.48	2,642,208.85	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,740	19.42	111,470.80	
BARCLAYS PLC	639,751	2.41	1,544,358.91	
HSBC HOLDINGS PLC	833,261	6.82	5,683,673.28	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,972,636	0.57	1,714,021.91	
NATWEST GROUP PLC	275,835	3.63	1,003,763.56	
STANDARD CHARTERED PLC	95,420	8.53	813,932.60	
3I GROUP PLC	40,649	32.78	1,332,474.22	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	20,707	106.05	2,195,977.35	
M&G PLC	99,522	2.00	199,541.61	
SCHRODERS PLC	30,300	3.56	108,110.40	
WISE PLC - A	29,200	7.35	214,620.00	
ADMIRAL GROUP PLC	12,845	25.72	330,373.40	
AVIVA PLC	134,324	4.62	621,382.82	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	294,051	2.20	648,382.45	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,230	5.06	153,114.95	
PRUDENTIAL PLC	121,002	6.47	783,124.94	
SAGE GROUP PLC/THE	49,540	10.15	502,831.00	
HALMA PLC	14,690	24.69	362,696.10	

	BT GROUP PLC	267,752	1.44	386,633.88	
	VODAFONE GROUP PLC	996,528	0.73	734,241.83	
	CENTRICA PLC	209,200	1.23	257,839.00	
	NATIONAL GRID PLC	204,765	9.98	2,044,783.29	
	SEVERN TRENT PLC	13,573	26.33	357,377.09	
	SSE PLC	53,447	18.29	977,545.63	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	10.50	274,102.50	
英ポンド小計		12,041,009		84,701,036.61 (16,848,730,202)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,990	12.55	100,274.50	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	679.00	183,330.00	
	GIVAUDAN-REG	423	4,194.00	1,774,062.00	
	HOLCIM LTD	22,219	83.04	1,845,065.76	
	SIG GROUP AG	10,900	18.99	206,991.00	
	SIKA AG-REG	6,605	247.10	1,632,095.50	
	ABB LTD-REG	70,005	48.75	3,412,743.75	
	GEBERIT AG-REG	1,490	517.20	770,628.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,070	247.00	264,290.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	252.80	374,144.00	
	VAT GROUP AG	1,295	368.00	476,560.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,817	28.00	190,876.00	
	SGS SA-REG	5,950	91.56	544,782.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,810	220.00	618,200.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	23,819	128.45	3,059,550.55	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,525	183.90	280,447.50	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,950	36.25	70,687.50	
	AVOLTA AG	3,460	34.48	119,300.80	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	130	1,570.00	204,100.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	40	10,540.00	421,600.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	103,600.00	518,000.00	
	NESTLE SA-REG	117,690	84.54	9,949,512.60	
	ALCON INC	22,714	81.96	1,861,639.44	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,051	312.20	640,322.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,520	126.70	699,384.00	
	BACHEM HOLDING AG	1,400	69.70	97,580.00	
	GALDERMA GROUP AG	2,090	81.07	169,436.30	
	LONZA GROUP AG-REG	3,333	556.20	1,853,814.60	
	NOVARTIS AG-REG	86,923	98.66	8,575,823.18	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,640	307.20	503,808.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	30,993	281.20	8,715,231.60	
	SANDOZ GROUP AG	21,268	38.37	816,053.16	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,510	88.70	133,937.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,420	54.32	457,374.40	

	PARTNERS GROUP HOLDIING AG	995	1,260.50	1,254,197.50	
	UBS GROUP AG-REG	146,722	27.87	4,089,142.14	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,740	174.20	303,108.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	1,320	150.70	198,924.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,285	711.60	914,406.00	
	SWISS RE AG	14,419	111.75	1,611,323.25	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,521	518.80	3,383,094.80	
	TEMENOS AG	2,280	63.45	144,666.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	70.28	468,064.80	
	SWISSCOM AG-REG	1,024	559.00	572,416.00	
	BKW AG	840	156.80	131,712.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,441	94.55	325,346.55	
スイスフラン小計		663,052		64,938,046.38 (11,460,266,425)	
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	10,290	335.60	3,453,324.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,520	437.60	1,540,352.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	22,680	149.20	3,383,856.00	
	ADDTECH AB-B SHARES	11,400	296.00	3,374,400.00	
	ALFA LAVAL AB	15,220	481.80	7,332,996.00	
	ASSA ABLOY AB-B	42,940	334.60	14,367,724.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	122,590	179.55	22,011,034.50	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	67,170	158.75	10,663,237.50	
	BEIJER REF AB	15,480	158.50	2,453,580.00	
	EPIROC AB-A	31,565	213.90	6,751,753.50	
	EPIROC AB-B	15,450	188.10	2,906,145.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	70.34	1,055,100.00	
	INDUTRADE AB	10,180	295.00	3,003,100.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	298.20	2,027,760.00	
	LIFCO AB-B SHS	8,470	321.60	2,723,952.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	63,000	51.78	3,262,140.00	
	SAAB AB-B	11,120	230.70	2,565,384.00	
	SANDVIK AB	49,820	211.00	10,512,020.00	
	SKANSKA AB-B SHS	14,390	216.90	3,121,191.00	
	SKF AB-B SHARES-B	14,079	201.40	2,835,510.60	
	TRELLEBORG AB-B SHS	9,190	365.00	3,354,350.00	
	VOLVO AB-A SHS	9,530	279.80	2,666,494.00	
	VOLVO AB-B SHS-B	70,890	277.20	19,650,708.00	
	SECURITAS AB-B SHS	17,788	128.90	2,292,873.20	
	VOLVO CAR AB-B	39,400	23.60	930,037.00	
	EVOLUTION AB	8,150	1,044.50	8,512,675.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,848	172.35	4,799,602.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	29,035	304.60	8,844,061.00	
	GETINGE AB-B SHS	9,470	198.50	1,879,795.00	

	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	8,148	346.40	2,822,467.20	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	72,400	149.60	10,831,040.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60,120	111.80	6,721,416.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	34,550	214.90	7,424,795.00	
	EQT AB	17,960	320.00	5,747,200.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	369.40	1,841,089.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	368.70	2,204,826.00	
	INVESTOR AB-B SHS	79,850	306.00	24,434,100.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,590	538.50	1,933,215.00	
	ERICSSON LM-B SHS	114,915	89.94	10,335,455.10	
	HEXAGON AB-B SHS	94,990	105.35	10,007,196.50	
	TELE2 AB-B SHS	23,245	112.95	2,625,522.75	
	TELIA CO AB	118,530	32.10	3,804,813.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	23,220	83.00	1,927,260.00	
	SAGAX AB-B	11,880	263.00	3,124,440.00	
スウェーデンクローナ小計		1,446,827		258,059,992.25 (3,726,386,288)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	12,100	233.50	2,825,350.00	
	EQUINOR ASA	39,014	282.60	11,025,356.40	
	NORSK HYDRO A S	50,660	68.52	3,471,223.20	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,670	339.60	2,265,132.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,900	1,143.00	4,457,700.00	
	MOWI ASA	16,360	197.30	3,227,828.00	
	ORKLA ASA	32,290	99.25	3,204,782.50	
	SALMAR ASA	3,590	585.00	2,100,150.00	
	DNB BANK ASA	45,435	230.40	10,468,224.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,410	202.00	1,496,820.00	
	TELENOR ASA	23,915	131.40	3,142,431.00	
ノルウェークローネ小計		241,344		47,684,997.10 (665,205,709)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	16,690	442.40	7,383,656.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	315	2,942.00	926,730.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	47,690	132.15	6,302,233.50	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	115	10,300.00	1,184,500.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	195	10,640.00	2,074,800.00	
	DSV A/S	8,890	1,500.00	13,335,000.00	
	PANDORA A/S	3,310	1,040.50	3,444,055.00	
	CARLSBERG AS-B	3,910	785.00	3,069,350.00	
	COLOPLAST-B	6,475	883.80	5,722,605.00	
	DEMANT A/S	3,640	269.80	982,072.00	
	GENMAB A/S	2,920	1,593.50	4,653,020.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	142,520	784.30	111,778,436.00	
	ZEALAND PHARMA A/S	2,810	841.50	2,364,615.00	

	DANSKE BANK A/S	31,185	198.80	6,199,578.00	
	TRYG A/S	13,945	161.40	2,250,723.00	
	ORSTED A/S	7,570	433.60	3,282,352.00	
デンマーククローネ小計		292,180		174,953,725.50 (3,883,972,706)	
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	28.12	246,753.00	
	SANTOS LTD	151,760	6.93	1,051,696.80	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	84,316	24.29	2,048,035.64	
	BHP GROUP LTD	225,267	42.39	9,549,068.13	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	20.70	379,017.00	
	FORTESCUE LTD	73,745	18.99	1,400,417.55	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	20,365	49.71	1,012,344.15	
	MINERAL RESOURCES LTD	7,320	34.12	249,758.40	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	53,090	18.29	971,016.10	
	ORICA LIMITED	17,675	17.42	307,898.50	
	PILBARA MINERALS LTD	114,530	2.74	313,812.20	
	RIO TINTO LTD	16,698	118.08	1,971,699.84	
	SOUTH32 LTD	207,787	3.71	770,889.77	
	REECE LTD	10,200	23.71	241,842.00	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	8,410	41.79	351,453.90	
	BRAMBLES LTD	54,798	18.16	995,131.68	
	COMPUTERSHARE LTD	20,910	26.23	548,469.30	
	QANTAS AIRWAYS LTD	35,030	8.03	281,290.90	
	TRANSURBAN GROUP	151,796	12.95	1,965,758.20	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	29,060	59.00	1,714,540.00	
	LOTTERY CORP LTD/THE	85,554	4.97	425,203.38	
	CAR GROUP LTD	14,500	37.09	537,805.00	
	REA GROUP LTD	1,820	229.34	417,398.80	
	SEEK LTD	12,860	25.55	328,573.00	
	WESFARMERS LTD	47,855	68.01	3,254,618.55	
	COLES GROUP LTD	57,925	18.16	1,051,918.00	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	82,662	4.73	390,991.26	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	54,692	32.69	1,787,881.48	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	43,206	11.77	508,534.62	
	COCHLEAR LTD	2,947	283.94	836,771.18	
	PRO MEDICUS LTD	2,450	185.30	453,985.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,105	41.70	296,278.50	
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	27.67	488,652.20	
	CSL LTD	21,382	293.69	6,279,679.58	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	126,149	31.71	4,000,184.79	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	74,307	144.02	10,701,694.14	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	135,333	38.95	5,271,220.35	
	WESTPAC BANKING CORP	148,101	32.14	4,759,966.14	

	ASX LTD	7,105	67.47	479,374.35	
	MACQUARIE GROUP LTD	16,084	233.22	3,751,110.48	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,370	33.81	282,989.70	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	7.49	712,486.25	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	108,430	3.69	400,106.70	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	70,410	17.23	1,213,164.30	
	SUNCORP GROUP LTD	55,536	18.04	1,001,869.44	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,450	112.00	834,400.00	
	XERO LTD	5,960	147.40	878,504.00	
	TELSTRA GROUP LTD	164,284	3.87	635,779.08	
	APA GROUP	69,418	7.18	498,421.24	
	ORIGIN ENERGY LTD	93,120	9.66	899,539.20	
豪ドル小計		2,947,642		79,749,993.77 (8,082,661,868)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,165	7.26	342,417.90	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,130	36.84	852,109.20	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	2.99	229,348.11	
	MERCURY NZ LTD	34,100	6.61	225,401.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	57,830	5.92	342,353.60	
ニュージーランドドル小計		238,802		1,991,629.81 (182,612,537)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	125,708	41.75	5,248,309.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	17,517	64.90	1,136,853.30	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	58,500	114.80	6,715,800.00	
	MTR CORP	62,500	28.50	1,781,250.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	23.15	1,203,800.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	91,000	34.30	3,121,300.00	
	SANDS CHINA LTD	96,600	19.86	1,918,476.00	
	WH GROUP LTD	450,894	6.28	2,831,614.32	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	203,500	25.65	5,219,775.00	
	HANG SENG BANK LTD	36,900	95.50	3,523,950.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	52,800	312.80	16,515,840.00	
	AIA GROUP LTD	482,390	62.85	30,318,211.50	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	9.74	1,461,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	54.90	1,372,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	71,500	66.80	4,776,200.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	456,237	6.12	2,792,170.44	
	POWER ASSETS HOLDINGS	58,000	51.70	2,998,600.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	80,538	32.30	2,601,377.40	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	25.55	1,479,370.55	
	SINO LAND CO	189,050	7.85	1,484,042.50	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,480	85.10	5,146,848.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	43,000	21.85	939,550.00	

	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	24.10	1,537,580.00	
香港ドル小計		2,985,815		106,124,418.01 (2,094,896,011)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	68,560	6.51	446,325.60	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	63,300	4.72	298,776.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	6.47	348,733.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.82	174,157.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	3.25	240,370.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	84,034	39.15	3,289,931.10	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	150,740	15.32	2,309,336.80	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	57,300	32.49	1,861,677.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	11.65	495,125.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	354,480	3.21	1,137,880.80	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	30,200	5.27	159,154.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	105,000	2.87	301,350.00	
シンガポールドル小計		1,295,074		11,062,816.80 (1,282,512,351)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	39,490	15.67	618,808.30	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,010	808.40	816,484.00	
	BANK HAPOALIM BM	50,495	38.22	1,929,918.90	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	62,565	37.10	2,321,161.50	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	48,330	21.22	1,025,562.60	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,900	149.90	1,034,310.00	
	NICE LTD	3,040	662.70	2,014,608.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,780	274.00	487,720.00	
イスラエルシュケル小計		213,610		10,248,573.30 (414,632,679)	
合　　計		48,474,945		438,182,602,948 (438,182,602,948)	

(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	780,968.20	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	12,110	463,449.70	
		AMERICAN TOWER CORP	20,829	4,640,701.20	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	18,847	367,328.03	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,790	1,310,566.50	
		BXP INC	5,717	497,321.83	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,810	568,974.90	
		CROWN CASTLE INC	18,590	2,024,636.90	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,395	2,605,638.95	
		EQUINIX INC	4,208	3,847,500.64	

		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	9,580	664,756.20	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	15,450	1,153,651.50	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,020	892,863.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	9,880	1,644,032.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,340	564,391.80	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36,875	821,943.75	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	33,579	590,318.82	
		INVITATION HOMES INC	25,700	863,520.00	
		IRON MOUNTAIN INC	13,365	1,706,710.50	
		KIMCO REALTY CORP	29,910	704,380.50	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,630	863,191.60	
		PROLOGIS INC	40,885	4,805,622.90	
		PUBLIC STORAGE	6,849	2,303,592.66	
		REALTY INCOME CORP	39,211	2,404,026.41	
		REGENCY CENTERS CORP	7,565	537,190.65	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,735	1,144,875.65	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	15,054	2,567,008.08	
		SUN COMMUNITIES INC	5,920	792,628.80	
		UDR INC	12,100	530,827.00	
		VENTAS INC	17,025	1,106,114.25	
		VICI PROPERTIES INC	45,610	1,464,081.00	
		WELLTOWER INC	27,660	3,601,332.00	
		WEYERHAEUSER CO	29,998	953,936.40	
		WP CAREY INC	8,610	493,180.80	
米ドル小計			567,757	50,281,263.12 (7,715,659,825)	
加ドル	新株予約権証券	CONSTELLATION SOFTWARE IN-40	810.00	—	
	新株予約権証券小計		810.00	— (—)	
	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	135,800.00	
	投資証券小計		2,800	135,800.00 (15,003,184)	
加ドル小計			3,610	135,800.00 (15,003,184)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	103,372.50	
		GECINA SA	1,950	195,780.00	
		KLEPIERRE	8,402	248,195.08	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,990	384,928.60	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,730	172,533.60	
ユーロ小計			24,997	1,104,809.78 (183,011,740)	
英ポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	164,669.44	
		SEGRO PLC	65,733	530,728.24	
			92,357	695,397.68	

英ポンド小計				(138,328,506)	
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	42,067	303,303.07	
		GOODMAN GROUP	70,642	2,545,937.68	
		GPT GROUP	71,335	345,261.40	
		MIRVAC GROUP	159,875	353,323.75	
		SCENTRE GROUP	280,871	991,474.63	
		STOCKLAND	102,400	528,384.00	
		VICINITY CENTRES	154,902	339,235.38	
豪ドル小計			882,092	5,406,919.91 (547,991,332)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	104,160	3,838,296.00	
香港ドル小計			104,160	3,838,296.00 (75,767,963)	
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,243	380,168.25	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	221,291	449,220.73	
シンガポールドル小計			359,534	829,388.98 (96,151,064)	
合計				8,771,913,614 (8,771,913,614)	

(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	組入新株予約権 証券時価比率	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　572銘柄	97.8%	—	—	75.7%
	投資証券　34銘柄	—	—	2.2%	1.7%
加ドル	株式　84銘柄	99.9%	—	—	3.2%
	新株予約権証券　1銘柄	—	—	—	—
	投資証券　1銘柄	—	—	0.1%	0.0%
ユーロ	株式　211銘柄	99.5%	—	—	8.4%
	投資証券　5銘柄	—	—	0.5%	0.0%
英ポンド	株式　75銘柄	99.2%	—	—	3.8%
	投資証券　2銘柄	—	—	0.8%	0.0%
スイスフラン	株式　46銘柄	100.0%	—	—	2.6%
スウェーデンクローナ	株式　44銘柄	100.0%	—	—	0.8%
ノルウェークローネ	株式　11銘柄	100.0%	—	—	0.1%
デンマーククローネ	株式　16銘柄	100.0%	—	—	0.9%
豪ドル	株式　50銘柄	93.7%	—	—	1.8%
	投資証券　7銘柄	—	—	6.3%	0.1%
ニュージーランドドル	株式　5銘柄	100.0%	—	—	0.0%
香港ドル	株式　23銘柄	96.5%	—	—	0.5%
	投資証券　1銘柄	—	—	3.5%	0.0%
シンガポールドル	株式　12銘柄	93.0%	—	—	0.3%
	投資証券　2銘柄	—	—	7.0%	0.0%

イスラエルシュケル	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。

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
預金	104,846,891	84,270,649
コール・ローン	604,845,106	1,057,671,371
株式	18,864,148,524	26,024,703,041
投資証券	365,107,258	527,870,389
派生商品評価勘定	8,604,707	15,707,142
未収入金	5,135,967	801
未収配当金	13,823,892	14,894,529
未収利息	-	6,784
差入委託証拠金	342,727,613	462,421,171
流動資産合計	20,309,239,958	28,187,545,877
資産合計	20,309,239,958	28,187,545,877
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	375,702,990	1,256,987,507
未払金	17,481,332	2,068,198
未払解約金	3,268,722	13,611,082
未払利息	215	-
流動負債合計	396,453,259	1,272,666,787
負債合計	396,453,259	1,272,666,787
純資産の部		
元本等		
元本	8,773,758,808	9,154,839,298
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	11,139,027,891	17,760,039,792
元本等合計	19,912,786,699	26,914,879,090
純資産合計	19,912,786,699	26,914,879,090
負債純資産合計	20,309,239,958	28,187,545,877

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

		2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
１．	期首	2022年10月27日	2023年10月27日
	期首元本額	8,061,313,419円	8,773,758,808円
	期首からの追加設定元本額	1,273,602,778円	1,059,430,374円
	期首からの一部解約元本額	561,157,389円	678,349,884円
	元本の内訳　※		
	インデックスファンド海外株式ヘッジあり（ＤＣ専用）	7,331,730,031円	7,820,883,068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）	311,113,933円	283,193,664円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	570,911円	1,322,307円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）	321,600円	555,175円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	34,386,093円	28,776,225円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	100,071,776円	90,212,470円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	158,576,513円	147,654,931円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	159,949,483円	153,483,896円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジあり）	677,038,468円	628,757,562円
	計	8,773,758,808円	9,154,839,298円
２．	受益権の総数	8,773,758,808口	9,154,839,298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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2022年10月27日 至 2023年10月26日	自 2023年10月27日 至 2024年10月28日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）

（2023年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,333,910,881
投資証券	△45,196,394
合計	1,288,714,487

（2024年10月28日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	6,249,871,846
投資証券	126,836,796
合計	6,376,708,642

(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)

（2023年10月26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	724,550,405	－	680,013,225	△44,537,180
合計		724,550,405	－	680,013,225	△44,537,180

（2024年10月28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	715,560,166	－	731,171,231	15,611,065
合計		715,560,166	－	731,171,231	15,611,065

（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)

（2023年10月26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	19,185,693,266	－	19,508,254,369	△322,561,103
	米ドル	14,254,594,644	－	14,534,472,941	△279,878,297
	加ドル	635,959,583	－	642,321,661	△6,362,078
	ユーロ	1,887,857,390	－	1,910,407,179	△22,549,789
	英ポンド	852,580,027	－	853,038,008	△457,981
	スイスフラン	540,708,856	－	551,078,320	△10,369,464
	スウェーデンクローナ	167,204,291	－	167,022,962	181,329
	ノルウェークローネ	39,768,693	－	38,544,864	1,223,829
	デンマーククローネ	186,277,322	－	188,428,489	△2,151,167
	豪ドル	407,120,601	－	405,776,904	1,343,697
	ニュージーランドドル	7,653,601	－	7,597,111	56,490
	香港ドル	121,010,535	－	123,985,901	△2,975,366
	シンガポールドル	67,089,127	－	68,277,805	△1,188,678
	イスラエルシュケル	17,868,596	－	17,302,224	566,372
合計		19,185,693,266	－	19,508,254,369	△322,561,103

（2024年10月28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	25,700,681,623	－	26,957,573,053	△1,256,891,430
	米ドル	19,680,049,302	－	20,767,298,772	△1,087,249,470
	加ドル	834,344,075	－	857,275,461	△22,931,386
	ユーロ	2,321,113,276	－	2,383,351,386	△62,238,110
	英ポンド	983,990,475	－	1,020,147,465	△36,156,990
	スイスフラン	659,925,171	－	676,397,379	△16,472,208
	スウェーデンクローナ	212,692,779	－	216,102,223	△3,409,444
	ノルウェークローネ	41,279,440	－	41,767,880	△488,440
	デンマーククローネ	224,866,168	－	231,802,992	△6,936,824
	豪ドル	504,531,294	－	516,854,851	△12,323,557
	ニュージーランドドル	8,332,920	－	8,456,097	△123,177
	香港ドル	123,531,825	－	128,751,030	△5,219,205
	シンガポールドル	81,596,557	－	83,931,001	△2,334,444
	イスラエルシュケル	24,428,341	－	25,436,516	△1,008,175
合計		25,700,681,623	－	26,957,573,053	△1,256,891,430

（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。

①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。

②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）

2023年10月26日現在		2024年10月28日現在	
1口当たり純資産額	2.2696円	1口当たり純資産額	2.9400円
(1万口当たり純資産額)	(22,696円)	(1万口当たり純資産額)	(29,400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	890	24.82	22,089.80	
	BAKER HUGHES CO	2,370	37.52	88,922.40	
	CHENIERE ENERGY INC	606	184.93	112,067.58	
	CHEVRON CORP	4,590	150.81	692,217.90	
	CHORD ENERGY CORP	200	128.85	25,770.00	
	CONOCOPHILLIPS	3,090	104.56	323,090.40	
	COTERRA ENERGY INC	2,100	23.85	50,085.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	1,690	39.19	66,231.10	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	500	184.38	92,190.00	
	EOG RESOURCES INC	1,460	123.17	179,828.20	
	EQT CORP	1,710	37.48	64,090.80	
	EXPAND ENERGY CORP	270	84.79	22,893.30	
	EXXON MOBIL CORP	11,730	119.49	1,401,617.70	
	HALLIBURTON CO	2,110	28.25	59,607.50	
	HESS CORP	670	138.02	92,473.40	
	HF SINCLAIR CORP	420	43.01	18,064.20	
	KINDER MORGAN INC	5,650	24.95	140,967.50	
	MARATHON OIL CORP	1,710	26.46	45,246.60	
	MARATHON PETROLEUM CORP	900	152.36	137,124.00	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,660	51.58	85,622.80	
	ONEOK INC	1,510	96.66	145,956.60	
	OVINTIV INC	660	40.39	26,657.40	
	PHILLIPS 66	1,070	128.17	137,141.90	
	SCHLUMBERGER LTD	4,000	41.74	166,960.00	
	TARGA RESOURCES CORP	550	165.96	91,278.00	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	60	1,098.01	65,880.60	
	VALERO ENERGY CORP	810	132.40	107,244.00	

WILLIAMS COS INC	3,340	52.50	175,350.00	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	590	318.02	187,631.80	
ALBEMARLE CORP	307	93.51	28,707.57	
AMCOR PLC	4,230	11.00	46,530.00	
AVERY DENNISON CORP	196	207.16	40,603.36	
BALL CORP	855	64.03	54,745.65	
CELANESE CORP	280	128.87	36,083.60	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	420	83.19	34,939.80	
CORTEVA INC	1,690	60.35	101,991.50	
CRH PLC	1,760	92.39	162,606.40	
CROWN HOLDINGS INC	298	93.70	27,922.60	
DOW INC	2,240	49.70	111,328.00	
DUPONT DE NEMOURS INC	1,130	83.30	94,129.00	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	300	105.43	31,629.00	
ECOLAB INC	700	253.49	177,443.00	
FREEPORT-MCMORAN INC	3,530	46.60	164,498.00	
INTERNATIONAL PAPER CO	874	48.57	42,450.18	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	590	101.45	59,855.50	
LINDE PLC	1,270	473.76	601,675.20	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	670	87.50	58,625.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	150	570.21	85,531.50	
MOSAIC CO/THE	882	26.94	23,761.08	
NEWMONT CORP	3,070	48.42	148,649.40	
NUCOR CORP	640	141.47	90,540.80	
PACKAGING CORP OF AMERICA	240	225.86	54,206.40	
PPG INDUSTRIES INC	660	126.45	83,457.00	
RELIANCE INC	170	283.54	48,201.80	
RPM INTERNATIONAL INC	385	128.45	49,453.25	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	640	359.04	229,785.60	
SMURFIT WESTROCK PLC	1,302	45.84	59,683.68	
STEEL DYNAMICS INC	390	129.58	50,536.20	
VULCAN MATERIALS CO	310	256.54	79,527.40	
3M CO	1,410	124.75	175,897.50	
AECOM	380	104.49	39,706.20	
AERCAP HOLDINGS NV	450	95.42	42,939.00	
ALLEGION PLC	231	142.60	32,940.60	
AMETEK INC	630	166.96	105,184.80	
AXON ENTERPRISE INC	190	444.52	84,458.80	
BOEING CO/THE	1,570	155.01	243,365.70	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	300	180.80	54,240.00	
CARLISLE COS INC	130	417.20	54,236.00	
CARRIER GLOBAL CORP	2,090	73.72	154,074.80	
CATERPILLAR INC	1,290	385.97	497,901.30	

CNH INDUSTRIAL NV	2,590	11.20	29,008.00	
CUMMINS INC	360	329.17	118,501.20	
DEERE & CO	700	407.93	285,551.00	
DOVER CORP	354	186.98	66,190.92	
EATON CORP PLC	1,070	344.49	368,604.30	
EMCOR GROUP INC	120	428.58	51,429.60	
EMERSON ELECTRIC CO	1,460	108.13	157,869.80	
FASTENAL CO	1,560	75.85	118,326.00	
FERGUSON ENTERPRISES INC	530	196.23	104,001.90	
FORTIVE CORP	950	74.97	71,221.50	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	347	85.49	29,665.03	
GE VERNOVA INC	697	293.54	204,597.38	
GENERAL DYNAMICS CORP	600	302.52	181,512.00	
GENERAL ELECTRIC CO	2,870	179.10	514,017.00	
GRACO INC	490	82.14	40,248.60	
HEICO CORP	80	253.80	20,304.00	
HEICO CORP-CLASS A	253	197.70	50,018.10	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,720	208.00	357,760.00	
HOWMET AEROSPACE INC	1,146	101.39	116,192.94	
HUBBELL INC	140	444.52	62,232.80	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	117	253.83	29,698.11	
IDEX CORP	206	202.82	41,780.92	
ILLINOIS TOOL WORKS	760	254.08	193,100.80	
INGERSOLL-RAND INC	1,003	96.12	96,408.36	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	500	37.05	18,525.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	1,710	76.74	131,225.40	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	520	252.81	131,461.20	
LENNOX INTERNATIONAL INC	80	609.18	48,734.40	
LOCKHEED MARTIN CORP	550	562.29	309,259.50	
MASCO CORP	710	81.26	57,694.60	
NORDSON CORP	120	248.10	29,772.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	350	519.35	181,772.50	
OTIS WORLDWIDE CORP	1,170	101.26	118,474.20	
OWENS CORNING	242	181.90	44,019.80	
PACCAR INC	1,460	105.90	154,614.00	
PARKER HANNIFIN CORP	350	621.74	217,609.00	
PENTAIR PLC	590	98.96	58,386.40	
QUANTA SERVICES INC	370	308.17	114,022.90	
ROCKWELL AUTOMATION INC	270	269.86	72,862.20	
RTX CORP	3,490	125.16	436,808.40	
SMITH (A.O.) CORP	270	76.87	20,754.90	
SNAP-ON INC	152	326.58	49,640.16	
STANLEY BLACK & DECKER INC	421	101.98	42,933.58	

TEXTRON INC	508	82.35	41,833.80	
TORO CO	300	81.70	24,510.00	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	610	392.57	239,467.70	
TRANSDIGM GROUP INC	140	1,354.83	189,676.20	
UNITED RENTALS INC	180	812.50	146,250.00	
VERTIV HOLDINGS CO	890	112.17	99,831.30	
WABTEC CORP	460	188.76	86,829.60	
WATSCO INC	90	475.90	42,831.00	
WW GRAINGER INC	110	1,090.94	120,003.40	
XYLEM INC	640	130.42	83,468.80	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,090	287.96	313,876.40	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	365	181.93	66,404.45	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	280	214.03	59,928.40	
CINTAS CORP	960	207.41	199,113.60	
COPART INC	2,080	51.71	107,556.80	
DAYFORCE INC	300	64.84	19,452.00	
EQUIFAX INC	290	269.89	78,268.10	
JACOBS SOLUTIONS INC	290	140.52	40,750.80	
LEIDOS HOLDINGS INC	309	168.71	52,131.39	
PAYCHEX INC	790	140.33	110,860.70	
PAYCOM SOFTWARE INC	160	164.63	26,340.80	
REPUBLIC SERVICES INC	580	199.83	115,901.40	
ROLLINS INC	910	46.54	42,351.40	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	603	70.04	42,234.12	
TRANSUNION	455	103.59	47,133.45	
VERALTO CORP	596	104.05	62,013.80	
VERISK ANALYTICS INC	360	264.65	95,274.00	
WASTE CONNECTIONS INC	760	175.80	133,608.00	
WASTE MANAGEMENT INC	1,080	206.80	223,344.00	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	300	108.12	32,436.00	
CSX CORP	5,150	33.27	171,340.50	
DELTA AIR LINES INC	276	54.12	14,937.12	
EXPEDITORS INTL WASH INC	430	119.84	51,531.20	
FEDEX CORP	610	272.12	165,993.20	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	3,920	4.07	15,954.40	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	219	174.83	38,287.77	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	463	52.55	24,330.65	
NORFOLK SOUTHERN CORP	560	251.09	140,610.40	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	500	197.79	98,895.00	
SOUTHWEST AIRLINES CO	466	29.43	13,714.38	
U-HAUL HOLDING CO	230	65.56	15,078.80	
UBER TECHNOLOGIES INC	4,990	77.62	387,323.80	
UNION PACIFIC CORP	1,590	230.30	366,177.00	

UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,960	137.43	269,362.80	
APTIV PLC	720	69.31	49,903.20	
FORD MOTOR COMPANY	10,870	11.07	120,330.90	
GENERAL MOTORS CORP	3,060	52.07	159,334.20	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	1,840	10.45	19,228.00	
TESLA INC	7,560	269.19	2,035,076.40	
DECKERS OUTDOOR CORP	420	168.11	70,606.20	
DR HORTON INC	790	179.24	141,599.60	
GARMIN LTD	460	162.30	74,658.00	
LENNAR CORP-CL A	610	173.28	105,700.80	
LULULEMON ATHLETICA INC	310	304.15	94,286.50	
NIKE INC -CL B	3,260	78.85	257,051.00	
NVR INC	10	9,329.74	93,297.40	
PULTE GROUP INC	610	132.47	80,806.70	
AIRBNB INC-CLASS A	1,110	134.58	149,383.80	
BOOKING HOLDINGS INC	90	4,347.82	391,303.80	
CARNIVAL CORP	2,298	20.91	48,051.18	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,500	59.44	208,040.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	311	159.92	49,735.12	
DOMINO'S PIZZA INC	93	413.81	38,484.33	
DOORDASH INC - A	730	153.88	112,332.40	
DRAFTKINGS INC-CL A	1,130	36.47	41,211.10	
EXPEDIA GROUP INC	390	158.39	61,772.10	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	440	224.92	98,964.80	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	610	236.11	144,027.10	
HYATT HOTELS CORP - CL A	130	154.56	20,092.80	
LAS VEGAS SANDS CORP	909	52.76	47,958.84	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	600	262.12	157,272.00	
MCDONALD'S CORP	1,900	292.61	555,959.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	761	40.36	30,713.96	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	680	200.91	136,618.80	
STARBUCKS CORP	3,050	97.31	296,795.50	
WYNN RESORTS LTD	210	97.99	20,577.90	
YUM! BRANDS INC	730	133.04	97,119.20	
ALPHABET INC-CL A	15,420	165.27	2,548,463.40	
ALPHABET INC-CL C	13,330	166.99	2,225,976.70	
CHARTER COMMUNICATION-A	250	336.00	84,000.00	
COMCAST CORP-CLASS A	10,310	41.66	429,514.60	
ELECTRONIC ARTS INC	620	145.20	90,024.00	
FOX CORP - CLASS A	730	41.71	30,448.30	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	932	29.80	27,773.60	
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	514	79.15	40,683.10	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	440	116.32	51,180.80	

MATCH GROUP INC	682	37.21	25,377.22	
META PLATFORMS INC-CLASS A	5,760	573.25	3,301,920.00	
NETFLIX INC	1,130	754.68	852,788.40	
NEWS CORP - CLASS A	1,450	25.99	37,685.50	
OMNICOM GROUP	510	100.52	51,265.20	
PARAMOUNT GLOBAL	1,604	10.27	16,473.08	
PINTEREST INC- CLASS A	1,460	32.35	47,231.00	
ROBLOX CORP -CLASS A	1,150	42.14	48,461.00	
ROKU INC	306	75.27	23,032.62	
SEA LTD-ADR	950	99.15	94,192.50	
SNAP INC - A	2,685	10.45	28,058.25	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	417	161.79	67,466.43	
THE WALT DISNEY CO.	4,870	95.03	462,796.10	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1,230	119.47	146,948.10	
WARNER BROS DISCOVERY INC	6,490	7.60	49,324.00	
AMAZON.COM INC	24,620	187.83	4,624,374.60	
AUTOZONE INC	50	3,130.96	156,548.00	
BATH & BODY WORKS INC	593	30.38	18,015.34	
BEST BUY CO INC	559	92.68	51,808.12	
BURLINGTON STORES INC	158	251.65	39,760.70	
CARMAX INC	443	72.00	31,896.00	
DICK'S SPORTING GOODS INC	160	204.37	32,699.20	
EBAY INC	1,170	63.10	73,827.00	
GENUINE PARTS CO	390	114.24	44,553.60	
HOME DEPOT INC	2,610	398.91	1,041,155.10	
LKQ CORP	715	37.55	26,848.25	
LOWE'S COS INC	1,500	267.64	401,460.00	
MERCADOLIBRE INC	120	2,047.35	245,682.00	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	150	1,195.22	179,283.00	
POOL CORP	94	366.00	34,404.00	
ROSS STORES INC	810	144.22	116,818.20	
TJX COMPANIES INC	2,960	113.82	336,907.20	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	288	272.77	78,557.76	
ULTA BEAUTY INC	130	373.30	48,529.00	
WILLIAMS-SONOMA INC	320	134.76	43,123.20	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	730	18.41	13,439.30	
COSTCO WHOLESALE CORP	1,160	891.22	1,033,815.20	
DOLLAR GENERAL CORP	550	80.38	44,209.00	
DOLLAR TREE INC	490	66.45	32,560.50	
KROGER CO	1,730	57.37	99,250.10	
SYSCO CORP	1,330	73.92	98,313.60	
TARGET CORP	1,170	151.16	176,857.20	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,830	9.26	16,945.80	

WALMART INC	11,510	82.51	949,690.10	
ALTRIA GROUP INC	4,350	49.71	216,238.50	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,370	56.56	77,487.20	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	720	48.37	34,826.40	
BUNGE GLOBAL SA	384	89.78	34,475.52	
CAMPBELL SOUP CO	618	47.07	29,089.26	
CELSIUS HOLDINGS INC	350	31.66	11,081.00	
COCA-COLA CO/THE	10,630	66.92	711,359.60	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	578	77.98	45,072.44	
CONAGRA BRANDS INC	1,363	29.43	40,113.09	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	420	239.38	100,539.60	
GENERAL MILLS INC	1,480	68.30	101,084.00	
HERSHEY CO/THE	373	181.26	67,609.98	
HORMEL FOODS CORP	990	31.06	30,749.40	
JM SMUCKER CO/THE	281	116.07	32,615.67	
KELLANOVA	840	80.88	67,939.20	
KEURIG DR PEPPER INC	2,840	34.58	98,207.20	
KRAFT HEINZ CO/THE	2,450	34.74	85,113.00	
LAMB WESTON HOLDING INC	370	76.92	28,460.40	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	670	77.86	52,166.20	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	620	55.77	34,577.40	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	3,500	69.23	242,305.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	1,990	53.37	106,206.30	
PEPSICO INC	3,560	171.79	611,572.40	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	4,040	129.86	524,634.40	
TYSON FOODS INC-CL A	731	58.67	42,887.77	
CHURCH & DWIGHT CO INC	624	100.84	62,924.16	
CLOROX COMPANY	311	156.69	48,730.59	
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,980	95.61	189,307.80	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	610	87.25	53,222.50	
KENVUE INC	5,210	22.64	117,954.40	
KIMBERLY-CLARK CORP	840	135.52	113,836.80	
PROCTER & GAMBLE CO	6,150	168.22	1,034,553.00	
ABBOTT LABORATORIES	4,570	114.22	521,985.40	
ALIGN TECHNOLOGY INC	189	219.30	41,447.70	
BAXTER INTERNATIONAL INC	1,380	35.97	49,638.60	
BECTON DICKINSON AND CO	720	238.13	171,453.60	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	3,860	84.73	327,057.80	
CARDINAL HEALTH INC	600	110.89	66,534.00	
CENCORA INC	460	234.47	107,856.20	
CENTENE CORP	1,450	64.22	93,119.00	
CIGNA GROUP/THE	740	316.85	234,469.00	
COOPER COS INC/THE	552	107.82	59,516.64	

CVS HEALTH CORP	3,350	56.49	189,241.50	
DAVITA INC	130	156.99	20,408.70	
DEXCOM INC	1,140	73.44	83,721.60	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,620	69.38	112,395.60	
ELEVANCE HEALTH INC	600	425.27	255,162.00	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	1,180	88.42	104,335.60	
HCA HEALTHCARE INC	510	363.55	185,410.50	
HENRY SCHEIN INC	310	70.00	21,700.00	
HOLOGIC INC	640	80.83	51,731.20	
HUMANA INC	320	260.73	83,433.60	
IDEXX LABORATORIES INC	200	451.41	90,282.00	
INSULET CORP	183	233.63	42,754.29	
INTUITIVE SURGICAL INC	940	511.27	480,593.80	
LABCORP HOLDINGS INC	230	228.63	52,584.90	
MCKESSON CORP	320	507.41	162,371.20	
MEDTRONIC PLC	3,430	90.59	310,723.70	
MOLINA HEALTHCARE INC	160	325.54	52,086.40	
QUEST DIAGNOSTICS	309	155.04	47,907.36	
RESMED INC	410	256.07	104,988.70	
SOLVENTUM CORP	352	73.19	25,762.88	
STERIS PLC	230	224.12	51,547.60	
STRYKER CORP	910	352.82	321,066.20	
TELEFLEX INC	138	233.63	32,240.94	
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,410	564.56	1,360,589.60	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	184	202.75	37,306.00	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	380	212.23	80,647.40	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	540	102.35	55,269.00	
ABBVIE INC	4,630	187.85	869,745.50	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	760	130.19	98,944.40	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	340	284.86	96,852.40	
AMGEN INC	1,400	316.98	443,772.00	
AVANTOR INC	2,120	22.43	47,551.60	
BIO-RAD LABORATORIES-A	64	320.23	20,494.72	
BIO-TECHNE CORP	388	68.68	26,647.84	
BIOGEN INC	350	181.69	63,591.50	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	488	69.73	34,028.24	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	5,380	51.92	279,329.60	
CATALENT INC	429	59.09	25,349.61	
CHARLES RIVER LABORATORIES	125	182.12	22,765.00	
DANAHER CORP	1,760	245.39	431,886.40	
ELI LILLY & CO	2,120	892.70	1,892,524.00	
EXACT SCIENCES CORP	426	69.11	29,440.86	
GILEAD SCIENCES INC	3,180	89.00	283,020.00	

ILLUMINA INC	440	141.95	62,458.00	
INCYTE CORP	600	65.07	39,042.00	
IQVIA HOLDINGS INC	520	214.63	111,607.60	
JOHNSON & JOHNSON	6,280	160.88	1,010,326.40	
MERCK & CO. INC.	6,650	103.98	691,467.00	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	50	1,292.77	64,638.50	
MODERNA INC	790	53.09	41,941.10	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	220	116.08	25,537.60	
PFIZER INC	15,050	28.45	428,172.50	
REGENERON PHARMACEUTICALS	280	933.02	261,245.60	
REVVITY INC	380	116.33	44,205.40	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	845	26.95	22,772.75	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	2,710	17.90	48,509.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,010	554.38	559,923.80	
UNITED THERAPEUTICS CORP	130	348.65	45,324.50	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	680	477.70	324,836.00	
VIATRIS INC	3,111	11.44	35,589.84	
WATERS CORP	130	324.55	42,191.50	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	199	307.92	61,276.08	
ZOETIS INC	1,220	180.01	219,612.20	
BANK OF AMERICA CORP	18,410	41.89	771,194.90	
CITIGROUP INC	5,060	61.76	312,505.60	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	960	41.51	39,849.60	
FIFTH THIRD BANCORP	1,760	43.22	76,067.20	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	30	1,881.83	56,454.90	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	4,310	15.38	66,287.80	
JPMORGAN CHASE & CO	7,500	222.31	1,667,325.00	
KEYCORP	2,531	17.04	43,128.24	
M & T BANK CORP	450	192.57	86,656.50	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,040	185.82	193,252.80	
REGIONS FINANCIAL CORP	2,407	23.50	56,564.50	
TRUIST FINANCIAL CORP	3,610	42.63	153,894.30	
US BANCORP	4,230	47.74	201,940.20	
WELLS FARGO & CO	9,040	64.53	583,351.20	
ALLY FINANCIAL INC	600	34.42	20,652.00	
AMERICAN EXPRESS CO	1,530	267.35	409,045.50	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	240	504.48	121,075.20	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	1,000	143.09	143,090.00	
ARES MANAGEMENT CORP-A	560	169.47	94,903.20	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	2,120	75.20	159,424.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	3,470	454.01	1,575,414.70	
BLACKROCK INC	390	974.07	379,887.30	
BLACKSTONE INC	1,900	167.50	318,250.00	

BLOCK INC	1,370	72.61	99,475.70	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,070	161.27	172,558.90	
CARLYLE GROUP INC/THE	590	50.22	29,629.80	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	306	212.82	65,122.92	
CME GROUP INC	920	226.14	208,048.80	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	450	205.04	92,268.00	
CORPAY INC	192	340.72	65,418.24	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	610	148.90	90,829.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	960	44.97	43,171.20	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	120	454.94	54,592.80	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	1,480	89.72	132,785.60	
FISERV INC	1,550	199.52	309,256.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	780	20.37	15,888.60	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	139	92.58	12,868.62	
GLOBAL PAYMENTS INC	700	99.13	69,391.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	840	512.60	430,584.00	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,500	165.31	247,965.00	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	201	182.44	36,670.44	
KKR & CO INC -A	1,680	139.88	234,998.40	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	200	260.93	52,186.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	94	286.45	26,926.30	
MASTERCARD INC - A	2,190	507.36	1,111,118.40	
MOODY'S CORP	410	462.80	189,748.00	
MORGAN STANLEY	3,210	116.88	375,184.80	
MSCI INC	200	588.72	117,744.00	
NASDAQ INC	1,190	74.69	88,881.10	
NORTHERN TRUST CORP	508	100.19	50,896.52	
PAYPAL HOLDINGS INC	2,690	81.70	219,773.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	570	144.91	82,598.70	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	1,190	27.06	32,201.40	
S&P GLOBAL INC	860	490.61	421,924.60	
SCHWAB (CHARLES) CORP	4,000	71.82	287,280.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	347	75.10	26,059.70	
STATE STREET CORP	790	90.38	71,400.20	
SYNCHRONY FINANCIAL	1,226	55.15	67,613.90	
T ROWE PRICE GROUP INC	690	111.33	76,817.70	
TOAST INC-CLASS A	990	29.49	29,195.10	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	333	132.50	44,122.50	
VISA INC-CLASS A SHARES	4,140	281.73	1,166,362.20	
AFLAC INC	1,400	109.75	153,650.00	
ALLSTATE CORP	640	188.12	120,396.80	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	204	129.41	26,399.64	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,790	76.82	137,507.80	

AON PLC	510	375.44	191,474.40	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	955	105.30	100,561.50	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	540	282.97	152,803.80	
ASSURANT INC	167	191.77	32,025.59	
BROWN & BROWN INC	595	103.98	61,868.10	
CHUBB LTD	1,000	287.99	287,990.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	382	141.25	53,957.50	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	70	444.02	31,081.40	
EVEREST GROUP LTD	105	379.61	39,859.05	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	870	59.96	52,165.20	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	800	112.26	89,808.00	
LOEWS CORP	575	79.57	45,752.75	
MARKEL GROUP INC	34	1,549.80	52,693.20	
MARSH & MCLENNAN COS	1,290	221.31	285,489.90	
METLIFE INC	1,490	82.39	122,761.10	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	658	83.71	55,081.18	
PROGRESSIVE CORP	1,520	243.78	370,545.60	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,050	123.46	129,633.00	
TRAVELERS COS INC/THE	620	250.50	155,310.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	280	290.45	81,326.00	
WR BERKLEY CORP	900	58.16	52,344.00	
ACCENTURE PLC-CL A	1,650	360.80	595,320.00	
ADOBE INC	1,170	483.72	565,952.40	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	400	101.97	40,788.00	
ANSYS INC	210	322.81	67,790.10	
APPLOVIN CORP-CLASS A	580	161.63	93,745.40	
ASPEN TECHNOLOGY INC	100	236.77	23,677.00	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	430	188.73	81,153.90	
AUTODESK INC	520	286.04	148,740.80	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	519	49.15	25,508.85	
CADENCE DESIGN SYS INC	680	257.30	174,964.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	200	207.16	41,432.00	
CLOUDFLARE INC-CLASS A	780	88.76	69,232.80	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	1,300	74.82	97,266.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	620	300.62	186,384.40	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	121	290.04	35,094.84	
DATADOG INC-CLASS A	780	126.60	98,748.00	
DOCUSIGN INC	501	68.99	34,563.99	
DYNATRACE INC	565	54.07	30,549.55	
EPAM SYSTEMS INC	180	191.52	34,473.60	
FAIR ISAAC CORP	62	1,999.97	123,998.14	
FORTINET INC	1,750	80.34	140,595.00	
GARTNER INC	210	513.36	107,805.60	

GEN DIGITAL INC	1,407	26.97	37,946.79	
GODADDY INC-CLASS A	320	160.53	51,369.60	
HUBSPOT INC	123	565.67	69,577.41	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,390	214.67	513,061.30	
INTUIT INC	740	609.27	450,859.80	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	170	275.70	46,869.00	
MICROSOFT CORP	18,550	428.15	7,942,182.50	
MICROSTRATEGY INC-CL A	400	234.34	93,736.00	
MONDAY.COM LTD	80	299.61	23,968.80	
MONGODB INC	180	268.74	48,373.20	
OKTA INC	349	72.24	25,211.76	
ORACLE CORP	4,360	173.52	756,547.20	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	5,420	44.86	243,141.20	
PALO ALTO NETWORKS INC	860	366.44	315,138.40	
PTC INC	270	187.01	50,492.70	
ROPER TECHNOLOGIES INC	290	542.00	157,180.00	
SALESFORCE INC	2,560	290.46	743,577.60	
SAMSARA INC-CL A	410	47.69	19,552.90	
SERVICENOW INC	540	950.85	513,459.00	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	720	116.04	83,548.80	
SYNOPSYS INC	410	501.58	205,647.80	
TWILIO INC - A	437	70.47	30,795.39	
TYLER TECHNOLOGIES INC	100	605.86	60,586.00	
VERISIGN INC	250	181.26	45,315.00	
WIX.COM LTD	150	164.27	24,640.50	
WORKDAY INC-CLASS A	580	237.71	137,871.80	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	567	72.63	41,181.21	
ZSCALER INC	227	184.96	41,985.92	
AMPHENOL CORP-CL A	3,290	69.41	228,358.90	
APPLE INC	38,260	231.41	8,853,746.60	
ARISTA NETWORKS INC	700	394.09	275,863.00	
CDW CORP/DE	330	217.01	71,613.30	
CISCO SYSTEMS INC	10,480	55.74	584,155.20	
CORNING INC	2,060	46.25	95,275.00	
DELL TECHNOLOGIES -C	770	122.55	94,363.50	
F5 INC	167	216.87	36,217.29	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	3,350	19.46	65,191.00	
HP INC	2,760	36.88	101,788.80	
JABIL INC	360	124.72	44,899.20	
JUNIPER NETWORKS INC	802	39.08	31,342.16	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	400	155.98	62,392.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	410	462.32	189,551.20	
NETAPP INC	510	119.41	60,899.10	

PURE STORAGE INC - CLASS A	790	54.05	42,699.50	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	463	103.01	47,693.63	
SUPER MICRO COMPUTER INC	1,300	47.27	61,451.00	
TE CONNECTIVITY PLC	770	149.13	114,830.10	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	120	469.19	56,302.80	
TRIMBLE INC	530	60.90	32,277.00	
WESTERN DIGITAL CORP	807	69.45	56,046.15	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	120	360.09	43,210.80	
AT&T INC	18,830	21.83	411,058.90	
T-MOBILE US INC	1,360	226.36	307,849.60	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	11,110	41.38	459,731.80	
AES CORP	2,110	16.96	35,785.60	
ALLIANT ENERGY CORP	780	60.74	47,377.20	
AMEREN CORPORATION	860	87.80	75,508.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	1,430	98.19	140,411.70	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	520	137.66	71,583.20	
ATMOS ENERGY CORP	430	140.72	60,509.60	
CENTERPOINT ENERGY INC	1,340	29.31	39,275.40	
CMS ENERGY CORP	650	70.76	45,994.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	980	104.60	102,508.00	
CONSTELLATION ENERGY	840	264.41	222,104.40	
DOMINION ENERGY INC	2,040	59.58	121,543.20	
DTE ENERGY COMPANY	510	126.57	64,550.70	
DUKE ENERGY CORP	2,050	117.21	240,280.50	
EDISON INTERNATIONAL	910	83.91	76,358.10	
ENTERGY CORP	590	135.38	79,874.20	
ESSENTIAL UTILITIES INC	610	38.84	23,692.40	
EVERGY INC	730	60.77	44,362.10	
EVERSOURCE ENERGY	1,150	65.84	75,716.00	
EXELON CORP	2,340	40.07	93,763.80	
FIRSTENERGY CORP	1,610	43.41	69,890.10	
NEXTERA ENERGY INC	5,420	81.43	441,350.60	
NISOURCE INC	1,151	34.82	40,077.82	
NRG ENERGY INC	520	87.53	45,515.60	
P G & E CORP	5,830	20.36	118,698.80	
PPL CORP	2,470	32.43	80,102.10	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	1,190	89.63	106,659.70	
SEMPRA	1,570	84.38	132,476.60	
SOUTHERN CO	2,850	91.88	261,858.00	
VISTRA CORP	921	124.03	114,231.63	
WEC ENERGY GROUP INC	740	97.19	71,920.60	
XCEL ENERGY INC	1,520	64.46	97,979.20	
ADVANCED MICRO DEVICES	4,260	156.23	665,539.80	

	ANALOG DEVICES INC	1,330	230.17	306,126.10	
	APPLIED MATERIALS INC	2,160	186.52	402,883.20	
	BROADCOM INC	11,610	173.00	2,008,530.00	
	ENPHASE ENERGY INC	400	83.83	33,532.00	
	ENTEGRIS INC	410	105.01	43,054.10	
	FIRST SOLAR INC	250	198.47	49,617.50	
	INTEL CORP	11,400	22.68	258,552.00	
	KLA CORP	350	673.07	235,574.50	
	LAM RESEARCH CORP	3,500	77.68	271,880.00	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	2,330	81.61	190,151.30	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	1,370	76.29	104,517.30	
	MICRON TECHNOLOGY INC	2,930	107.91	316,176.30	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	130	901.29	117,167.70	
	NVIDIA CORP	64,600	141.54	9,143,484.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	680	243.16	165,348.80	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	1,100	71.25	78,375.00	
	QORVO INC	316	99.01	31,287.16	
	QUALCOMM INC	2,930	170.27	498,891.10	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	437	95.20	41,602.40	
	TERADYNE INC	403	111.75	45,035.25	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	2,380	206.93	492,493.40	
	CBRE GROUP INC - A	850	132.54	112,659.00	
	COSTAR GROUP INC	1,080	74.48	80,438.40	
	ZILLOW GROUP INC - C	478	59.65	28,512.70	
米ドル小計		965,243		130,622,035.14 (20,043,951,292)	
加ドル	ARC RESOURCES LTD	1,760	24.02	42,275.20	
	CAMECO CORP	960	74.76	71,769.60	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	5,340	49.39	263,742.60	
	CENOVUS ENERGY INC	3,390	23.48	79,597.20	
	ENBRIDGE INC	5,930	56.93	337,594.90	
	IMPERIAL OIL LTD	600	105.72	63,432.00	
	KEYERA CORP	660	42.94	28,340.40	
	PARKLAND CORP	500	34.44	17,220.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	1,530	59.07	90,377.10	
	SUNCOR ENERGY INC	3,410	54.16	184,685.60	
	TC ENERGY CORP	2,970	65.68	195,069.60	
	TOURMALINE OIL CORP	870	64.81	56,384.70	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	1,300	120.79	157,027.00	
	BARRICK GOLD CORP	4,940	27.26	134,664.40	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	530	82.73	43,846.90	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	1,389	18.91	26,265.99	
	FRANCO-NEVADA CORP	507	188.50	95,569.50	

IVANHOE MINES LTD-CL A	1,881	19.25	36,209.25	
KINROSS GOLD CORP	4,540	14.62	66,374.80	
NUTRIEN LTD	1,310	66.60	87,246.00	
PAN AMERICAN SILVER CORP	611	34.37	21,000.07	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	1,299	65.80	85,474.20	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	150	135.46	20,319.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,240	91.91	113,968.40	
CAE INC	753	25.81	19,434.93	
STANTEC INC	290	113.64	32,955.60	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	270	126.09	34,044.30	
WSP GLOBAL INC	330	248.34	81,952.20	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	1,200	28.58	34,296.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	503	55.68	28,007.04	
RB GLOBAL INC	520	118.00	61,360.00	
THOMSON REUTERS CORP	430	229.02	98,478.60	
AIR CANADA	550	18.92	10,406.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,530	154.25	236,002.50	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	2,370	107.18	254,016.60	
TFI INTERNATIONAL INC	260	185.88	48,328.80	
MAGNA INTERNATIONAL INC	590	58.35	34,426.50	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	670	98.06	65,700.20	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	139	156.92	21,811.88	
DOLLARAMA INC	750	141.66	106,245.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	2,100	71.43	150,003.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	480	173.00	83,040.00	
METRO INC	776	81.71	63,406.96	
WESTON (GEORGE) LTD	220	218.33	48,032.60	
SAPUTO INC	748	27.25	20,383.00	
BANK OF MONTREAL	2,070	128.95	266,926.50	
BANK OF NOVA SCOTIA	3,020	71.99	217,409.80	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	2,540	87.32	221,792.80	
NATIONAL BANK OF CANADA	855	131.67	112,577.85	
ROYAL BANK OF CANADA	3,720	170.22	633,218.40	
TORONTO-DOMINION BANK	4,620	78.30	361,746.00	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	980	72.91	71,451.80	
BROOKFIELD CORP	3,460	74.35	257,251.00	
TMX GROUP LTD	1,090	42.85	46,706.50	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	60	1,736.70	104,202.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	917	47.01	43,108.17	
INTACT FINANCIAL CORP	473	267.38	126,470.74	
MANULIFE FINANCIAL CORP	4,570	41.41	189,243.70	
POWER CORP OF CANADA	1,536	44.15	67,814.40	
SUN LIFE FINANCIAL INC	1,430	78.40	112,112.00	

	CGI INC	605	157.25	95,136.25	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	60	4,281.75	256,905.00	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	270	144.62	39,047.40	
	OPEN TEXT CORP	973	46.23	44,981.79	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	3,290	109.84	361,373.60	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	971	51.60	50,103.60	
	TELUS CORP	1,220	22.00	26,840.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	411	46.34	19,045.74	
	EMERA INC	675	53.13	35,862.75	
	FORTIS INC	1,170	60.89	71,241.30	
	HYDRO ONE LTD	950	45.39	43,120.50	
	FIRSTSERVICE CORP	137	263.60	36,113.20	
加ドル小計		105,169		7,762,588.91 (857,610,822)	
ユーロ	ENI SPA	6,760	14.42	97,533.28	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,090	16.60	18,099.45	
	NESTE OYJ	1,076	14.79	15,914.04	
	OMV AG	430	38.98	16,761.40	
	REPSOL SA	3,620	11.96	43,313.30	
	TENARIS SA	1,520	14.81	22,518.80	
	TOTALENERGIES SE	5,790	60.27	348,963.30	
	AIR LIQUIDE SA	1,560	167.44	261,206.40	
	AKZO NOBEL	468	59.46	27,827.28	
	ARCELORMITTAL	1,590	22.23	35,345.70	
	ARKEMA	208	80.80	16,806.40	
	BASF SE	2,440	46.17	112,654.80	
	COVESTRO AG	543	58.20	31,602.60	
	DSM-FIRMENICH AG	480	114.75	55,080.00	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	333	99.02	32,973.66	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	1,558	10.70	16,670.60	
	SYENSQO SA	192	73.07	14,029.44	
	SYMRISE AG	480	113.60	54,528.00	
	UPM-KYMMENE OYJ	1,438	28.96	41,644.48	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	468	43.76	20,479.68	
	AIRBUS GROUP SE	1,610	140.48	226,172.80	
	ALSTOM	1,050	20.55	21,577.50	
	BRENNTAG SE	402	61.62	24,771.24	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	1,440	81.88	117,907.20	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	1,179	39.17	46,181.43	
	EIFFAGE	260	85.38	22,198.80	
	FERROVIAL SE	1,472	37.20	54,758.40	
	IMCD NV	150	149.75	22,462.50	
	KINGSPAN GROUP PLC	320	78.95	25,264.00	

KNORR-BREMSE AG	225	79.70	17,932.50	
KONE OYJ-B	899	51.22	46,046.78	
LEGRAND SA	680	104.50	71,060.00	
LEONARDO SPA	1,000	21.79	21,790.00	
METSO CORPORATION	1,250	9.03	11,290.00	
MTU AERO ENGINES AG	140	309.00	43,260.00	
PRYSMIAN SPA	690	68.00	46,920.00	
RATIONAL AG	15	924.50	13,867.50	
RHEINMETALL AG	110	485.80	53,438.00	
SAFRAN SA	990	211.50	209,385.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,470	242.35	356,254.50	
SIEMENS AG-REG	2,040	180.42	368,056.80	
SIEMENS ENERGY AG	1,430	38.35	54,840.50	
THALES SA	230	152.05	34,971.50	
VINCI SA	1,360	100.75	137,020.00	
WARTSILA OYJ ABP	1,289	20.06	25,857.34	
BUREAU VERITAS SA	1,035	29.26	30,284.10	
TELEPERFORMANCE	160	96.06	15,369.60	
WOLTERS KLUWER	640	158.70	101,568.00	
ADP	93	109.30	10,164.90	
AENA SA	247	204.80	50,585.60	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,970	6.72	13,246.28	
DEUTSCHE POST AG-REG	2,730	37.72	102,975.60	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	950	76.00	72,200.00	
CONTINENTAL AG	268	58.70	15,731.60	
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	300	70.28	21,084.00	
FERRARI NV	330	450.10	148,533.00	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	2,010	57.79	116,157.90	
MICHELIN (CGDE)	1,690	31.16	52,660.40	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	404	40.37	16,309.48	
RENAULT SA	490	43.10	21,119.00	
STELLANTIS NV	5,450	12.67	69,062.40	
VOLKSWAGEN AG-PFD	740	92.28	68,287.20	
ADIDAS AG	390	217.00	84,630.00	
HERMES INTERNATIONAL	90	2,105.00	189,450.00	
KERING	180	234.95	42,291.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	730	627.00	457,710.00	
MONCLER SPA	532	54.06	28,759.92	
PUMA SE	260	42.54	11,060.40	
ACCOR SA	541	41.79	22,608.39	
AMADEUS IT GROUP SA	1,320	67.24	88,756.80	
DELIVERY HERO SE	387	41.00	15,867.00	
SODEXO SA	273	80.10	21,867.30	

PUBLICIS GROUPE	590	99.38	58,634.20	
SCOUT24 SE	240	80.60	19,344.00	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	2,083	23.61	49,179.63	
VIVENDI SE	2,083	10.22	21,298.67	
INDITEX	2,980	54.56	162,588.80	
PROSUS NV	4,100	39.70	162,790.50	
ZALANDO SE	601	29.13	17,507.13	
CARREFOUR SA	1,713	14.60	25,009.80	
JERONIMO MARTINS	860	16.80	14,448.00	
KESKO OYJ-B SHS	643	17.89	11,503.27	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	2,610	30.71	80,153.10	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	2,670	59.54	158,971.80	
DANONE	1,720	65.78	113,141.60	
HEINEKEN HOLDING NV	410	67.15	27,531.50	
HEINEKEN NV	730	79.62	58,122.60	
KERRY GROUP PLC-A	390	94.75	36,952.50	
PERNOD-RICARD SA	500	123.35	61,675.00	
BEIERSDORF AG	230	129.00	29,670.00	
HENKEL AG & CO KGAA	400	74.20	29,680.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	600	81.98	49,188.00	
L'OREAL	650	355.65	231,172.50	
AMPLIFON SPA	380	27.46	10,434.80	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	135	62.80	8,478.00	
ESSILORLUXOTTICA	790	219.50	173,405.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	585	39.02	22,826.70	
FRESENIUS SE & CO KGAA	1,254	33.86	42,460.44	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	2,569	29.48	75,734.12	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	723	51.32	37,104.36	
ARGENX SE	180	521.00	93,780.00	
BAYER AG-REG	3,010	25.75	77,507.50	
EUROFINS SCIENTIFIC	362	46.73	16,916.26	
IPSEN	120	115.30	13,836.00	
MERCK KGAA	290	156.30	45,327.00	
QIAGEN N.V.	533	38.72	20,637.76	
SANOFI	3,070	100.08	307,245.60	
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	60	244.60	14,676.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	76	188.80	14,348.80	
UCB SA	330	178.75	58,987.50	
ABN AMRO BANK NV-CVA	809	15.23	12,321.07	
AIB GROUP PLC	3,990	4.85	19,351.50	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	15,320	9.04	138,523.44	
BANCO BPM SPA	4,100	6.08	24,960.80	
BANCO DE SABADELL SA	14,440	1.80	26,064.20	

BANCO SANTANDER SA	38,920	4.57	178,078.46	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	3,690	8.85	32,686.02	
BNP PARIBAS	2,840	65.33	185,537.20	
CAIXABANK S.A	11,895	5.36	63,780.99	
COMMERZBANK AG	2,690	16.15	43,443.50	
CREDIT AGRICOLE SA	3,122	14.00	43,708.00	
ERSTE GROUP BANK AG	820	48.84	40,048.80	
FINECOBANK SPA	1,495	15.01	22,447.42	
ING GROEP NV-CVA	9,000	15.67	141,102.00	
INTESA SANPAOLO	40,460	3.87	156,822.96	
KBC GROEP NV	743	67.58	50,211.94	
MEDIOBANCA SPA	1,030	15.34	15,805.35	
NORDEA BANK ABP	7,720	10.84	83,684.80	
SOCIETE GENERALE	1,600	23.72	37,952.00	
UNICREDIT SPA	3,890	40.15	156,202.95	
ADYEN NV	60	1,417.60	85,056.00	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	4,610	15.67	72,266.36	
DEUTSCHE BOERSE AG	530	216.00	114,480.00	
EDENRED	658	28.93	19,035.94	
EURONEXT NV	240	103.00	24,720.00	
EXOR NV	344	99.80	34,331.20	
NEXI SPA	1,336	5.86	7,828.96	
AEGON LTD	4,432	5.88	26,095.61	
ALLIANZ SE-REG	1,060	293.80	311,428.00	
AXA SA	4,660	34.89	162,587.40	
GENERALI	2,840	25.96	73,726.40	
HANNOVER RUECK SE-REG	148	245.40	36,319.20	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	340	469.50	159,630.00	
NN GROUP NV	680	46.01	31,286.80	
SAMPO OYJ-A SHS	1,336	40.62	54,268.32	
BECHTLE AG	230	33.92	7,801.60	
CAP GEMINI SA	390	175.05	68,269.50	
DASSAULT SYSTEMES SE	1,860	31.52	58,627.20	
NEMETSCHEK SE	178	101.90	18,138.20	
SAP SE	2,780	221.05	614,519.00	
NOKIA OYJ	14,570	4.41	64,319.26	
CELLNEX TELECOM SA	1,417	35.12	49,765.04	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	9,470	28.10	266,107.00	
KONINKLIJKE KPN NV	9,792	3.75	36,778.75	
ORANGE S.A.	5,254	10.10	53,091.67	
TELECOM ITALIA SPA	22,100	0.24	5,308.42	
TELEFONICA SA	13,410	4.33	58,105.53	
E.ON SE	5,959	12.75	75,977.25	

	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	9,250	3.76	34,798.50	
	ENEL SPA	21,380	7.18	153,679.44	
	ENGIE	4,990	15.65	78,093.50	
	FORTUM OYJ	1,026	14.22	14,589.72	
	IBERDROLA SA	16,640	13.95	232,128.00	
	RWE AG	1,700	30.71	52,207.00	
	SNAM SPA	7,266	4.49	32,646.13	
	TERNA SPA	4,271	8.09	34,552.39	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	2,070	29.11	60,257.70	
	VERBUND AG	152	78.80	11,977.60	
	ASM INTERNATIONAL NV	116	521.00	60,436.00	
	ASML HOLDING NV	1,060	664.10	703,946.00	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	180	105.65	19,017.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	3,220	30.70	98,854.00	
	STMICROELECTRONICS NV	1,810	26.17	47,367.70	
	LEG IMMOBILIEN SE	250	88.92	22,230.00	
	VONOVIA SE	1,810	30.98	56,073.80	
ユーロ小計		475,674		13,473,301.70 (2,231,852,426)	
英ポンド	BP PLC	44,330	4.04	179,492.17	
	SHELL PLC-NEW	16,550	25.50	422,107.75	
	ANGLO AMERICAN PLC	3,170	24.34	77,173.65	
	ANTOFAGASTA PLC	1,183	18.11	21,424.13	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	385	37.18	14,314.30	
	GLENCORE PLC	31,150	4.04	125,908.30	
	MONDI PLC	1,253	12.72	15,938.16	
	RIO TINTO PLC	2,840	50.22	142,624.80	
	ASHTEAD GROUP PLC	1,030	58.58	60,337.40	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	8,500	12.92	109,820.00	
	BUNZL PLC	865	34.72	30,032.80	
	DCC PLC	217	50.55	10,969.35	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	3,490	4.43	15,460.70	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	23,180	5.56	128,927.16	
	SPIRAX GROUP PLC	235	67.70	15,909.50	
	EXPERIAN PLC	2,560	38.68	99,020.80	
	INTERTEK GROUP PLC	590	47.84	28,225.60	
	RELX PLC	4,730	36.44	172,361.20	
	RENTOKIL INITIAL PLC	5,870	3.76	22,118.16	
	BARRATT REDROW PLC	5,720	4.72	27,027.00	
	PERSIMMON PLC	994	15.74	15,645.56	
	TAYLOR WIMPEY PLC	13,940	1.54	21,593.06	
	COMPASS GROUP PLC	4,620	25.11	116,008.20	
	ENTAIN PLC	1,657	7.15	11,854.17	

	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	510	85.06	43,380.60	
	PEARSON PLC	1,530	10.43	15,957.90	
	WHITBREAD PLC	639	32.93	21,042.27	
	AUTO TRADER GROUP PLC	2,915	8.80	25,663.66	
	INFORMA PLC	4,393	8.20	36,022.60	
	WPP PLC	3,319	8.22	27,302.09	
	JD SPORTS FASHION PLC	8,520	1.31	11,242.14	
	KINGFISHER PLC	6,190	3.10	19,207.57	
	NEXT PLC	260	100.00	26,000.00	
	TESCO PLC	20,870	3.52	73,629.36	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	857	23.10	19,796.70	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	5,510	26.58	146,455.80	
	COCA-COLA HBC AG-CDI	556	27.76	15,434.56	
	DIAGEO PLC	6,300	25.65	161,626.50	
	IMPERIAL BRANDS PLC	2,070	22.89	47,382.30	
	HALEON PLC	20,850	3.74	78,104.10	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,820	48.49	88,251.80	
	UNILEVER PLC	6,570	47.62	312,863.40	
	SMITH & NEPHEW PLC	1,973	10.88	21,466.24	
	ASTRAZENECA PLC	4,120	116.06	478,167.20	
	GSK PLC	11,200	14.48	162,232.00	
	BARCLAYS PLC	35,650	2.41	86,059.10	
	HSBC HOLDINGS PLC	49,060	6.82	334,638.26	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	175,380	0.57	101,124.10	
	NATWEST GROUP PLC	16,560	3.63	60,261.84	
	STANDARD CHARTERED PLC	5,050	8.53	43,076.50	
	3I GROUP PLC	2,819	32.78	92,406.82	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	1,370	106.05	145,288.50	
	WISE PLC - A	1,551	7.35	11,399.85	
	ADMIRAL GROUP PLC	760	25.72	19,547.20	
	AVIVA PLC	7,600	4.62	35,157.60	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	14,010	2.20	30,892.05	
	PRUDENTIAL PLC	6,840	6.47	44,268.48	
	SAGE GROUP PLC/THE	3,107	10.15	31,536.05	
	HALMA PLC	1,095	24.69	27,035.55	
	BT GROUP PLC	16,090	1.44	23,233.96	
	VODAFONE GROUP PLC	59,770	0.73	44,038.53	
	CENTRICA PLC	15,090	1.23	18,598.42	
	NATIONAL GRID PLC	13,600	9.98	135,809.60	
	SEVERN TRENT PLC	682	26.33	17,957.06	
	SSE PLC	2,750	18.29	50,297.50	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,628	10.50	17,094.00	
		720,493		5,085,243.68	

英ポンド小計				(1,011,556,672)	
スイスフラン	GIVAUDAN-REG	23	4,194.00	96,462.00	
	HOLCIM LTD	1,540	83.04	127,881.60	
	SIG GROUP AG	1,130	18.99	21,458.70	
	SIKA AG-REG	410	247.10	101,311.00	
	ABB LTD-REG	4,300	48.75	209,625.00	
	GEBERIT AG-REG	96	517.20	49,651.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	145	252.80	36,656.00	
	VAT GROUP AG	70	368.00	25,760.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	419	28.00	11,732.00	
	SGS SA-REG	425	91.56	38,913.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	110	220.00	24,200.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	1,460	128.45	187,537.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	95	183.90	17,470.50	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	3	10,540.00	31,620.00	
	NESTLE SA-REG	6,960	84.54	588,398.40	
	ALCON INC	1,390	81.96	113,924.40	
	SONOVA HOLDING AG-REG	153	312.20	47,766.60	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	290	126.70	36,743.00	
	BACHEM HOLDING AG	120	69.70	8,364.00	
	LONZA GROUP AG-REG	190	556.20	105,678.00	
	NOVARTIS AG-REG	5,220	98.66	515,005.20	
	ROCHE HOLDING AG-BR	90	307.20	27,648.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,850	281.20	520,220.00	
	SANDOZ GROUP AG	1,052	38.37	40,365.24	
	JULIUS BAER GROUP LTD	579	54.32	31,451.28	
	PARTNERS GROUP HOLDIING AG	63	1,260.50	79,411.50	
	UBS GROUP AG-REG	8,860	27.87	246,928.20	
	BALOISE HOLDING AG - REG	160	174.20	27,872.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	87	711.60	61,909.20	
	SWISS RE AG	760	111.75	84,930.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	400	518.80	207,520.00	
	TEMENOS AG	155	63.45	9,834.75	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	484	70.28	34,015.52	
	SWISSCOM AG-REG	80	559.00	44,720.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	220	94.55	20,801.00	
スイスフラン小計		39,389		3,833,784.29 (676,586,251)	
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	620	335.60	208,072.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	1,812	149.20	270,350.40	
	ADDTECH AB-B SHARES	1,020	296.00	301,920.00	
	ALFA LAVAL AB	680	481.80	327,624.00	
	ASSA ABLOY AB-B	2,713	334.60	907,769.80	

	ATLAS COPCO AB-A SHS	6,260	179.55	1,123,983.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	4,540	158.75	720,725.00	
	BEIJER REF AB	960	158.50	152,160.00	
	EPIROC AB-A	2,430	213.90	519,777.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	1,126	70.34	79,202.84	
	INDUTRADE AB	620	295.00	182,900.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	349	298.20	104,071.80	
	LIFCO AB-B SHS	830	321.60	266,928.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	3,908	51.78	202,356.24	
	SAAB AB-B	800	230.70	184,560.00	
	SANDVIK AB	3,052	211.00	643,972.00	
	SKANSKA AB-B SHS	1,056	216.90	229,046.40	
	SKF AB-B SHARES-B	1,125	201.40	226,575.00	
	TRELLEBORG AB-B SHS	840	365.00	306,600.00	
	VOLVO AB-B SHS-B	4,980	277.20	1,380,456.00	
	SECURITAS AB-B SHS	1,160	128.90	149,524.00	
	EVOLUTION AB	458	1,044.50	478,381.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	1,260	172.35	217,161.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,708	304.60	520,256.80	
	GETINGE AB-B SHS	650	198.50	129,025.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	540	346.40	187,056.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	4,444	149.60	664,822.40	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	4,361	111.80	487,559.80	
	SWEDBANK AB - A SHARES	2,010	214.90	431,949.00	
	EQT AB	830	320.00	265,600.00	
	INVESTOR AB-B SHS	4,550	306.00	1,392,300.00	
	ERICSSON LM-B SHS	7,741	89.94	696,225.54	
	HEXAGON AB-B SHS	5,010	105.35	527,803.50	
	TELE2 AB-B SHS	1,460	112.95	164,907.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	2,238	83.00	185,754.00	
	SAGAX AB-B	600	263.00	157,800.00	
スウェーデンクローナ小計		78,741		14,995,174.52 (216,530,320)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	1,130	233.50	263,855.00	
	EQUINOR ASA	2,610	282.60	737,586.00	
	NORSK HYDRO A S	4,055	68.52	277,848.60	
	YARA INTERNATIONAL ASA	429	339.60	145,688.40	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	210	1,143.00	240,030.00	
	MOWI ASA	1,466	197.30	289,241.80	
	DNB BANK ASA	3,350	230.40	771,840.00	
	TELENOR ASA	2,000	131.40	262,800.00	
ノルウェークローネ小計		15,250		2,988,889.80 (41,695,012)	

デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	820	442.40	362,768.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,706	132.15	357,597.90	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	10	10,300.00	103,000.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	10	10,640.00	106,400.00	
	DSV A/S	500	1,500.00	750,000.00	
	PANDORA A/S	230	1,040.50	239,315.00	
	CARLSBERG AS-B	293	785.00	230,005.00	
	COLOPLAST-B	302	883.80	266,907.60	
	DEMANT A/S	302	269.80	81,479.60	
	GENMAB A/S	200	1,593.50	318,700.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	8,510	784.30	6,674,393.00	
	ZEALAND PHARMA A/S	210	841.50	176,715.00	
	DANSKE BANK A/S	2,079	198.80	413,305.20	
	TRYG A/S	1,030	161.40	166,242.00	
	ORSTED A/S	528	433.60	228,940.80	
デンマーククローネ小計		17,730		10,475,769.10 (232,562,074)	
豪ドル	SANTOS LTD	8,590	6.93	59,528.70	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	5,000	24.29	121,450.00	
	BHP GROUP LTD	13,630	42.39	577,775.70	
	FORTESCUE LTD	4,520	18.99	85,834.80	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	1,306	49.71	64,921.26	
	MINERAL RESOURCES LTD	530	34.12	18,083.60	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	3,384	18.29	61,893.36	
	PILBARA MINERALS LTD	8,230	2.74	22,550.20	
	RIO TINTO LTD	960	118.08	113,356.80	
	SOUTH32 LTD	12,462	3.71	46,234.02	
	BRAMBLES LTD	3,858	18.16	70,061.28	
	COMPUTERSHARE LTD	1,410	26.23	36,984.30	
	TRANSURBAN GROUP	8,520	12.95	110,334.00	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,665	59.00	98,235.00	
	LOTTERY CORP LTD/THE	7,922	4.97	39,372.34	
	CAR GROUP LTD	930	37.09	34,493.70	
	SEEK LTD	1,090	25.55	27,849.50	
	WESFARMERS LTD	3,000	68.01	204,030.00	
	COLES GROUP LTD	3,500	18.16	63,560.00	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	4,080	32.69	133,375.20	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	2,315	11.77	27,247.55	
	COCHLEAR LTD	160	283.94	45,430.40	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	450	41.70	18,765.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	1,188	27.67	32,871.96	
	CSL LTD	1,230	293.69	361,238.70	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	7,630	31.71	241,947.30	

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	4,490	144.02	646,649.80	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	8,460	38.95	329,517.00	
	WESTPAC BANKING CORP	10,140	32.14	325,899.60	
	ASX LTD	514	67.47	34,679.58	
	MACQUARIE GROUP LTD	1,100	233.22	256,542.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	8,157	7.49	61,095.93	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	7,650	3.69	28,228.50	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	3,874	17.23	66,749.02	
	SUNCORP GROUP LTD	4,089	18.04	73,765.56	
	WISETECH GLOBAL LTD	485	112.00	54,320.00	
	XERO LTD	420	147.40	61,908.00	
	TELSTRA GROUP LTD	10,933	3.87	42,310.71	
	ORIGIN ENERGY LTD	6,790	9.66	65,591.40	
豪ドル小計		174,662		4,764,681.77 (482,900,497)	
ニュージーランドドル	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	1,488	36.84	54,817.92	
	MERCURY NZ LTD	2,262	6.61	14,951.82	
	MERIDIAN ENERGY LTD	3,409	5.92	20,181.28	
ニュージーランドドル小計		7,159		89,951.02 (8,247,609)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	6,690	41.75	279,307.50	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	4,000	114.80	459,200.00	
	MTR CORP	5,500	28.50	156,750.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	3,000	23.15	69,450.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	6,161	34.30	211,322.30	
	SANDS CHINA LTD	7,650	19.86	151,929.00	
	WH GROUP LTD	25,500	6.28	160,140.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	10,731	25.65	275,250.15	
	HANG SENG BANK LTD	2,150	95.50	205,325.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	2,971	312.80	929,328.80	
	AIA GROUP LTD	28,540	62.85	1,793,739.00	
	CLP HOLDINGS LTD	4,694	66.80	313,559.20	
	HONG KONG & CHINA GAS	32,768	6.12	200,540.16	
	POWER ASSETS HOLDINGS	4,000	51.70	206,800.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	5,073	32.30	163,857.90	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	4,433	85.10	377,248.30	
	WHARF HOLDINGS LTD	3,000	21.85	65,550.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	5,000	24.10	120,500.00	
香港ドル小計		161,861		6,139,797.31 (121,199,598)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	5,283	6.51	34,392.33	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	4,100	6.47	26,527.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	16,200	0.82	13,365.00	

	DBS GROUP HOLDINGS LTD	5,062	39.15	198,177.30	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	9,508	15.32	145,662.56	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	3,642	32.49	118,328.58	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	26,600	3.21	85,386.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	8,911	2.87	25,574.57	
シンガポールドル小計		79,306		647,413.34 (75,054,628)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	2,760	15.67	43,249.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	70	808.40	56,588.00	
	BANK HAPOALIM BM	4,308	38.22	164,651.76	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	4,930	37.10	182,903.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	370	149.90	55,463.00	
	NICE LTD	172	662.70	113,984.40	
イスラエルシュケル小計		12,610		616,839.36 (24,955,840)	
合　　計		2,853,287		26,024,703,041 (26,024,703,041)	

(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	409	46,225.18	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	800	30,616.00	
		AMERICAN TOWER CORP	1,260	280,728.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	1,163	22,666.87	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	410	92,803.50	
		BXP INC	500	43,495.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	291	34,422.39	
		CROWN CASTLE INC	1,060	115,444.60	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	910	164,719.10	
		EQUINIX INC	260	237,725.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	497	34,486.83	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	1,040	77,656.80	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	175	51,738.75	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	620	103,168.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	640	31,852.80	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1,820	40,567.80	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	1,967	34,579.86	
		INVITATION HOMES INC	1,640	55,104.00	
		IRON MOUNTAIN INC	818	104,458.60	
		KIMCO REALTY CORP	1,600	37,680.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	300	45,996.00	
		PROLOGIS INC	2,500	293,850.00	

		PUBLIC STORAGE	390	131,172.60	
		REALTY INCOME CORP	2,240	137,334.40	
		REGENCY CENTERS CORP	482	34,226.82	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	340	82,208.60	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	940	160,288.80	
		SUN COMMUNITIES INC	317	42,443.13	
		UDR INC	827	36,280.49	
		VENTAS INC	1,190	77,314.30	
		VICI PROPERTIES INC	2,730	87,633.00	
		WELLTOWER INC	1,640	213,528.00	
		WEYERHAEUSER CO	1,690	53,742.00	
		WP CAREY INC	594	34,024.32	
米ドル小計			34,060	3,070,182.34 (471,119,480)	
加ドル	新株予約権証券	CONSTELLATION SOFTWARE IN-40	60.00	—	
加ドル小計			60.00	— (—)	
ユーロ	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	351	27,076.14	
ユーロ小計			351	27,076.14 (4,485,162)	
英ポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	1,694	10,477.39	
		SEGRO PLC	3,361	27,136.71	
英ポンド小計			5,055	37,614.10 (7,482,196)	
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	2,875	20,728.75	
		GOODMAN GROUP	4,311	155,368.44	
		MIRVAC GROUP	11,628	25,697.88	
		SCENTRE GROUP	15,350	54,185.50	
		STOCKLAND	5,114	26,388.24	
		VICINITY CENTRES	10,480	22,951.20	
豪ドル小計			49,758	305,320.01 (30,944,183)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	6,680	246,158.00	
香港ドル小計			6,680	246,158.00 (4,859,158)	
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	14,700	40,425.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	18,245	37,037.35	
シンガポールドル小計			32,945	77,462.35 (8,980,210)	
合計				527,870,389 (527,870,389)	

(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	組入新株予約権証券時価比率	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　567銘柄	97.7%	—	—	75.6%
	投資証券　34銘柄	—	—	2.3%	1.8%
加ドル	株式　72銘柄	100.0%	—	—	3.2%
	新株予約権証券　1銘柄	—	—	—	—
ユーロ	株式　175銘柄	99.8%	—	—	8.4%
	投資証券　1銘柄	—	—	0.2%	0.0%
英ポンド	株式　66銘柄	99.3%	—	—	3.8%
	投資証券　2銘柄	—	—	0.7%	0.0%
スイスフラン	株式　35銘柄	100.0%	—	—	2.5%
スウェーデンクローナ	株式　36銘柄	100.0%	—	—	0.8%
ノルウェークローネ	株式　8銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式　15銘柄	100.0%	—	—	0.9%
豪ドル	株式　39銘柄	94.0%	—	—	1.8%
	投資証券　6銘柄	—	—	6.0%	0.1%
ニュージーランドドル	株式　3銘柄	100.0%	—	—	0.0%
香港ドル	株式　18銘柄	96.1%	—	—	0.5%
	投資証券　1銘柄	—	—	3.9%	0.0%
シンガポールドル	株式　8銘柄	89.3%	—	—	0.3%
	投資証券　2銘柄	—	—	10.7%	0.0%
イスラエルシュケル	株式　6銘柄	100.0%	—	—	0.1%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	35,789,646	120,604,204
国債証券	44,169,559,480	48,610,675,610
地方債証券	2,728,710,400	2,301,744,855
特殊債券	2,503,274,000	1,990,488,000
社債券	1,296,449,000	2,119,922,997
未収利息	89,566,486	100,057,007
前払費用	1,975,856	4,082,344
流動資産合計	50,825,324,868	55,247,575,017
資産合計	50,825,324,868	55,247,575,017
負債の部		
流動負債		
未払金	-	100,952,000
未払解約金	39,615,852	7,165,542
未払利息	12	-
流動負債合計	39,615,864	108,117,542
負債合計	39,615,864	108,117,542

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
純資産の部		
元本等		
元本	38,462,644,652	41,909,025,247
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	12,323,064,352	13,230,432,228
元本等合計	50,785,709,004	55,139,457,475
純資産合計	50,785,709,004	55,139,457,475
負債純資産合計	50,825,324,868	55,247,575,017

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	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。 （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）

		2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
1．	期首	2022年10月27日	2023年10月27日
	期首元本額	35,139,813,158円	38,462,644,652円
	期首からの追加設定元本額	4,986,525,327円	6,489,404,275円
	期首からの一部解約元本額	1,663,693,833円	3,043,023,680円
	元本の内訳　※		
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	5,672,585,007円	6,654,233,157円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	5,467,454,315円	6,441,711,759円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	4,301,495,149円	5,363,473,116円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	771,286,086円	1,034,126,954円
	インデックスファンド日本債券（ＤＣ専用）	2,204,907,921円	2,155,198,942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	4,634,497,139円	4,627,294,198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）	1,729,528,043円	1,823,476,877円
	Ｔｒａｃｅｒｓ　グローバル３分法（おとなのバランス）	13,139,320円	40,857,385円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	1,004,181円	2,957,057円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）	1,124,075円	2,503,154円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	3,086,148,563円	2,957,890,403円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	1,574,305,602円	1,677,841,144円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	1,578,117,566円	1,769,620,494円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	932,779,513円	1,088,521,133円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	141,132,311円	167,700,410円
	インデックスファンド日本債券（１年決算型）	5,944,219,944円	5,682,161,664円
	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	408,919,917円	419,457,400円
	計	38,462,644,652円	41,909,025,247円
2．	受益権の総数	38,462,644,652口	41,909,025,247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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2022年10月27日 至 2023年10月26日	自 2023年10月27日 至 2024年10月28日

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
（2023年10月26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	△1,676,287,920
地方債証券	△12,270,600
特殊債券	△17,214,000
社債券	△7,280,000
合計	△1,713,052,520

（2024年10月28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	△642,073,430
地方債証券	△12,644,145
特殊債券	△9,575,000
社債券	△10,973,003
合計	△675,265,578

(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）

2023年10月26日現在	2024年10月28日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3204円 (13,204円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3157円 (13,157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４５４回利付国債（２年）	100,000,000	99,788,000	
	第４５５回利付国債（２年）	100,000,000	99,646,000	
	第４５６回利付国債（２年）	100,000,000	99,713,000	
	第４５７回利付国債（２年）	150,000,000	149,509,500	
	第４５８回利付国債（２年）	130,000,000	129,697,100	
	第４６０回利付国債（２年）	100,000,000	99,843,000	
	第４６１回利付国債（２年）	150,000,000	149,952,000	
	第４６３回利付国債（２年）	150,000,000	149,895,000	
	第１４９回利付国債（５年）	100,000,000	99,183,000	
	第１５０回利付国債（５年）	50,000,000	49,533,000	
	第１５１回利付国債（５年）	290,000,000	286,981,100	
	第１５２回利付国債（５年）	100,000,000	99,184,000	
	第１５３回利付国債（５年）	300,000,000	296,514,000	
	第１５５回利付国債（５年）	100,000,000	99,473,000	
	第１５６回利付国債（５年）	200,000,000	198,326,000	
	第１５７回利付国債（５年）	150,000,000	148,573,500	
	第１５８回利付国債（５年）	230,000,000	227,046,800	
	第１５９回利付国債（５年）	150,000,000	147,853,500	
	第１６０回利付国債（５年）	120,000,000	118,712,400	
	第１６１回利付国債（５年）	120,000,000	119,140,800	
	第１６２回利付国債（５年）	130,000,000	128,908,000	
	第１６３回利付国債（５年）	270,000,000	268,763,400	
	第１６４回利付国債（５年）	130,000,000	128,234,600	
	第１６５回利付国債（５年）	130,000,000	128,761,100	
	第１６６回利付国債（５年）	140,000,000	139,232,800	
	第１６７回利付国債（５年）	120,000,000	119,228,400	
	第１６８回利付国債（５年）	150,000,000	150,321,000	
	第１７０回利付国債（５年）	150,000,000	150,202,500	
	第１７１回利付国債（５年）	100,000,000	99,231,000	
	第１７２回利付国債（５年）	200,000,000	199,366,000	
	第１回利付国債（４０年）	70,000,000	75,362,000	
	第２回利付国債（４０年）	125,000,000	128,991,250	
	第３回利付国債（４０年）	85,000,000	87,201,500	
	第４回利付国債（４０年）	115,000,000	117,051,600	

第５回利付国債（４０年）	95,000,000	92,225,050	
第６回利付国債（４０年）	110,000,000	103,779,500	
第７回利付国債（４０年）	130,000,000	116,321,400	
第８回利付国債（４０年）	115,000,000	94,791,050	
第９回利付国債（４０年）	210,000,000	124,242,300	
第１０回利付国債（４０年）	175,000,000	121,621,500	
第１１回利付国債（４０年）	140,000,000	92,722,000	
第１２回利付国債（４０年）	175,000,000	101,461,500	
第１３回利付国債（４０年）	210,000,000	118,962,900	
第１４回利付国債（４０年）	210,000,000	126,191,100	
第１５回利付国債（４０年）	230,000,000	152,016,200	
第１６回利付国債（４０年）	220,000,000	158,943,400	
第１７回利付国債（４０年）	80,000,000	75,013,600	
第１回クライメート・トランジション利付国債（５年）	60,000,000	59,416,200	
第１回クライメート・トランジション利付国債（１０年）	70,000,000	68,904,500	
第２回クライメート・トランジション利付国債（１０年）	50,000,000	50,302,000	
第３４１回利付国債（１０年）	700,000,000	699,678,000	
第３４２回利付国債（１０年）	630,000,000	627,561,900	
第３４３回利付国債（１０年）	645,000,000	641,581,500	
第３４４回利付国債（１０年）	700,000,000	695,527,000	
第３４５回利付国債（１０年）	660,000,000	655,162,200	
第３４６回利付国債（１０年）	460,000,000	456,246,400	
第３４７回利付国債（１０年）	680,000,000	673,784,800	
第３４８回利付国債（１０年）	500,000,000	494,860,000	
第３４９回利付国債（１０年）	590,000,000	583,238,600	
第３５０回利付国債（１０年）	540,000,000	533,066,400	
第３５１回利付国債（１０年）	435,000,000	428,775,150	
第３５２回利付国債（１０年）	420,000,000	413,267,400	
第３５３回利付国債（１０年）	400,000,000	392,948,000	
第３５４回利付国債（１０年）	325,000,000	318,662,500	
第３５５回利付国債（１０年）	350,000,000	342,559,000	
第３５６回利付国債（１０年）	350,000,000	341,841,500	
第３５７回利付国債（１０年）	560,000,000	546,302,400	
第３５８回利付国債（１０年）	390,000,000	379,918,500	
第３５９回利付国債（１０年）	420,000,000	408,538,200	
第３６０回利付国債（１０年）	580,000,000	563,168,400	
第３６１回利付国債（１０年）	460,000,000	445,712,400	
第３６２回利付国債（１０年）	400,000,000	386,740,000	
第３６３回利付国債（１０年）	500,000,000	482,335,000	
第３６４回利付国債（１０年）	500,000,000	481,060,000	

第３６５回利付国債（１０年）	410,000,000	393,399,100	
第３６６回利付国債（１０年）	480,000,000	462,811,200	
第３６７回利付国債（１０年）	420,000,000	403,741,800	
第３６８回利付国債（１０年）	450,000,000	431,392,500	
第３６９回利付国債（１０年）	490,000,000	479,861,900	
第３７０回利付国債（１０年）	420,000,000	410,251,800	
第３７１回利付国債（１０年）	480,000,000	463,540,800	
第３７２回利付国債（１０年）	500,000,000	498,135,000	
第３７３回利付国債（１０年）	440,000,000	429,391,600	
第３７４回利付国債（１０年）	410,000,000	406,096,800	
第３７５回利付国債（１０年）	280,000,000	284,211,200	
第１回利付国債（３０年）	50,000,000	55,320,500	
第３回利付国債（３０年）	70,000,000	76,521,900	
第５回利付国債（３０年）	80,000,000	87,990,400	
第６回利付国債（３０年）	50,000,000	55,925,500	
第７回利付国債（３０年）	50,000,000	55,821,000	
第８回利付国債（３０年）	170,000,000	183,855,000	
第９回利付国債（３０年）	70,000,000	73,519,600	
第１０回利付国債（３０年）	50,000,000	51,279,500	
第１１回利付国債（３０年）	70,000,000	75,182,800	
第１２回利付国債（３０年）	50,000,000	55,373,500	
第１３回利付国債（３０年）	180,000,000	197,726,400	
第１４回利付国債（３０年）	108,000,000	122,502,240	
第１５回利付国債（３０年）	147,000,000	168,163,590	
第１６回利付国債（３０年）	65,000,000	74,379,500	
第１７回利付国債（３０年）	50,000,000	56,759,500	
第１８回利付国債（３０年）	110,000,000	123,807,200	
第１９回利付国債（３０年）	40,000,000	45,000,800	
第２０回利付国債（３０年）	60,000,000	68,739,000	
第２１回利付国債（３０年）	70,000,000	78,767,500	
第２２回利付国債（３０年）	70,000,000	80,243,100	
第２３回利付国債（３０年）	75,000,000	85,968,000	
第２４回利付国債（３０年）	68,000,000	77,970,840	
第２５回利付国債（３０年）	60,000,000	67,423,200	
第２６回利付国債（３０年）	170,000,000	192,938,100	
第２７回利付国債（３０年）	89,000,000	101,918,350	
第２８回利付国債（３０年）	144,000,000	164,738,880	
第２９回利付国債（３０年）	176,000,000	198,781,440	
第３０回利付国債（３０年）	147,000,000	163,825,620	
第３１回利付国債（３０年）	120,000,000	131,829,600	
第３２回利付国債（３０年）	160,000,000	177,556,800	
第３３回利付国債（３０年）	195,000,000	207,645,750	

第３４回利付国債（３０年）	180,000,000	196,187,400	
第３５回利付国債（３０年）	193,000,000	203,943,100	
第３６回利付国債（３０年）	195,000,000	205,331,100	
第３７回利付国債（３０年）	211,000,000	218,136,020	
第３８回利付国債（３０年）	135,000,000	136,890,000	
第３９回利付国債（３０年）	135,000,000	138,624,750	
第４０回利付国債（３０年）	100,000,000	100,924,000	
第４１回利付国債（３０年）	130,000,000	128,789,700	
第４２回利付国債（３０年）	135,000,000	133,346,250	
第４３回利付国債（３０年）	125,000,000	123,096,250	
第４４回利付国債（３０年）	130,000,000	127,627,500	
第４５回利付国債（３０年）	140,000,000	132,323,800	
第４６回利付国債（３０年）	160,000,000	150,704,000	
第４７回利付国債（３０年）	155,000,000	148,214,100	
第４８回利付国債（３０年）	135,000,000	124,069,050	
第４９回利付国債（３０年）	140,000,000	128,184,000	
第５０回利付国債（３０年）	165,000,000	133,242,450	
第５１回利付国債（３０年）	160,000,000	114,507,200	
第５２回利付国債（３０年）	190,000,000	141,852,100	
第５３回利付国債（３０年）	135,000,000	102,609,450	
第５４回利付国債（３０年）	160,000,000	126,779,200	
第５５回利付国債（３０年）	140,000,000	110,377,400	
第５６回利付国債（３０年）	140,000,000	109,907,000	
第５７回利付国債（３０年）	190,000,000	148,524,900	
第５８回利付国債（３０年）	180,000,000	140,110,200	
第５９回利付国債（３０年）	170,000,000	128,542,100	
第６０回利付国債（３０年）	120,000,000	94,825,200	
第６１回利付国債（３０年）	130,000,000	97,333,600	
第６２回利付国債（３０年）	120,000,000	84,793,200	
第６３回利付国債（３０年）	120,000,000	82,012,800	
第６４回利付国債（３０年）	130,000,000	88,312,900	
第６５回利付国債（３０年）	140,000,000	94,610,600	
第６６回利付国債（３０年）	180,000,000	120,916,800	
第６７回利付国債（３０年）	165,000,000	116,653,350	
第６８回利付国債（３０年）	140,000,000	98,421,400	
第６９回利付国債（３０年）	145,000,000	104,313,000	
第７０回利付国債（３０年）	140,000,000	100,251,200	
第７１回利付国債（３０年）	160,000,000	114,036,800	
第７２回利付国債（３０年）	160,000,000	113,502,400	
第７３回利付国債（３０年）	150,000,000	105,912,000	
第７４回利付国債（３０年）	150,000,000	114,726,000	
第７５回利付国債（３０年）	150,000,000	123,607,500	

第７６回利付国債（３０年）	150,000,000	126,415,500	
第７７回利付国債（３０年）	130,000,000	114,648,300	
第７８回利付国債（３０年）	150,000,000	125,733,000	
第７９回利付国債（３０年）	140,000,000	111,200,600	
第８０回利付国債（３０年）	130,000,000	119,546,700	
第８１回利付国債（３０年）	150,000,000	131,221,500	
第８２回利付国債（３０年）	150,000,000	137,449,500	
第８３回利付国債（３０年）	150,000,000	150,133,500	
第８７回利付国債（２０年）	130,000,000	133,277,300	
第８８回利付国債（２０年）	300,000,000	309,192,000	
第９０回利付国債（２０年）	16,000,000	16,530,240	
第９１回利付国債（２０年）	250,000,000	258,752,500	
第９２回利付国債（２０年）	60,000,000	62,113,800	
第９３回利付国債（２０年）	60,000,000	62,212,800	
第９４回利付国債（２０年）	50,000,000	51,962,000	
第９５回利付国債（２０年）	82,000,000	85,981,920	
第９６回利付国債（２０年）	248,000,000	258,745,840	
第９７回利付国債（２０年）	45,000,000	47,248,650	
第９８回利付国債（２０年）	94,000,000	98,429,280	
第９９回利付国債（２０年）	117,000,000	122,943,600	
第１００回利付国債（２０年）	80,000,000	84,616,800	
第１０１回利付国債（２０年）	66,000,000	70,249,080	
第１０２回利付国債（２０年）	81,000,000	86,549,310	
第１０３回利付国債（２０年）	71,000,000	75,610,030	
第１０４回利付国債（２０年）	33,000,000	34,906,740	
第１０５回利付国債（２０年）	77,000,000	81,688,530	
第１０６回利付国債（２０年）	62,000,000	66,012,020	
第１０７回利付国債（２０年）	130,000,000	138,329,100	
第１０８回利付国債（２０年）	134,000,000	141,498,640	
第１０９回利付国債（２０年）	107,000,000	113,262,710	
第１１０回利付国債（２０年）	98,000,000	104,576,780	
第１１１回利付国債（２０年）	95,000,000	102,069,900	
第１１２回利付国債（２０年）	80,000,000	85,592,000	
第１１３回利付国債（２０年）	290,000,000	311,120,700	
第１１４回利付国債（２０年）	52,000,000	55,988,400	
第１１５回利付国債（２０年）	125,000,000	135,212,500	
第１１６回利付国債（２０年）	135,000,000	146,504,700	
第１１７回利付国債（２０年）	243,000,000	262,437,570	
第１１８回利付国債（２０年）	70,000,000	75,450,200	
第１１９回利付国債（２０年）	60,000,000	64,015,800	
第１２０回利付国債（２０年）	170,000,000	179,470,700	
第１２１回利付国債（２０年）	142,000,000	152,637,220	

第１２２回利付国債（２０年）	17,000,000	18,176,570	
第１２３回利付国債（２０年）	195,000,000	212,390,100	
第１２４回利付国債（２０年）	90,000,000	97,492,500	
第１２５回利付国債（２０年）	90,000,000	98,829,900	
第１２６回利付国債（２０年）	105,000,000	113,974,350	
第１２７回利付国債（２０年）	50,000,000	53,966,000	
第１２８回利付国債（２０年）	135,000,000	145,974,150	
第１２９回利付国債（２０年）	85,000,000	91,368,200	
第１３０回利付国債（２０年）	150,000,000	161,433,000	
第１３１回利付国債（２０年）	92,000,000	98,405,040	
第１３２回利付国債（２０年）	135,000,000	144,575,550	
第１３３回利付国債（２０年）	130,000,000	140,107,500	
第１３４回利付国債（２０年）	120,000,000	129,500,400	
第１３５回利付国債（２０年）	70,000,000	75,049,100	
第１３６回利付国債（２０年）	70,000,000	74,530,400	
第１３７回利付国債（２０年）	100,000,000	107,253,000	
第１３８回利付国債（２０年）	120,000,000	126,916,800	
第１３９回利付国債（２０年）	100,000,000	106,527,000	
第１４０回利付国債（２０年）	318,000,000	341,401,620	
第１４１回利付国債（２０年）	235,000,000	252,324,200	
第１４２回利付国債（２０年）	165,000,000	178,500,300	
第１４３回利付国債（２０年）	154,000,000	164,136,280	
第１４４回利付国債（２０年）	130,000,000	137,532,200	
第１４５回利付国債（２０年）	215,000,000	230,918,600	
第１４６回利付国債（２０年）	195,000,000	209,309,100	
第１４７回利付国債（２０年）	208,000,000	221,232,960	
第１４８回利付国債（２０年）	220,000,000	231,728,200	
第１４９回利付国債（２０年）	225,000,000	236,659,500	
第１５０回利付国債（２０年）	250,000,000	260,172,500	
第１５１回利付国債（２０年）	240,000,000	244,756,800	
第１５２回利付国債（２０年）	250,000,000	254,345,000	
第１５３回利付国債（２０年）	270,000,000	276,725,700	
第１５４回利付国債（２０年）	230,000,000	232,916,400	
第１５５回利付国債（２０年）	270,000,000	267,186,600	
第１５６回利付国債（２０年）	200,000,000	184,522,000	
第１５７回利付国債（２０年）	220,000,000	197,225,600	
第１５８回利付国債（２０年）	230,000,000	212,798,300	
第１５９回利付国債（２０年）	210,000,000	195,814,500	
第１６０回利付国債（２０年）	210,000,000	197,395,800	
第１６１回利付国債（２０年）	180,000,000	166,410,000	
第１６２回利付国債（２０年）	210,000,000	193,233,600	
第１６３回利付国債（２０年）	195,000,000	178,575,150	

	第１６４回利付国債（２０年）	255,000,000	229,380,150	
	第１６５回利付国債（２０年）	200,000,000	178,972,000	
	第１６６回利付国債（２０年）	180,000,000	164,768,400	
	第１６７回利付国債（２０年）	200,000,000	177,182,000	
	第１６８回利付国債（２０年）	180,000,000	156,288,600	
	第１６９回利付国債（２０年）	190,000,000	161,560,800	
	第１７０回利付国債（２０年）	160,000,000	135,227,200	
	第１７１回利付国債（２０年）	170,000,000	142,886,700	
	第１７２回利付国債（２０年）	230,000,000	195,433,300	
	第１７３回利付国債（２０年）	190,000,000	160,472,100	
	第１７４回利付国債（２０年）	200,000,000	167,992,000	
	第１７５回利付国債（２０年）	200,000,000	169,922,000	
	第１７６回利付国債（２０年）	190,000,000	160,569,000	
	第１７７回利付国債（２０年）	200,000,000	165,202,000	
	第１７８回利付国債（２０年）	220,000,000	183,902,400	
	第１７９回利付国債（２０年）	220,000,000	182,892,600	
	第１８０回利付国債（２０年）	190,000,000	165,714,200	
	第１８１回利付国債（２０年）	210,000,000	185,562,300	
	第１８２回利付国債（２０年）	200,000,000	182,160,000	
	第１８３回利付国債（２０年）	190,000,000	181,216,300	
	第１８４回利付国債（２０年）	200,000,000	180,782,000	
	第１８５回利付国債（２０年）	200,000,000	180,082,000	
	第１８６回利付国債（２０年）	200,000,000	192,218,000	
	第１８７回利付国債（２０年）	170,000,000	157,448,900	
	第１８８回利付国債（２０年）	175,000,000	169,968,750	
	第１８９回利付国債（２０年）	160,000,000	162,793,600	
国債証券 合計		50,570,000,000	48,610,675,610	
地方債証券	第４回東京都公募公債（東京グリーンボンド（５年））	100,000,000	99,723,111	
	第２６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	106,736,000	
	令和３年度第６回北海道公募公債（５年）	100,000,000	99,096,000	
	平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	101,331,000	
	第２４回群馬県公募公債（１０年）	100,000,000	95,451,000	
	令和２年度第２回大分県公募公債	100,000,000	96,632,000	
	第１６５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,308,000	
	第２０８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,993,000	
	第２５３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,542,000	
	第２５４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,618,000	
	第２５５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,359,000	
	平成２８年度第１回長崎県公募公債	100,000,000	99,179,000	
	平成２７年度第１回佐賀県公募公債	100,000,000	100,065,000	
	平成２９年度第１回滋賀県公募公債	100,000,000	98,817,000	
	平成２７年度第２回熊本県公募公債（１０年）	100,000,000	100,076,000	

	第２回名古屋市定時償還公募公債（１０年）	10,000,000	10,006,628	
	平成２７年度第５回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	100,120,116	
	第１８回川崎市公募公債（２０年）	100,000,000	104,790,000	
	令和２年度第１回鹿児島県公募公債（５年）	100,000,000	99,619,000	
	平成２６年度第１回福井県公募公債	100,000,000	103,997,000	
	令和６年度第１回福井県公募公債	100,000,000	99,975,000	
	令和３年度第１回山梨県公募公債（１０年）	100,000,000	95,649,000	
	令和元年度第１回秋田県公募公債	100,000,000	96,662,000	
地方債証券 合計		2,310,000,000	2,301,744,855	
特殊債券	第５回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	99,127,000	
	第３５回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	198,156,000	
	第６０回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	98,863,000	
	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	104,136,000	
	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	105,280,000	
	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	100,016,000	
	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	99,335,000	
	第３２４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	197,522,000	
	第３５１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,471,000	
	第９６回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	197,976,000	
	第９７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,001,000	
	第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	197,730,000	
	第５２回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	98,377,000	
	第３９５回信金中金債（５年）	100,000,000	98,692,000	
	第４０５回信金中金債（５年）	100,000,000	98,732,000	
	第３７回国際協力機構債券	100,000,000	99,074,000	
特殊債券 合計		2,000,000,000	1,990,488,000	
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	99,641,000	
	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	99,197,000	
	第２４回森ビル株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	98,130,000	
	第１７回株式会社オリエンタルランド無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	98,425,000	
	第１７回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）（ソーシャルボンド）	100,000,000	98,733,000	
	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	99,492,000	
	第５３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	105,497,000	

	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	99,735,997	
	第２３回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	200,000,000	212,600,000	
	第３２回東海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）	200,000,000	209,202,000	
	第５１０回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,289,000	
	第４００回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	98,805,000	
	第４４７回中国電力株式会社社債（一般担保付）（トランジションボンド）	100,000,000	98,783,000	
	第３２３回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,648,000	
	第８回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,499,000	
	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	104,160,000	
	第３２回大阪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	103,528,000	
	第４７回大阪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	96,223,000	
	第５１回大阪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	97,335,000	
社債券 合計		2,100,000,000	2,119,922,997	
合計		56,980,000,000	55,022,831,462	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
預金	160,502,854	120,199,890
コール・ローン	80,759,786	77,304,557
国債証券	153,961,084,481	166,410,220,148
派生商品評価勘定	227,502	-
未収入金	-	86,990,010
未収利息	1,244,838,700	1,490,541,754
前払費用	72,483,897	78,822,223
流動資産合計	155,519,897,220	168,264,078,582
資産合計	155,519,897,220	168,264,078,582
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	24,377	976,977
未払解約金	121,462,048	199,843,016
未払利息	28	-
流動負債合計	121,486,453	200,819,993
負債合計	121,486,453	200,819,993
純資産の部		
元本等		
元本	57,315,428,247	55,035,546,538
剰余金		

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
剰余金又は欠損金（△）	98,082,982,520	113,027,712,051
元本等合計	155,398,410,767	168,063,258,589
純資産合計	155,398,410,767	168,063,258,589
負債純資産合計	155,519,897,220	168,264,078,582

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

		2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
1．	期首	2022年10月27日	2023年10月27日
	期首元本額	57,575,300,165円	57,315,428,247円
	期首からの追加設定元本額	3,716,701,373円	3,580,271,656円
	期首からの一部解約元本額	3,976,573,291円	5,860,153,365円
	元本の内訳　※		
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし（ＤＣ専用）	18,929,458,764円	20,814,853,738円
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	426,585,541円	452,227,508円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	595,287,919円	638,673,399円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	843,353,485円	956,118,454円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	757,207,482円	920,276,496円
	財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	15,280,881,335円	12,113,261,664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	2,340,604,123円	2,116,811,210円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	12,133,636,705円	11,190,522,771円
	財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	891,805,816円	840,966,833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）	143,812,763円	134,624,416円
	財産３分法（適格機関投資家専用）	316,658,443円	367,411,531円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	493,149円	1,299,567円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）	1,103,924円	2,195,989円
	財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）奇数月分配型	591,254円	35,721,297円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	501,546,917円	436,514,279円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	59,299,022円	56,348,839円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	86,274,514円	87,755,143円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	91,903,491円	95,905,016円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	69,258,250円	74,871,387円
	インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）１年決算型	3,511,904,503円	3,344,135,843円
	海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	333,760,847円	355,051,158円
	計	57,315,428,247円	55,035,546,538円

		2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
2．	受益権の総数	57,315,428,247口	55,035,546,538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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2022年10月27日 至 2023年10月26日	自 2023年10月27日 至 2024年10月28日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2023年10月26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	△5,555,230,909
合計	△5,555,230,909

（2024年10月28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	8,673,481,820
合計	8,673,481,820

(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)

（2023年10月26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	65,975,344	－	65,772,219	203,125
	ユーロ	24,119,200	－	24,114,803	4,397
	英ポンド	15,865,494	－	15,807,195	58,299
	豪ドル	11,372,724	－	11,212,118	160,606
	中国元	14,617,926	－	14,638,103	△20,177
合計		65,975,344	－	65,772,219	203,125

（2024年10月28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	127,288,703	－	128,265,680	△976,977
	米ドル	34,370,080	－	34,675,180	△305,100
	加ドル	10,101,140	－	10,163,129	△61,989
	ユーロ	43,271,390	－	43,562,083	△290,693
	英ポンド	9,464,880	－	9,546,902	△82,022
	豪ドル	9,461,137	－	9,505,513	△44,376
	中国元	20,620,076	－	20,812,873	△192,797
合計		127,288,703	－	128,265,680	△976,977

（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。

①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。

②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）

2023年10月26日現在		2024年10月28日現在	
1口当たり純資産額	2.7113円	1口当たり純資産額	3.0537円
(1万口当たり純資産額)	(27,113円)	(1万口当たり純資産額)	(30,537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-3.0%-25/09/30	4,200,000.00	4,150,330.80	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/09/30	1,570,000.00	1,512,487.76	
		US TREASURY N/B-4.25%-25/10/15	170,000.00	169,912.62	
		US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,382,337.60	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	2,110,000.00	2,026,431.34	
		US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	3,440,000.00	3,368,551.20	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,300,663.32	
		US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	3,420,000.00	3,278,925.00	
		US TREASURY N/B-4.875%-25/11/30	4,000,000.00	4,025,156.00	
		US TREASURY N/B-4.0%-25/12/15	1,510,000.00	1,505,870.15	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	1,963,358.00	
		US TREASURY N/B-3.875%-26/01/15	1,150,000.00	1,145,417.25	
		US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	1,814,228.40	
		US TREASURY N/B-0.375%-26/01/31	2,370,000.00	2,259,368.40	
		US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	1,844,155.80	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,310,000.00	3,203,070.45	
		US TREASURY N/B-4.0%-26/02/15	3,000,000.00	2,992,500.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,750,562.72	
		US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	3,650,000.00	3,474,770.80	
		US TREASURY N/B-4.625%-26/02/28	2,820,000.00	2,834,759.88	
		US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	4,490,000.00	4,370,732.13	
		US TREASURY N/B-0.75%-26/03/31	2,400,000.00	2,286,842.40	
		US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	1,050,000.00	1,022,724.15	
		US TREASURY N/B-0.75%-26/04/30	2,740,000.00	2,604,389.18	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	4,840,000.00	4,658,500.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-26/05/15	6,750,000.00	6,696,999.00	
		US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	2,740,000.00	2,655,657.32	
		US TREASURY N/B-0.75%-26/05/31	2,800,000.00	2,654,419.60	
		US TREASURY N/B-4.125%-26/06/15	3,000,000.00	2,998,827.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	1,927,812.00	
		US TREASURY N/B-4.5%-26/07/15	3,600,000.00	3,621,794.40	
		US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	960,000.00	923,662.08	
		US TREASURY N/B-0.625%-26/07/31	1,760,000.00	1,656,392.32	
		US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,820,700.00	
		US TREASURY N/B-0.75%-26/08/31	3,000,000.00	2,822,694.00	
		US TREASURY N/B-3.75%-26/08/31	3,400,000.00	3,377,818.40	
		US TREASURY N/B-4.625%-26/09/15	2,600,000.00	2,624,221.60	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,547,320.32	

		US TREASURY N/B-0.875%-26/09/30	2,000,000.00	1,881,952.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	250,000.00	238,251.75	
		US TREASURY N/B-1.125%-26/10/31	3,950,000.00	3,725,959.95	
		US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,040,000.00	2,917,329.92	
		US TREASURY N/B-4.625%-26/11/15	3,200,000.00	3,233,622.40	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,400,000.00	2,282,904.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-26/11/30	2,210,000.00	2,085,773.69	
		US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	1,904,530.00	
		US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	4,000,000.00	3,779,684.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	2,680,000.00	2,573,531.64	
		US TREASURY N/B-4.125%-27/02/15	1,880,000.00	1,881,981.52	
		US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,390,000.00	1,299,650.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-27/03/15	2,300,000.00	2,309,880.80	
		US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	670,000.00	617,420.41	
		US TREASURY N/B-4.5%-27/04/15	3,190,000.00	3,222,273.23	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	1,380,000.00	1,263,939.24	
		US TREASURY N/B-2.75%-27/04/30	1,430,000.00	1,385,843.03	
		US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,386,731.42	
		US TREASURY N/B-4.5%-27/05/15	4,700,000.00	4,749,199.60	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	1,600,000.00	1,461,000.00	
		US TREASURY N/B-2.625%-27/05/31	1,750,000.00	1,689,091.25	
		US TREASURY N/B-4.625%-27/06/15	8,450,000.00	8,570,801.20	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	2,600,000.00	2,367,674.40	
		US TREASURY N/B-3.25%-27/06/30	5,000,000.00	4,900,195.00	
		US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	4,450,000.00	4,026,551.35	
		US TREASURY N/B-2.75%-27/07/31	930,000.00	898,502.76	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	2,819,281.60	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	1,900,000.00	1,720,241.00	
		US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	4,090,000.00	3,678,603.26	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	3,640,000.00	3,276,567.84	
		US TREASURY N/B-4.125%-27/10/31	800,000.00	801,733.60	
		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	1,400,000.00	1,483,944.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	2,864,279.74	
		US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	220,000.00	198,223.30	
		US TREASURY N/B-3.875%-27/11/30	2,320,000.00	2,307,991.68	
		US TREASURY N/B-0.625%-27/12/31	2,410,000.00	2,165,515.14	
		US TREASURY N/B-0.75%-28/01/31	2,850,000.00	2,564,107.95	
		US TREASURY N/B-3.5%-28/01/31	1,450,000.00	1,425,416.70	
		US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	3,838,436.00	
		US TREASURY N/B-1.125%-28/02/29	3,830,000.00	3,481,408.72	
		US TREASURY N/B-4.0%-28/02/29	2,650,000.00	2,645,031.25	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/03/31	960,000.00	874,424.64	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	3,370,000.00	3,061,826.98	

		US TREASURY N/B-3.5%-28/04/30	3,000,000.00	2,945,505.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	2,440,000.00	2,344,305.64	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	4,300,000.00	3,898,302.60	
		US TREASURY N/B-3.625%-28/05/31	1,020,000.00	1,005,097.80	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	3,300,000.00	2,985,015.00	
		US TREASURY N/B-4.0%-28/06/30	200,000.00	199,578.00	
		US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	2,920,000.00	2,609,977.76	
		US TREASURY N/B-4.125%-28/07/31	5,950,000.00	5,960,918.25	
		US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	4,024,780.20	
		US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	2,960,000.00	2,652,319.84	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	3,700,000.00	3,324,361.20	
		US TREASURY N/B-4.625%-28/09/30	2,400,000.00	2,447,529.60	
		US TREASURY N/B-1.375%-28/10/31	3,800,000.00	3,424,229.40	
		US TREASURY N/B-4.875%-28/10/31	2,100,000.00	2,161,933.20	
		US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,117,648.17	
		US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	2,610,000.00	2,518,138.44	
		US TREASURY N/B-1.5%-28/11/30	4,930,000.00	4,455,581.17	
		US TREASURY N/B-4.375%-28/11/30	1,050,000.00	1,061,688.60	
		US TREASURY N/B-1.375%-28/12/31	870,000.00	780,705.81	
		US TREASURY N/B-4.0%-29/01/31	2,700,000.00	2,692,035.00	
		US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,590,000.00	4,329,926.01	
		US TREASURY N/B-4.25%-29/02/28	5,000,000.00	5,035,835.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-29/03/31	4,630,000.00	4,313,673.77	
		US TREASURY N/B-2.875%-29/04/30	2,000,000.00	1,901,522.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	4,810,000.00	4,475,175.90	
		US TREASURY N/B-4.5%-29/05/31	620,000.00	631,273.46	
		US TREASURY N/B-3.25%-29/06/30	4,980,000.00	4,805,112.36	
		US TREASURY N/B-4.25%-29/06/30	3,000,000.00	3,022,617.00	
		US TREASURY N/B-4.0%-29/07/31	3,500,000.00	3,490,154.50	
		US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	1,670,000.00	1,495,496.69	
		US TREASURY N/B-3.875%-29/09/30	325,000.00	322,041.85	
		US TREASURY N/B-4.0%-29/10/31	2,520,000.00	2,511,827.64	
		US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	6,940,000.00	6,221,869.62	
		US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	3,808,176.40	
		US TREASURY N/B-4.0%-30/02/28	1,650,000.00	1,643,231.70	
		US TREASURY N/B-3.625%-30/03/31	2,550,000.00	2,492,423.55	
		US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,172,749.02	
		US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	3,870,000.00	3,208,168.08	
		US TREASURY N/B-3.75%-30/05/31	710,000.00	697,713.45	
		US TREASURY N/B-3.75%-30/06/30	380,000.00	373,231.06	
		US TREASURY N/B-4.0%-30/07/31	4,900,000.00	4,873,966.30	
		US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	5,090,000.00	4,181,949.09	
		US TREASURY N/B-4.625%-30/09/30	800,000.00	821,468.00	

		US TREASURY N/B-4.875%-30/10/31	3,000,000.00	3,120,642.00	
		US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	5,910,000.00	4,901,369.85	
		US TREASURY N/B-4.375%-30/11/30	3,000,000.00	3,040,545.00	
		US TREASURY N/B-4.0%-31/01/31	670,000.00	665,197.44	
		US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	560,000.00	600,227.60	
		US TREASURY N/B-1.125%-31/02/15	3,300,000.00	2,762,459.70	
		US TREASURY N/B-4.25%-31/02/28	1,000,000.00	1,006,484.00	
		US TREASURY N/B-4.625%-31/04/30	255,000.00	261,997.45	
		US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	6,020,000.00	5,158,857.06	
		US TREASURY N/B-4.625%-31/05/31	1,450,000.00	1,489,619.80	
		US TREASURY N/B-4.25%-31/06/30	2,420,000.00	2,434,604.70	
		US TREASURY N/B-4.125%-31/07/31	3,000,000.00	2,996,250.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	4,790,000.00	3,972,893.06	
		US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	5,830,000.00	4,845,726.93	
		US TREASURY N/B-1.875%-32/02/15	5,870,000.00	5,027,672.61	
		US TREASURY N/B-2.875%-32/05/15	4,800,000.00	4,397,904.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-32/08/15	5,100,000.00	4,617,687.90	
		US TREASURY N/B-4.125%-32/11/15	6,110,000.00	6,090,069.18	
		US TREASURY N/B-3.5%-33/02/15	2,610,000.00	2,483,629.02	
		US TREASURY N/B-3.375%-33/05/15	1,680,000.00	1,580,675.04	
		US TREASURY N/B-3.875%-33/08/15	3,330,000.00	3,247,269.48	
		US TREASURY N/B-4.5%-33/11/15	5,540,000.00	5,655,232.00	
		US TREASURY N/B-4.0%-34/02/15	2,000,000.00	1,964,686.00	
		US TREASURY N/B-4.375%-34/05/15	4,810,000.00	4,862,606.97	
		US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	823,812.00	
		US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	803,261.25	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	674,684.64	
		US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	720,000.00	733,050.00	
		US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	727,436.80	
		US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	1,428,419.65	
		US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	1,435,087.50	
		US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	746,967.75	
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	695,272.80	
		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	1,580,992.65	
		US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	2,310,909.00	
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,348,312.32	
		US TREASURY N/B-1.125%-40/08/15	3,000,000.00	1,856,484.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	988,063.81	
		US TREASURY N/B-1.375%-40/11/15	3,100,000.00	1,989,325.80	
		US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	1,553,788.50	
		US TREASURY N/B-1.875%-41/02/15	4,200,000.00	2,918,013.00	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	862,523.22	
		US TREASURY N/B-2.25%-41/05/15	4,900,000.00	3,603,219.90	

		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	878,174.40	
		US TREASURY N/B-1.75%-41/08/15	3,190,000.00	2,141,348.11	
		US TREASURY N/B-2.0%-41/11/15	3,000,000.00	2,089,218.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	416,660.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	623,749.60	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	1,551,250.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	1,765,000.00	1,448,126.02	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	1,611,010.95	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	1,950,000.00	1,712,495.85	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	1,865,732.55	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	1,080,000.00	944,535.60	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,000,000.00	1,683,046.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	1,700,000.00	1,370,092.90	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	1,900,000.00	1,497,287.40	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	2,120,000.00	1,527,226.80	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	1,400,000.00	1,098,889.40	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	1,390,000.00	1,065,900.65	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	1,190,000.00	930,848.94	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	1,300,000.00	925,334.80	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	900,000.00	638,366.40	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	1,650,000.00	1,110,397.20	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	540,000.00	408,859.92	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	1,720,000.00	1,329,102.48	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	1,530,000.00	1,180,339.92	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	1,700,000.00	1,248,933.90	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,740,000.00	1,276,622.34	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	2,109,013.50	
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	1,880,529.60	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	3,134,175.30	
		US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	2,411,335.90	
		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	2,513,798.10	
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	2,228,436.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,250,000.00	1,462,146.75	
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	2,068,763.30	
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	2,260,248.60	
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	2,450,000.00	1,224,233.15	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,920,000.00	1,502,316.64	
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	3,000,000.00	1,649,880.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	4,750,000.00	2,786,540.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	4,100,000.00	2,714,007.30	
		US TREASURY N/B-2.0%-51/08/15	2,000,000.00	1,205,390.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/11/15	1,400,000.00	815,199.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-52/02/15	2,000,000.00	1,278,476.00	

		US TREASURY N/B-2.875%-52/05/15	600,000.00	441,550.20	
		US TREASURY N/B-3.0%-52/08/15	1,100,000.00	830,865.20	
		US TREASURY N/B-4.0%-52/11/15	1,500,000.00	1,372,821.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-53/02/15	2,900,000.00	2,479,839.30	
		US TREASURY N/B-3.625%-53/05/15	2,150,000.00	1,839,172.35	
		US TREASURY N/B-4.125%-53/08/15	1,500,000.00	1,404,375.00	
		US TREASURY N/B-4.75%-53/11/15	1,500,000.00	1,558,387.50	
		US TREASURY N/B-4.25%-54/02/15	1,000,000.00	957,500.00	
		US TREASURY N/B-4.625%-54/05/15	1,500,000.00	1,529,296.50	
米ドル小計			561,425,000.00	507,070,702.18 (77,809,999,249)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-25/10/01	430,000.00	428,843.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-25/11/01	540,000.00	546,604.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-26/02/01	620,000.00	629,827.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	995,000.00	957,229.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-26/04/01	700,000.00	698,341.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-26/05/01	870,000.00	880,266.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	670,000.00	653,765.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-26/08/01	460,000.00	466,637.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-26/09/01	990,000.00	953,617.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-26/11/01	220,000.00	220,701.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	520,000.00	499,314.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	650,000.00	618,884.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-27/09/01	620,000.00	615,523.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-28/03/01	580,000.00	589,222.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	697,000.00	674,256.89	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-28/09/01	930,000.00	938,295.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-29/03/01	1,000,000.00	1,039,930.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	410,000.00	458,851.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	364,000.00	353,476.76	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-29/09/01	940,000.00	959,956.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/12/01	120,000.00	115,729.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	1,748,000.00	1,585,523.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-30/12/01	1,205,000.00	1,033,408.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	1,746,000.00	1,577,528.46	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/12/01	1,520,000.00	1,360,749.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-32/06/01	1,070,000.00	985,245.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-32/12/01	890,000.00	845,900.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	710,000.00	842,443.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-33/06/01	500,000.00	482,760.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-33/12/01	800,000.00	800,936.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-34/03/01	145,000.00	148,023.25	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-34/06/01	650,000.00	636,415.00	

		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	290,000.00	339,836.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	460,000.00	497,973.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	520,000.00	529,256.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	610,000.00	545,645.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	2,073,000.00	1,559,248.41	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-53/12/01	1,241,000.00	866,230.41	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-55/12/01	600,000.00	526,422.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	285,000.00	249,782.55	
加ドル小計			30,389,000.00	28,712,601.73 (3,172,168,239)	
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	23,150,000.00	21,855,046.87	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.0%-26/09/03	5,200,000.00	4,922,125.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	15,550,000.00	14,131,062.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	20,500,000.00	19,385,312.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/03/01	4,900,000.00	4,639,687.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	14,120,000.00	13,365,462.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	19,900,000.00	17,822,937.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-33/05/26	12,800,000.00	10,920,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	6,000,000.00	5,118,750.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	4,400,000.00	4,372,500.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	11,170,000.00	9,770,259.37	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	14,100,000.00	11,090,531.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	13,570,000.00	10,754,225.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-53/07/31	12,200,000.00	9,550,312.49	
メキシコペソ小計			177,560,000.00	157,698,212.48 (1,212,651,944)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	270,000.00	112,106.70	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	505,000.00	520,294.43	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	742,000.00	727,016.05	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	780,000.00	751,284.30	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	375,000.00	350,602.50	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	880,000.00	970,286.24	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	795,000.00	753,313.38	
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	840,000.00	784,539.00	
		BELGIUM KINGDOM-2.7%-29/10/22	152,000.00	153,751.64	
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	730,000.00	639,101.13	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	855,000.00	773,309.88	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-31/10/22	610,000.00	508,836.38	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	475,000.00	516,882.65	
		BELGIUM KINGDOM-0.35%-32/06/22	675,000.00	566,290.57	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	525,000.00	468,362.47	

		BELGIUM KINGDOM-3.0%-33/06/22	476,000.00	484,895.48	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	543,000.00	551,273.69	
		BELGIUM KINGDOM-2.85%-34/10/22	240,000.00	239,470.80	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	974,000.00	1,154,421.81	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	340,000.00	283,214.22	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	415,000.00	359,250.14	
		BELGIUM KINGDOM-2.75%-39/04/22	160,000.00	152,684.96	
		BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	345,000.00	226,255.48	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	992,000.00	1,117,604.06	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	435,000.00	460,453.15	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	493,000.00	355,577.23	
		BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	461,000.00	326,059.30	
		BELGIUM KINGDOM-1.4%-53/06/22	485,000.00	304,359.32	
		BELGIUM KINGDOM-3.3%-54/06/22	433,000.00	415,936.33	
		BELGIUM KINGDOM-3.5%-55/06/22	235,000.00	233,515.97	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	412,000.00	313,404.28	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	446,000.00	326,211.98	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-71/10/31	345,000.00	176,410.92	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%-25/10/31	1,455,000.00	1,449,831.84	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-26/01/31	1,045,000.00	1,013,848.55	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-26/04/30	1,055,000.00	1,048,741.74	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.8%-26/05/31	485,000.00	487,949.77	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	1,360,000.00	1,441,772.72	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%-26/10/31	1,640,000.00	1,607,749.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-27/01/31	755,000.00	716,220.93	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%-27/04/30	1,275,000.00	1,249,055.02	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.5%-27/05/31	120,000.00	120,300.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%-27/07/30	860,000.00	824,328.06	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-27/10/31	1,170,000.00	1,138,851.09	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-28/01/31	1,125,000.00	1,040,827.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/04/30	1,270,000.00	1,227,754.72	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/07/30	1,275,000.00	1,229,216.02	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-28/10/31	1,020,000.00	1,124,148.12	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	1,355,000.00	1,548,494.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-29/04/30	1,025,000.00	980,501.67	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.5%-	430,000.00	448,175.24	

		29/05/31			
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%-29/07/30	1,035,000.00	956,081.25	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%-29/10/31	1,210,000.00	1,101,844.15	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-30/04/30	1,205,000.00	1,079,435.38	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-30/07/30	1,180,000.00	1,141,172.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%-30/10/31	1,230,000.00	1,137,934.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%-31/04/30	1,175,000.00	998,932.12	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-31/10/31	1,090,000.00	940,024.72	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.7%-32/04/30	1,270,000.00	1,097,633.06	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	1,050,000.00	1,268,967.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.55%-32/10/31	985,000.00	969,191.73	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-33/04/30	1,082,000.00	1,107,773.24	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%-33/07/30	1,165,000.00	1,121,080.66	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.55%-33/10/31	1,030,000.00	1,083,538.36	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.25%-34/04/30	738,000.00	756,991.69	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-34/10/31	252,000.00	262,132.92	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%-35/07/30	995,000.00	888,649.42	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	995,000.00	1,100,917.75	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.85%-37/07/30	670,000.00	505,350.85	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.9%-39/07/30	340,000.00	361,672.96	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	945,000.00	1,118,209.05	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%-40/10/31	1,000,000.00	730,753.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	1,265,000.00	1,471,856.59	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-42/07/30	390,000.00	265,306.47	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-43/07/30	300,000.00	297,093.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	710,000.00	876,908.93	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	980,000.00	886,870.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	785,000.00	676,294.77	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-50/10/31	1,170,000.00	665,719.47	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.9%-52/10/31	743,000.00	518,166.71	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-54/10/31	400,000.00	420,006.80	

		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	798,000.00	750,047.38	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-25/10/10	1,650,000.00	1,614,386.40	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-26/04/10	1,600,000.00	1,551,579.20	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-26/10/09	800,000.00	768,886.40	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-27/04/16	1,050,000.00	999,374.25	
		BUNDESOBLIGATION-1.3%-27/10/15	1,130,000.00	1,107,729.96	
		BUNDESOBLIGATION-2.2%-28/04/13	750,000.00	754,352.25	
		BUNDESOBLIGATION-2.4%-28/10/19	685,000.00	694,105.70	
		BUNDESOBLIGATION-2.1%-29/04/12	297,000.00	297,231.66	
		BUNDESOBLIGATION-2.1%-29/04/12	500,000.00	500,500.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	1,820,000.00	1,781,028.34	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-26/08/15	1,910,000.00	1,841,121.58	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	1,315,000.00	1,264,005.61	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	910,000.00	1,014,554.45	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15	1,120,000.00	1,075,740.96	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-27/11/15	1,095,000.00	1,030,823.14	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	650,000.00	721,818.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-28/02/15	1,690,000.00	1,612,251.55	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	970,000.00	1,063,274.23	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-28/08/15	1,090,000.00	1,022,543.17	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-28/11/15	1,180,000.00	1,089,923.52	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-29/02/15	1,705,000.00	1,584,674.74	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-29/08/15	1,760,000.00	1,598,835.04	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.1%-29/11/15	620,000.00	620,012.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	660,000.00	792,646.14	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/02/15	1,290,000.00	1,159,068.87	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/08/15	1,800,000.00	1,600,979.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/08/15	740,000.00	658,376.52	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.4%-30/11/15	450,000.00	456,741.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	1,180,000.00	1,408,180.14	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/02/15	1,310,000.00	1,151,796.54	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/08/15	1,565,000.00	1,360,069.51	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/08/15	160,000.00	139,080.96	

		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-32/02/15	1,323,000.00	1,135,221.31	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.7%-32/08/15	1,390,000.00	1,346,221.95	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.3%-33/02/15	1,770,000.00	1,784,997.21	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.3%-33/02/15	170,000.00	171,487.84	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.6%-33/08/15	1,310,000.00	1,349,888.19	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.2%-34/02/15	1,080,000.00	1,075,831.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	1,300,000.00	1,577,855.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.6%-34/08/15	155,000.00	159,301.25	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-35/05/15	920,000.00	721,520.12	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-36/05/15	1,000,000.00	761,198.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	1,740,000.00	2,026,821.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-38/05/15	115,000.00	95,523.48	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	1,135,000.00	1,373,079.87	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	1,165,000.00	1,494,647.23	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.6%-41/05/15	125,000.00	125,537.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	955,000.00	1,046,762.13	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-44/07/04	1,635,000.00	1,613,720.47	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-46/08/15	1,587,000.00	1,566,991.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%-48/08/15	1,940,000.00	1,487,987.76	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	1,630,000.00	849,994.47	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	640,000.00	334,312.32	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-52/08/15	900,000.00	446,518.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%-53/08/15	1,040,000.00	876,525.52	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%-53/08/15	500,000.00	422,037.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-54/08/15	425,000.00	417,432.87	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-3.1%-25/12/12	420,000.00	423,493.98	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.5%-26/03/19	280,000.00	281,021.16	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.9%-26/06/18	560,000.00	566,347.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-72/03/01	220,000.00	138,869.06	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-25/11/15	1,100,000.00	1,099,778.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-25/12/01	1,085,000.00	1,079,065.05	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-26/01/15	810,000.00	818,561.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.2%-26/01/28	215,000.00	216,538.75	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%-26/02/01	850,000.00	828,469.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-26/03/01	1,130,000.00	1,158,655.67	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-26/04/01	1,020,000.00	984,258.18	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%-26/04/15	950,000.00	966,681.05	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%-26/06/01	970,000.00	956,929.25	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%-26/07/15	950,000.00	944,338.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-26/08/01	375,000.00	359,263.12	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-26/09/15	540,000.00	553,025.34	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	720,000.00	787,626.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%-26/12/01	1,080,000.00	1,053,859.68	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%-27/01/15	1,005,000.00	970,160.67	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%-27/02/15	90,000.00	90,808.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.1%-27/04/01	410,000.00	396,680.33	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%-27/06/01	1,160,000.00	1,152,047.04	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%-27/07/15	85,000.00	86,953.64	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%-27/08/01	995,000.00	983,292.83	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-27/09/15	775,000.00	741,462.65	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	1,440,000.00	1,605,047.04	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.65%-27/12/01	950,000.00	952,865.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-28/02/01	865,000.00	850,295.86	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%-28/03/15	840,000.00	776,726.16	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.4%-28/04/01	150,000.00	153,771.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%-28/07/15	1,050,000.00	971,863.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%-28/08/01	650,000.00	675,916.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-28/09/01	1,330,000.00	1,431,054.73	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-28/12/01	1,030,000.00	1,036,002.84	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.1%-29/02/01	735,000.00	774,711.31	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%-29/02/15	605,000.00	550,246.89	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-	305,000.00	305,355.93	

		29/06/15			
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%-29/07/01	75,000.00	76,773.67	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-29/08/01	1,945,000.00	1,965,871.79	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	1,750,000.00	1,952,987.75	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-29/12/15	535,000.00	560,219.36	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-30/03/01	1,500,000.00	1,550,491.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%-30/04/01	955,000.00	882,696.95	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.7%-30/06/15	540,000.00	560,893.68	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-30/08/01	827,000.00	740,838.17	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-30/11/15	585,000.00	617,276.79	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-30/12/01	1,287,000.00	1,192,624.29	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-31/02/15	295,000.00	302,841.39	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%-31/04/01	1,295,000.00	1,136,543.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	1,515,000.00	1,785,898.66	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%-31/08/01	1,120,000.00	954,914.24	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-31/10/30	290,000.00	307,874.15	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-31/12/01	1,010,000.00	874,718.58	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-32/03/01	1,250,000.00	1,133,588.75	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-32/06/01	990,000.00	845,985.69	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-32/12/01	600,000.00	571,620.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	1,125,000.00	1,329,316.87	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.4%-33/05/01	865,000.00	940,471.25	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-33/09/01	1,195,000.00	1,123,733.78	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.35%-33/11/01	700,000.00	757,582.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.2%-34/03/01	755,000.00	806,777.14	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-34/07/01	390,000.00	404,774.76	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	1,460,000.00	1,657,403.68	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-35/02/01	130,000.00	134,281.55	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%-35/03/01	780,000.00	775,011.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-35/04/30	400,000.00	421,024.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-	770,000.00	622,248.55	

		36/03/01			
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%-36/09/01	965,000.00	845,152.79	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	1,825,000.00	1,908,988.32	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-37/03/01	400,000.00	295,451.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.05%-37/10/30	290,000.00	302,355.16	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-38/03/01	200,000.00	190,510.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%-38/09/01	785,000.00	721,101.78	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	1,200,000.00	1,362,916.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.15%-39/10/01	350,000.00	363,315.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%-40/03/01	810,000.00	743,507.91	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	1,070,000.00	1,214,088.34	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%-41/03/01	730,000.00	549,620.65	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.45%-43/09/01	610,000.00	648,917.39	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01	935,000.00	1,038,077.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-45/04/30	440,000.00	293,409.16	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-46/09/01	820,000.00	737,011.08	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%-47/03/01	715,000.00	584,793.49	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%-48/03/01	915,000.00	841,929.01	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-49/09/01	650,000.00	633,473.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-50/09/01	870,000.00	657,594.72	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%-51/09/01	640,000.00	407,296.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-52/09/01	280,000.00	194,120.64	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-53/10/01	735,000.00	783,620.25	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.3%-54/10/01	245,000.00	250,413.76	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	500,000.00	382,070.00	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	245,000.00	238,852.21	
		FINNISH GOVERNMENT-0.0%-26/09/15	180,000.00	172,662.84	
		FINNISH GOVERNMENT-1.375%-27/04/15	170,000.00	166,538.97	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	315,000.00	300,183.34	
		FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	330,000.00	335,511.00	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	251,869.77	
		FINNISH GOVERNMENT-2.875%-29/04/15	270,000.00	275,492.60	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	375,000.00	342,165.75	

		FINNISH GOVERNMENT-2.5%-30/04/15	87,000.00	87,198.26	
		FINNISH GOVERNMENT-0.0%-30/09/15	292,000.00	252,723.37	
		FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	365,000.00	326,682.66	
		FINNISH GOVERNMENT-0.125%-31/09/15	200,000.00	169,692.60	
		FINNISH GOVERNMENT-1.5%-32/09/15	230,000.00	211,628.75	
		FINNISH GOVERNMENT-3.0%-33/09/15	110,000.00	112,580.93	
		FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	325,000.00	281,847.47	
		FINNISH GOVERNMENT-3.0%-34/09/15	140,000.00	142,853.48	
		FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	278,000.00	203,798.46	
		FINNISH GOVERNMENT-2.75%-38/04/15	210,000.00	204,851.01	
		FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15	145,000.00	94,822.89	
		FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	252,000.00	238,373.10	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-43/04/15	235,000.00	151,210.51	
		FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	190,422.18	
		FINNISH GOVERNMENT-0.125%-52/04/15	230,000.00	107,829.75	
		FINNISH GOVERNMENT-2.95%-55/04/15	133,000.00	128,992.31	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	515,000.00	184,749.04	
		FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	1,350,000.00	1,396,180.80	
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	2,000,000.00	1,970,622.00	
		FRANCE (GOVT OF)-0.0%-26/02/25	1,640,000.00	1,590,945.96	
		FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	1,970,000.00	2,003,909.61	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,450,000.00	2,382,651.95	
		FRANCE (GOVT OF)-2.5%-26/09/24	1,360,000.00	1,364,114.00	
		FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,520,000.00	2,415,462.84	
		FRANCE (GOVT OF)-0.0%-27/02/25	2,005,000.00	1,899,933.99	
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	1,775,000.00	1,715,718.55	
		FRANCE (GOVT OF)-2.5%-27/09/24	180,000.00	180,478.80	
		FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,020,000.00	3,050,272.48	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/02/25	1,275,000.00	1,206,750.52	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	3,450,000.00	3,249,827.55	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	2,930,000.00	2,731,987.67	
		FRANCE (GOVT OF)-2.75%-29/02/25	305,000.00	307,365.58	
		FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	2,105,000.00	2,363,218.24	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	2,980,000.00	2,718,034.16	
		FRANCE (GOVT OF)-0.0%-29/11/25	2,510,000.00	2,205,082.69	
		FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	2,935,000.00	2,916,444.93	
		FRANCE (GOVT OF)-0.0%-30/11/25	2,839,000.00	2,420,224.78	
		FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	2,940,000.00	2,731,430.52	
		FRANCE (GOVT OF)-0.0%-31/11/25	2,605,000.00	2,149,242.22	
		FRANCE (GOVT OF)-0.0%-32/05/25	1,833,000.00	1,487,607.81	
		FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	1,655,000.00	1,995,961.44	
		FRANCE (GOVT OF)-2.0%-32/11/25	2,075,000.00	1,948,134.50	
		FRANCE (GOVT OF)-3.0%-33/05/25	1,385,000.00	1,395,330.71	

FRANCE (GOVT OF)-3.5%-33/11/25	2,013,000.00	2,101,036.54	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	2,385,000.00	2,046,155.89	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	1,425,000.00	1,643,188.87	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	2,395,000.00	1,963,756.30	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-38/05/25	290,000.00	226,646.31	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	1,500,000.00	1,627,767.00	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	1,890,000.00	1,563,597.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	2,780,000.00	3,186,233.06	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-43/05/25	165,000.00	144,112.15	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-44/06/25	1,050,000.00	618,613.80	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	1,230,000.00	1,196,150.40	
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	1,380,000.00	1,053,004.86	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-49/06/25	348,000.00	320,246.30	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-50/05/25	1,840,000.00	1,219,244.72	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-52/05/25	1,500,000.00	775,345.50	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-53/05/25	1,320,000.00	664,696.56	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-54/05/25	850,000.00	757,078.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,130,000.00	1,210,321.53	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-55/05/25	400,000.00	372,364.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	970,000.00	1,045,577.55	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	945,000.00	591,008.67	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	505,000.00	495,804.96	
IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15	327,000.00	311,611.70	
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	355,000.00	339,883.03	
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	463,000.00	439,757.40	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	424,000.00	425,509.86	
IRISH TREASURY-0.2%-30/10/18	282,000.00	248,618.81	
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	335,000.00	314,653.77	
IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	405,000.00	342,693.18	
IRISH TREASURY-0.35%-32/10/18	205,000.00	173,914.00	
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	238,000.00	216,075.67	
IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	250,000.00	198,121.50	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	365,000.00	323,896.62	
IRISH TREASURY-0.55%-41/04/22	185,000.00	129,709.05	
IRISH TREASURY-3.0%-43/10/18	170,000.00	172,885.92	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	475,000.00	408,504.27	
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	411,000.00	307,537.73	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-26/01/15	455,000.00	442,769.14	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	760,000.00	739,142.56	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	635,000.00	606,270.06	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	760,000.00	732,440.12	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	550,000.00	606,307.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	841,000.00	798,335.22	

		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	590,000.00	537,854.03	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	595,000.00	542,528.14	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-30/01/15	395,000.00	398,931.04	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-30/07/15	670,000.00	588,223.82	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-31/07/15	650,000.00	556,041.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-32/07/15	560,000.00	485,544.64	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	697,000.00	699,890.45	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/07/15	465,000.00	465,345.03	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-34/07/15	290,000.00	288,780.84	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	905,000.00	1,028,571.41	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-38/01/15	395,000.00	276,262.21	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	763,000.00	552,307.46	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	902,000.00	1,020,601.27	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-44/01/15	220,000.00	235,117.74	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	874,000.00	871,880.55	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	907,000.00	438,294.14	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-54/01/15	539,000.00	456,727.04	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.7%-71/04/20	180,000.00	82,242.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	173,000.00	104,854.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	343,000.00	262,481.77	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.85%-99/99/99	192,000.00	85,470.72	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	570,000.00	563,615.43	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	550,000.00	569,191.15	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.0%-26/07/15	170,000.00	169,333.94	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	773,000.00	751,572.44	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	656,991.72	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	487,000.00	538,174.44	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	660,000.00	627,927.96	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-28/10/20	382,000.00	348,508.15	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	715,000.00	661,111.88	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-29/05/23	225,000.00	229,927.27	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	680,000.00	597,594.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.45%-30/10/20	155,000.00	162,940.65	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-31/02/20	745,000.00	635,648.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.9%-32/02/20	610,000.00	541,096.84	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-33/02/20	715,000.00	726,310.58	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-34/02/20	30,000.00	30,367.23	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	455,000.00	442,356.46	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-36/10/20	270,000.00	198,267.21	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	650,000.00	732,810.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-39/07/15	128,000.00	130,961.53	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	255,000.00	158,814.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	394,000.00	399,296.54	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	503,000.00	377,554.81	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.85%-49/05/23	288,000.00	228,337.05	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	455,000.00	267,146.88	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-53/10/20	206,000.00	206,492.34	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	180,000.00	207,553.50	
ユーロ小計			318,100,000.00	301,796,380.56 (49,992,570,439)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	760,000.00	342,570.00	
		UK TREASURY-1.125%-73/10/22	513,000.00	186,205.66	
		UK TREASURY-3.5%-25/10/22	1,490,000.00	1,477,324.57	
		UK TREASURY-0.125%-26/01/30	710,000.00	679,480.65	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	820,000.00	786,650.60	
		UK TREASURY-0.375%-26/10/22	1,260,000.00	1,176,677.46	
		UK TREASURY-4.125%-27/01/29	1,495,000.00	1,494,402.00	
		UK TREASURY-3.75%-27/03/07	1,198,000.00	1,187,737.93	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	755,000.00	704,171.89	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	850,000.00	857,876.10	
		UK TREASURY-0.125%-28/01/31	745,000.00	662,334.05	
		UK TREASURY-4.5%-28/06/07	1,385,000.00	1,404,514.65	
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	720,000.00	660,978.00	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	710,000.00	765,424.02	
		UK TREASURY-0.5%-29/01/31	1,180,000.00	1,023,563.86	
		UK TREASURY-4.125%-29/07/22	850,000.00	851,530.00	
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	736,000.00	636,727.58	
		UK TREASURY-0.375%-30/10/22	870,000.00	707,477.04	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	945,000.00	983,556.00	
		UK TREASURY-0.25%-31/07/31	1,045,000.00	816,667.50	
		UK TREASURY-4.0%-31/10/22	275,000.00	273,172.62	
		UK TREASURY-1.0%-32/01/31	1,645,000.00	1,332,790.51	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,030,000.00	1,043,570.25	
		UK TREASURY-3.25%-33/01/31	1,490,000.00	1,398,433.54	
		UK TREASURY-0.875%-33/07/31	1,270,000.00	967,686.66	
		UK TREASURY-4.625%-34/01/31	1,123,000.00	1,159,379.58	
		UK TREASURY-4.25%-34/07/31	345,000.00	345,905.97	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	789,000.00	808,356.53	
		UK TREASURY-0.625%-35/07/31	967,000.00	667,999.73	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	970,000.00	966,019.12	
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,220,000.00	909,655.18	
		UK TREASURY-3.75%-38/01/29	710,000.00	664,573.49	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	985,000.00	1,017,873.39	
		UK TREASURY-1.125%-39/01/31	747,000.00	488,850.99	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	850,000.00	828,623.35	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	815,000.00	788,398.40	

		UK TREASURY-1.25%-41/10/22	1,280,000.00	787,161.60	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,040,000.00	1,027,000.00	
		UK TREASURY-4.75%-43/10/22	260,000.00	263,469.70	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,115,000.00	917,873.57	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	980,000.00	830,868.50	
		UK TREASURY-0.875%-46/01/31	435,000.00	215,507.70	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	720,000.00	676,481.76	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,005,000.00	563,101.50	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	675,000.00	391,556.02	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	895,000.00	836,388.24	
		UK TREASURY-0.625%-50/10/22	770,000.00	308,940.94	
		UK TREASURY-1.25%-51/07/31	600,000.00	288,824.40	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	872,000.00	744,679.28	
		UK TREASURY-1.5%-53/07/31	580,000.00	290,671.64	
		UK TREASURY-3.75%-53/10/22	1,170,000.00	993,876.39	
		UK TREASURY-4.375%-54/07/31	270,000.00	255,317.13	
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	925,000.00	475,270.55	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	962,000.00	893,260.29	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	559,086.00	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	751,000.00	667,038.20	
		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	1,050,000.00	314,119.05	
		UK TREASURY-4.0%-63/10/22	440,000.00	389,145.68	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	830,000.00	662,076.89	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	742,000.00	458,524.83	
英ポンド小計			53,710,000.00	44,877,398.73 (8,927,012,155)	
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	3,680,000.00	3,624,855.20	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,300,000.00	3,182,998.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	3,180,000.00	3,009,758.70	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	2,700,000.00	2,400,529.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,800,000.00	1,832,652.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.75%-33/11/11	1,730,000.00	1,686,464.55	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	2,220,000.00	2,552,877.90	
スウェーデンクローナ小計			18,610,000.00	18,290,136.35 (264,109,568)	
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,400,000.00	2,328,902.40	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,200,000.00	2,110,130.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	1,820,000.00	1,728,526.80	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	1,930,000.00	1,776,910.47	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	2,685,000.00	2,380,521.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.25%-31/09/17	2,040,000.00	1,752,972.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.125%-32/05/18	2,030,000.00	1,833,496.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-33/08/15	2,350,000.00	2,236,713.55	

		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.625%-34/04/13	1,100,000.00	1,095,094.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.5%-42/10/06	990,000.00	966,721.14	
ノルウェークローネ小計			19,545,000.00	18,209,987.36 (254,029,323)	
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	3,125,000.00	3,117,112.50	
		KINGDOM OF DENMARK-2.25%-26/11/15	950,000.00	957,704.50	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	2,380,000.00	2,287,658.38	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	2,290,000.00	2,136,792.13	
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-31/11/15	1,350,000.00	1,176,508.80	
		KINGDOM OF DENMARK-2.25%-33/11/15	700,000.00	708,082.90	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	6,705,000.00	8,485,358.53	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	1,750,000.00	992,517.75	
デンマーククローネ小計			19,250,000.00	19,861,735.49 (440,930,527)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-25/10/25	400,000.00	384,920.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-26/04/25	670,000.00	625,981.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,190,000.00	2,105,137.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,600,000.00	1,461,072.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	1,310,000.00	1,269,769.90	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,140,000.00	2,002,333.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,160,000.00	1,995,256.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-7.5%-28/07/25	1,720,000.00	1,847,761.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	2,075,000.00	2,103,022.87	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-29/07/25	1,060,000.00	1,028,730.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	2,565,000.00	2,271,923.10	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	2,025,000.00	1,594,606.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-32/04/25	1,890,000.00	1,452,729.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.0%-33/10/25	2,145,000.00	2,184,789.75	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-34/10/25	580,000.00	546,162.80	
ポーランドズロチ小計			24,530,000.00	22,874,197.22 (871,966,685)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	855,000.00	821,107.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	900,000.00	903,654.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,090,000.00	1,022,245.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	980,000.00	999,257.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	830,000.00	802,527.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	795,000.00	751,394.25	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	765,000.00	731,493.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	960,000.00	932,131.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	890,000.00	839,127.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,005,000.00	927,444.15	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	930,000.00	773,536.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,083,000.00	916,033.89	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,385,000.00	1,114,357.15	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,250,000.00	1,007,900.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	1,195,000.00	988,217.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,130,000.00	1,143,887.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-33/11/21	1,010,000.00	907,586.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-34/05/21	960,000.00	913,056.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-34/06/21	200,000.00	197,846.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.5%-34/12/21	855,000.00	791,815.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	700,000.00	600,460.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-35/12/21	260,000.00	255,530.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	550,000.00	510,691.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	522,000.00	447,171.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	710,000.00	551,705.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	675,000.00	504,643.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	870,000.00	464,031.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-54/06/21	325,000.00	318,006.00	
豪ドル小計			23,680,000.00	21,136,858.14 (2,142,220,572)	
ニュージーランドドル	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.5%-26/05/15	335,000.00	318,723.35	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-27/04/15	700,000.00	712,379.50	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.25%-28/05/15	370,000.00	326,571.25	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.0%-29/04/20	680,000.00	654,171.56	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-30/05/15	430,000.00	439,394.64	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.5%-31/05/15	350,000.00	296,693.60	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.0%-32/05/15	225,000.00	192,164.40	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.5%-33/04/14	430,000.00	403,931.25	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.25%-34/05/15	220,000.00	217,064.10	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-35/05/15	280,000.00	279,793.08	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-37/04/15	430,000.00	353,427.32	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.75%-41/05/15	225,000.00	146,899.80	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-51/05/15	500,000.00	339,832.50	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-5.0%-54/05/15	170,000.00	171,368.67	
ニュージーランドドル小計			5,345,000.00	4,852,415.02 (444,917,933)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-72/08/01	219,000.00	235,972.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-25/11/01	314,000.00	307,217.60	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	420,000.00	416,346.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-26/11/01	365,000.00	354,812.85	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	498,000.00	506,964.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-27/09/01	150,000.00	150,855.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	347,000.00	346,479.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-28/08/01	100,000.00	100,670.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-29/04/01	131,000.00	132,729.20	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	365,000.00	367,381.62	

		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	440,000.00	443,300.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-31/07/01	300,000.00	279,090.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-32/08/01	170,000.00	167,841.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	335,000.00	349,472.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	391,000.00	368,126.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	206,000.00	193,675.02	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	280,000.00	275,520.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	387,000.00	381,599.41	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	342,000.00	284,886.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-51/10/01	222,000.00	184,038.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-54/06/01	97,000.00	106,827.55	
シンガポールドル小計			6,079,000.00	5,953,803.75 (690,224,468)	
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	830,000.00	837,179.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	920,000.00	929,200.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,200,000.00	1,213,440.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.519%-28/04/20	350,000.00	349,440.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.504%-29/04/30	350,000.00	362,547.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,320,000.00	1,334,520.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	985,000.00	917,527.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.582%-32/07/15	100,000.00	98,347.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	738,885.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,000,000.00	996,510.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	760,000.00	780,900.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,320,000.00	1,418,722.80	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	1,080,000.00	1,178,550.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	1,490,000.00	1,440,755.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.696%-42/10/15	750,000.00	810,750.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	660,000.00	732,797.34	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	620,000.00	670,940.44	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	510,000.00	565,707.30	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	1,410,000.00	1,382,857.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.457%-53/03/31	760,000.00	788,880.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	650,000.00	659,816.95	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	950,190.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,410,000.00	1,416,909.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,150,000.00	1,194,502.70	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,058,443.78	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	1,010,000.00	1,006,629.63	
マレーシアリンギット小計			23,320,000.00	23,834,949.44 (839,335,827)	
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	32,000,000.00	32,505,942.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-25/11/25	20,000,000.00	20,167,257.00	

		CHINA GOVERNMENT BOND-3.22%-25/12/06	18,800,000.00	19,183,275.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.46%-26/02/15	10,900,000.00	11,029,126.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	17,000,000.00	17,364,888.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.3%-26/05/15	16,000,000.00	16,192,173.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-26/06/06	11,000,000.00	11,311,157.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	16,000,000.00	16,324,552.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-26/08/15	32,000,000.00	32,367,870.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.39%-26/11/15	6,000,000.00	6,093,544.20	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-26/12/05	23,000,000.00	23,752,008.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-27/01/20	10,000,000.00	10,167,001.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.04%-27/02/25	14,000,000.00	14,135,965.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.85%-27/05/15	11,000,000.00	11,063,550.85	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	24,000,000.00	24,740,472.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	16,000,000.00	16,364,000.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.62%-27/08/15	4,100,000.00	4,099,913.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.44%-27/10/15	9,100,000.00	9,300,960.76	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.28%-27/12/03	19,500,000.00	20,498,819.25	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.64%-28/01/15	10,000,000.00	10,278,740.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-28/04/15	11,000,000.00	11,307,040.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	13,000,000.00	13,576,550.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.4%-28/07/15	10,900,000.00	11,127,530.41	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.48%-28/09/25	3,000,000.00	3,072,804.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	22,000,000.00	22,927,388.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.55%-28/10/15	10,000,000.00	10,282,496.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-28/11/22	10,000,000.00	10,618,905.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-29/01/15	7,500,000.00	7,662,620.25	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-29/03/24	15,000,000.00	15,604,365.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.05%-29/04/15	10,000,000.00	10,090,866.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-29/05/23	14,000,000.00	14,966,728.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-29/06/15	5,200,000.00	5,404,373.52	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.91%-29/07/15	9,500,000.00	9,529,061.92	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-29/09/25	20,200,000.00	20,913,605.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.13%-29/11/21	2,700,000.00	2,872,654.20	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.79%-29/12/15	5,000,000.00	5,223,557.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-30/03/25	15,000,000.00	15,679,513.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	17,900,000.00	18,618,300.15	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-30/06/25	9,800,000.00	10,149,284.74	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-30/09/15	24,100,000.00	24,931,196.95	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	11,000,000.00	11,887,029.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.54%-30/12/25	8,400,000.00	8,665,023.36	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-31/03/25	13,000,000.00	13,192,661.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	10,000,000.00	10,648,246.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.12%-31/06/25	16,000,000.00	16,087,166.40	

		CHINA GOVERNMENT BOND-2.89%-31/11/18	8,000,000.00	8,439,378.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	10,000,000.00	10,448,229.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.76%-32/05/15	9,000,000.00	9,414,759.15	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-32/08/15	9,000,000.00	9,366,276.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-32/09/01	7,400,000.00	7,658,948.20	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-32/11/15	6,000,000.00	6,300,408.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-33/02/25	11,000,000.00	11,661,684.65	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/05/25	12,000,000.00	12,479,052.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.52%-33/08/25	12,800,000.00	13,167,249.28	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/11/25	19,700,000.00	20,512,281.23	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.35%-34/02/25	15,000,000.00	15,238,292.25	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.27%-34/05/25	13,000,000.00	13,148,346.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.11%-34/08/25	11,000,000.00	10,961,395.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	21,000,000.00	26,825,463.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	10,000,000.00	12,641,000.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.53%-51/10/18	10,000,000.00	12,303,370.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.32%-52/04/15	10,000,000.00	11,932,170.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-52/10/25	8,000,000.00	9,227,228.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-53/04/15	9,000,000.00	10,541,983.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.0%-53/10/15	9,900,000.00	11,291,998.90	
中国元小計			836,400,000.00	875,539,703.22 (18,856,848,804)	
イスラエルシュケル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-0.5%-26/02/27	1,080,000.00	1,024,556.22	
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	950,000.00	980,626.56	
		ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,270,000.00	1,195,317.68	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-27/09/30	670,000.00	653,829.89	
		ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,160,000.00	1,060,278.47	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-29/02/28	1,110,000.00	1,068,834.12	
		ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	1,645,000.00	1,355,023.03	
		ISRAEL FIXED BOND-1.3%-32/04/30	1,360,000.00	1,060,530.15	
		ISRAEL FIXED BOND-4.0%-35/03/30	380,000.00	350,473.74	
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	1,150,000.00	769,503.61	
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,160,000.00	1,195,509.36	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,300,000.00	1,028,515.64	
		ISRAEL FIXED BOND-2.8%-52/11/29	640,000.00	398,957.94	
イスラエルシュケル小計			13,875,000.00	12,141,956.41 (491,234,415)	
合計				166,410,220,148 (166,410,220,148)	

(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	219銘柄	100.0%	46.7%
加ドル	国債証券	40銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券	14銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券	372銘柄	100.0%	30.0%
英ポンド	国債証券	60銘柄	100.0%	5.4%
スウェーデンクローナ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券	10銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券	28銘柄	100.0%	1.3%
ニュージーランドドル	国債証券	14銘柄	100.0%	0.3%
シンガポールドル	国債証券	21銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	26銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券	65銘柄	100.0%	11.3%
イスラエルシュケル	国債証券	13銘柄	100.0%	0.3%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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）

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
預金	123,122,262	137,391,198
コール・ローン	110,947,468	591,207,755
国債証券	21,787,959,645	24,371,023,462
派生商品評価勘定	18,312,655	46,904
未収利息	209,470,586	225,921,613
前払費用	8,852,572	20,849,114
流動資産合計	22,258,665,188	25,346,440,046
資産合計	22,258,665,188	25,346,440,046
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	460,728,964	1,695,364,468
未払解約金	67,101,831	1,471,983
未払利息	39	-
流動負債合計	527,830,834	1,696,836,451
負債合計	527,830,834	1,696,836,451
純資産の部		
元本等		
元本	17,138,690,473	18,061,047,708
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	4,592,143,881	5,588,555,887
元本等合計	21,730,834,354	23,649,603,595
純資産合計	21,730,834,354	23,649,603,595
負債純資産合計	22,258,665,188	25,346,440,046

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

		2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
1．	期首	2022年10月27日	2023年10月27日
	期首元本額	15,845,617,925円	17,138,690,473円
	期首からの追加設定元本額	2,354,550,563円	2,604,536,861円
	期首からの一部解約元本額	1,061,478,015円	1,682,179,626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）	5,910,698,702円	7,117,475,880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）	1,472,658,217円	1,518,073,694円
	Ｔｒａｃｅｒｓ　グローバル３分法（おとなのバランス）	100,476,621円	365,623,052円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	1,048,129円	2,954,815円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）	2,939,011円	6,248,483円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	8,565,178,549円	7,913,834,030円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	125,965,523円	129,062,711円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	182,207,848円	195,561,367円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	193,562,007円	217,222,207円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	147,415,694円	166,638,873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	436,540,172円	428,352,596円
	計	17,138,690,473円	18,061,047,708円
2．	受益権の総数	17,138,690,473口	18,061,047,708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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2022年10月27日 至 2023年10月26日	自 2023年10月27日 至 2024年10月28日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

	自 2022年10月27日 至 2023年10月26日	自 2023年10月27日 至 2024年10月28日
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2023年10月26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	△877,607,372
合計	△877,607,372

（2024年10月28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	1,129,636,041
合計	1,129,636,041

(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)

（2023年10月26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	21,742,315,495	－	22,184,731,804	△442,416,309
	米ドル	10,371,147,639	－	10,725,625,335	△354,477,696
	加ドル	426,742,920	－	432,879,477	△6,136,557
	メキシコペソ	198,524,765	－	194,702,730	3,822,035
	ユーロ	7,052,149,077	－	7,112,715,743	△60,566,666
	英ポンド	1,093,975,070	－	1,085,477,507	8,497,563

	スウェーデンクローナ	54,263,605	－	55,149,799	△886,194
	ノルウェークローネ	42,920,883	－	42,013,685	907,198
	デンマーククローネ	68,400,217	－	68,881,019	△480,802
	ポーランドズロチ	118,128,388	－	119,818,243	△1,689,855
	豪ドル	303,959,331	－	303,872,085	87,246
	ニュージーランドドル	35,337,141	－	35,766,625	△429,484
	シンガポールドル	89,378,337	－	90,461,010	△1,082,673
	マレーシアリンギット	315,893,920	－	316,518,941	△625,021
	中国元	1,496,360,965	－	1,528,579,892	△32,218,927
	イスラエルシュケル	75,133,237	－	72,269,713	2,863,524
合計		21,742,315,495	－	22,184,731,804	△442,416,309

（2024年10月28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	23,269,245,529	－	24,964,563,093	△1,695,317,564
	米ドル	10,740,851,251	－	11,708,435,156	△967,583,905
	加ドル	449,777,865	－	479,151,459	△29,373,594
	メキシコペソ	166,671,185	－	172,787,085	△6,115,900
	ユーロ	6,908,063,342	－	7,327,846,415	△419,783,073
	英ポンド	1,238,702,078	－	1,328,517,514	△89,815,436
	スウェーデンクローナ	57,318,537	－	59,919,402	△2,600,865
	ノルウェークローネ	43,888,237	－	45,986,542	△2,098,305
	デンマーククローネ	77,975,188	－	80,557,294	△2,582,106
	ポーランドズロチ	113,495,932	－	117,305,592	△3,809,660
	豪ドル	284,824,879	－	292,012,278	△7,187,399
	ニュージーランドドル	40,508,137	－	41,853,887	△1,345,750
	シンガポールドル	99,911,134	－	104,245,768	△4,334,634
	マレーシアリンギット	345,199,053	－	371,823,372	△26,624,319
	中国元	2,654,011,762	－	2,784,521,484	△130,509,722
	イスラエルシュケル	48,046,949	－	49,599,845	△1,552,896
合計		23,269,245,529	－	24,964,563,093	△1,695,317,564

（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。

①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。

②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）

2023年10月26日現在		2024年10月28日現在	
1口当たり純資産額	1.2679円	1口当たり純資産額	1.3094円
(1万口当たり純資産額)	(12,679円)	(1万口当たり純資産額)	(13,094円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	3,200,000.00	3,133,536.00	
		US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	1,500,000.00	1,438,125.00	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	1,500,000.00	1,472,518.50	
		US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	550,000.00	539,365.20	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	1,600,000.00	1,548,312.00	
		US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	1,000,000.00	951,992.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	2,100,000.00	2,021,250.00	
		US TREASURY N/B-0.625%-26/07/31	1,200,000.00	1,129,358.40	
		US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	900,000.00	859,657.50	
		US TREASURY N/B-4.375%-26/08/15	200,000.00	200,890.60	
		US TREASURY N/B-1.375%-26/08/31	500,000.00	476,054.50	
		US TREASURY N/B-4.625%-26/09/15	850,000.00	857,918.60	
		US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,200,000.00	3,070,873.60	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	500,000.00	475,605.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	1,100,000.00	1,056,300.30	
		US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,000,000.00	935,000.00	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	2,200,000.00	2,014,975.60	
		US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	1,500,000.00	1,439,121.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	1,100,000.00	1,047,706.00	
		US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	500,000.00	449,707.00	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	1,100,000.00	990,171.60	
		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	530,000.00	561,778.80	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	600,000.00	569,062.20	
		US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	1,740,000.00	1,567,766.10	

		US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	900,000.00	863,648.10	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	1,000,000.00	908,554.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	900,000.00	815,923.80	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	1,150,000.00	1,040,232.50	
		US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	1,200,000.00	1,072,593.60	
		US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	1,500,000.00	1,437,421.50	
		US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	500,000.00	448,027.00	
		US TREASURY N/B-4.375%-28/08/31	300,000.00	303,140.40	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	500,000.00	449,238.00	
		US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	210,000.00	219,351.51	
		US TREASURY N/B-1.375%-28/12/31	650,000.00	583,285.95	
		US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	900,000.00	849,005.10	
		US TREASURY N/B-1.875%-29/02/28	1,000,000.00	913,203.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-29/03/31	500,000.00	465,839.50	
		US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	1,600,000.00	1,488,624.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-29/06/30	800,000.00	806,031.20	
		US TREASURY N/B-2.625%-29/07/31	900,000.00	843,907.50	
		US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	850,000.00	762,044.55	
		US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	2,100,000.00	1,842,666.00	
		US TREASURY N/B-4.0%-30/02/28	950,000.00	946,103.10	
		US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	1,700,000.00	1,409,272.80	
		US TREASURY N/B-3.75%-30/05/31	500,000.00	491,347.50	
		US TREASURY N/B-4.125%-30/08/31	500,000.00	500,332.00	
		US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	950,000.00	787,868.25	
		US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	900,000.00	964,651.50	
		US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	600,000.00	514,171.80	
		US TREASURY N/B-4.125%-31/07/31	1,100,000.00	1,098,625.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	900,000.00	746,472.60	
		US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	800,000.00	664,936.80	
		US TREASURY N/B-1.875%-32/02/15	1,000,000.00	856,503.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-32/05/15	900,000.00	824,607.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-32/08/15	300,000.00	271,628.70	
		US TREASURY N/B-4.125%-32/11/15	750,000.00	747,553.50	
		US TREASURY N/B-3.5%-33/02/15	800,000.00	761,265.60	
		US TREASURY N/B-3.375%-33/05/15	500,000.00	470,439.00	
		US TREASURY N/B-3.875%-33/08/15	900,000.00	877,640.40	
		US TREASURY N/B-4.5%-33/11/15	650,000.00	663,520.00	
		US TREASURY N/B-4.0%-34/02/15	700,000.00	687,640.10	
		US TREASURY N/B-4.375%-34/05/15	1,200,000.00	1,213,124.40	
		US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	390,000.00	401,608.35	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	170,000.00	171,188.64	
		US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	390,000.00	354,625.44	
		US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	100,000.00	99,595.70	

		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	230,000.00	228,697.05	
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	220,000.00	205,992.16	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	200,000.00	198,281.20	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	200,000.00	182,953.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-41/11/15	350,000.00	293,138.65	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	300,000.00	232,687.50	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	100,000.00	82,046.80	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	250,000.00	196,464.75	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	140,000.00	122,948.42	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	200,000.00	178,539.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	450,000.00	393,556.50	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	420,000.00	353,439.66	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	450,000.00	354,620.70	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	350,000.00	252,136.50	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	450,000.00	353,214.45	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	700,000.00	536,784.50	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	200,000.00	156,445.20	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	650,000.00	462,667.40	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	150,000.00	106,394.40	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	750,000.00	504,726.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	300,000.00	227,144.40	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	750,000.00	551,000.25	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	550,000.00	403,530.05	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	650,000.00	496,881.45	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	1,000,000.00	649,843.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	350,000.00	213,807.30	
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	1,550,000.00	774,514.85	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	1,600,000.00	823,187.20	
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	400,000.00	219,984.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	1,000,000.00	586,640.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	400,000.00	264,781.20	
		US TREASURY N/B-2.875%-52/05/15	1,270,000.00	934,614.59	
		US TREASURY N/B-3.625%-53/02/15	300,000.00	256,535.10	
		US TREASURY N/B-4.125%-53/08/15	200,000.00	187,250.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-54/02/15	450,000.00	430,875.00	
		US TREASURY N/B-4.625%-54/05/15	300,000.00	305,859.30	
		US TREASURY N/B-4.25%-54/08/15	300,000.00	287,531.10	
米ドル小計			83,410,000.00	74,454,216.52 (11,424,999,524)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-25/10/01	500,000.00	498,655.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	400,000.00	384,816.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-26/08/01	200,000.00	202,886.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	250,000.00	240,055.00	

		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-28/03/01	300,000.00	304,770.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	280,000.00	313,362.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	400,000.00	388,436.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	100,000.00	90,705.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	410,000.00	370,439.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-32/12/01	200,000.00	190,090.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-34/06/01	300,000.00	293,730.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	210,000.00	246,088.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	200,000.00	203,560.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	550,000.00	413,693.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	100,000.00	87,643.00	
加ドル小計			4,400,000.00	4,228,929.10 (467,212,086)	
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	4,000,000.00	3,776,250.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	3,000,000.00	2,726,250.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	2,000,000.00	1,891,250.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	4,000,000.00	3,786,250.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	2,500,000.00	2,239,062.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	4,500,000.00	3,936,093.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	3,000,000.00	2,359,687.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	980,000.00	776,650.00	
メキシコペソ小計			23,980,000.00	21,491,493.75 (165,263,139)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	60,000.00	24,912.60	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	150,000.00	154,542.90	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	100,000.00	96,318.50	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	130,000.00	143,337.74	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	200,000.00	189,512.80	
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	250,000.00	218,870.25	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	300,000.00	271,336.80	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	170,000.00	184,989.58	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	260,000.00	308,161.88	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	150,000.00	168,992.55	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	120,000.00	127,021.56	
		BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	200,000.00	141,457.40	
		BELGIUM KINGDOM-1.4%-53/06/22	50,000.00	31,377.25	
		BELGIUM KINGDOM-3.5%-55/06/22	100,000.00	99,368.50	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	50,000.00	38,034.50	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	110,000.00	80,455.87	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-71/10/31	100,000.00	51,133.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-26/04/30	350,000.00	347,923.80	

		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	400,000.00	424,050.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%-26/10/31	200,000.00	196,067.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%-27/04/30	350,000.00	342,877.85	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/04/30	300,000.00	290,020.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/07/30	100,000.00	96,409.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-28/10/31	300,000.00	330,631.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	430,000.00	491,404.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.5%-29/05/31	300,000.00	312,680.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%-29/10/31	150,000.00	136,592.25	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-30/07/30	150,000.00	145,064.25	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%-30/10/31	300,000.00	277,545.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%-31/04/30	150,000.00	127,523.25	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.7%-32/04/30	200,000.00	172,855.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	200,000.00	241,708.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-33/04/30	200,000.00	204,764.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%-33/07/30	300,000.00	288,690.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.55%-33/10/31	350,000.00	368,192.65	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	430,000.00	475,773.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	300,000.00	349,056.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	150,000.00	185,262.45	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	300,000.00	271,491.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	250,000.00	215,380.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.9%-52/10/31	80,000.00	55,791.84	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	100,000.00	93,990.90	
		BUNDESOBLIGATION-2.4%-28/10/19	150,000.00	151,993.95	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	750,000.00	733,940.25	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	400,000.00	384,488.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15	450,000.00	432,217.35	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	260,000.00	288,727.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-28/02/15	500,000.00	476,997.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-	200,000.00	219,231.80	

		28/07/04			
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-29/02/15	200,000.00	185,885.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.1%-29/11/15	450,000.00	450,009.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	430,000.00	516,420.97	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.4%-30/11/15	100,000.00	101,498.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	420,000.00	501,216.66	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.7%-32/08/15	650,000.00	629,528.25	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.3%-33/02/15	500,000.00	504,236.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.6%-33/08/15	350,000.00	360,657.15	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	300,000.00	364,120.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	260,000.00	302,858.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	250,000.00	302,440.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	270,000.00	346,398.93	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	200,000.00	219,217.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-44/07/04	150,000.00	148,047.75	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-46/08/15	230,000.00	227,100.16	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	200,000.00	104,293.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-52/08/15	200,000.00	99,226.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%-53/08/15	250,000.00	210,703.25	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%-53/08/15	100,000.00	84,407.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-54/08/15	150,000.00	147,329.25	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.7%-26/09/17	200,000.00	202,050.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-25/11/15	300,000.00	299,939.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-26/03/01	550,000.00	563,947.45	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%-26/04/15	400,000.00	407,023.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	550,000.00	601,658.75	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%-26/12/01	300,000.00	292,738.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.1%-27/04/01	300,000.00	290,253.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%-27/08/01	150,000.00	148,235.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	250,000.00	278,654.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-28/02/01	150,000.00	147,450.15	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%-28/03/15	150,000.00	138,701.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%-28/08/01	380,000.00	395,151.36	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-28/09/01	300,000.00	322,794.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	450,000.00	502,196.85	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-30/03/01	350,000.00	361,781.35	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-30/08/01	150,000.00	134,372.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%-31/04/01	350,000.00	307,174.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	350,000.00	412,583.85	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-32/03/01	300,000.00	272,061.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-32/06/01	100,000.00	85,453.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	250,000.00	295,403.75	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.4%-33/05/01	650,000.00	706,712.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.35%-33/11/01	200,000.00	216,452.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	350,000.00	397,322.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-35/04/30	400,000.00	421,024.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	260,000.00	271,965.46	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	150,000.00	170,364.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	300,000.00	340,398.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01	150,000.00	166,536.45	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-46/09/01	450,000.00	404,457.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%-48/03/01	400,000.00	368,056.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-52/09/01	140,000.00	97,060.32	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.3%-54/10/01	150,000.00	153,314.55	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	250,000.00	191,035.00	
		FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	200,000.00	203,340.00	
		FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	100,000.00	89,502.10	
		FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	150,000.00	130,083.45	
		FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	100,000.00	94,592.50	
		FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	100,000.00	73,239.30	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	270,000.00	96,858.72	
		FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	450,000.00	465,393.60	
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	450,000.00	443,389.95	
		FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	400,000.00	406,885.20	

		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	250,000.00	243,127.75	
		FRANCE (GOVT OF)-2.5%-26/09/24	300,000.00	300,907.50	
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	600,000.00	579,961.20	
		FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	500,000.00	505,012.00	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/02/25	150,000.00	141,970.65	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	250,000.00	235,494.75	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	400,000.00	372,967.60	
		FRANCE (GOVT OF)-2.75%-29/02/25	150,000.00	151,163.40	
		FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	490,000.00	550,107.81	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	200,000.00	182,418.40	
		FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	750,000.00	745,258.50	
		FRANCE (GOVT OF)-0.0%-30/11/25	100,000.00	85,249.20	
		FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	950,000.00	882,605.10	
		FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	600,000.00	723,611.40	
		FRANCE (GOVT OF)-2.0%-32/11/25	400,000.00	375,544.00	
		FRANCE (GOVT OF)-3.5%-33/11/25	300,000.00	313,120.20	
		FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	300,000.00	257,378.10	
		FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	280,000.00	322,872.20	
		FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	300,000.00	245,982.00	
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	460,000.00	499,181.88	
		FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	150,000.00	124,095.00	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-40/05/25	270,000.00	178,184.61	
		FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	250,000.00	286,531.75	
		FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	370,000.00	359,817.60	
		FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	200,000.00	152,609.40	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-52/05/25	300,000.00	155,069.10	
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	320,000.00	342,745.92	
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	350,000.00	377,270.25	
		IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	300,000.00	301,068.30	
		IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	300,000.00	253,846.80	
		IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	100,000.00	88,738.80	
		IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	100,000.00	86,000.90	
		IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	50,000.00	37,413.35	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	250,000.00	243,139.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	270,000.00	297,642.06	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	200,000.00	182,323.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-32/07/15	150,000.00	130,056.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	230,000.00	230,953.81	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	300,000.00	340,962.90	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	200,000.00	144,772.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	50,000.00	56,574.35	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	200,000.00	199,515.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-54/01/15	100,000.00	84,736.00	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	130,000.00	99,482.89	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	150,000.00	148,319.85	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	100,000.00	103,489.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	200,000.00	221,016.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	370,000.00	342,113.84	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	200,000.00	194,442.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	200,000.00	225,480.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	100,000.00	101,344.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	50,000.00	29,356.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	80,000.00	92,246.00	
ユーロ小計			43,880,000.00	43,557,667.47 (7,215,327,616)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.5%-26/07/22	350,000.00	335,765.50	
		UK TREASURY-4.125%-27/01/29	150,000.00	149,940.00	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	250,000.00	233,169.50	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	150,000.00	151,389.90	
		UK TREASURY-4.5%-28/06/07	100,000.00	101,409.00	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	320,000.00	344,979.84	
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	350,000.00	302,791.65	
		UK TREASURY-0.375%-30/10/22	200,000.00	162,638.40	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	200,000.00	208,160.00	
		UK TREASURY-4.0%-31/10/22	150,000.00	149,003.25	
		UK TREASURY-1.0%-32/01/31	100,000.00	81,020.70	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	280,000.00	283,689.00	
		UK TREASURY-3.25%-33/01/31	200,000.00	187,709.20	
		UK TREASURY-0.875%-33/07/31	280,000.00	213,348.24	
		UK TREASURY-4.25%-34/07/31	150,000.00	150,393.90	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	300,000.00	307,359.90	
		UK TREASURY-0.625%-35/07/31	220,000.00	151,975.12	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	200,000.00	199,179.20	
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	250,000.00	186,404.75	
		UK TREASURY-3.75%-38/01/29	200,000.00	187,203.80	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	170,000.00	175,673.58	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	250,000.00	241,840.00	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	120,000.00	118,500.00	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	350,000.00	288,121.75	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	50,000.00	42,391.25	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	350,000.00	328,845.30	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	100,000.00	56,030.00	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	100,000.00	58,008.30	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	560,000.00	519,985.20	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	400,000.00	355,280.00	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	300,000.00	239,304.90	

英ポンド小計			7,150,000.00	6,511,511.13 (1,295,269,793)	
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	1,500,000.00	1,477,522.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,750,000.00	1,781,745.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	700,000.00	804,961.50	
スウェーデンクローナ小計			3,950,000.00	4,064,229.00 (58,687,466)	
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	1,000,000.00	970,376.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	1,300,000.00	1,234,662.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-33/08/15	1,000,000.00	951,793.00	
ノルウェークローネ小計			3,300,000.00	3,156,831.00 (44,037,792)	
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	500,000.00	498,738.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	2,300,000.00	2,910,712.10	
デンマーククローネ小計			2,800,000.00	3,409,450.10 (75,689,792)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,200,000.00	1,095,804.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	500,000.00	484,645.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	1,000,000.00	885,740.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.0%-33/10/25	500,000.00	509,275.00	
ポーランドズロチ小計			3,200,000.00	2,975,464.00 (113,424,985)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	150,000.00	144,054.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	280,000.00	281,136.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	150,000.00	152,947.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	200,000.00	193,380.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	350,000.00	339,839.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	300,000.00	276,849.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	300,000.00	249,528.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	150,000.00	126,874.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	250,000.00	206,740.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-33/11/21	200,000.00	179,720.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	300,000.00	278,559.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	370,000.00	276,619.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-54/06/21	100,000.00	97,848.00	
豪ドル小計			3,100,000.00	2,804,095.70 (284,195,099)	
ニュージーランドドル	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.0%-29/04/20	150,000.00	144,302.55	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.5%-33/04/14	190,000.00	178,481.25	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-37/04/15	150,000.00	123,288.60	
ニュージーランドドル小計			490,000.00	446,072.40 (40,900,378)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	400,000.00	407,200.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	100,000.00	104,320.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	150,000.00	147,600.00	

		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	190,000.00	187,348.55	
シンガポールドル小計			840,000.00	846,468.55 (98,131,099)	
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	1,000,000.00	1,010,000.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,400,000.00	1,415,680.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,000,000.00	1,011,000.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,000,000.00	996,510.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	500,000.00	555,149.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	2,250,000.00	2,283,981.75	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,000,000.00	1,004,900.00	
マレーシアリンギット小計			8,150,000.00	8,277,221.25 (291,478,207)	
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	2,000,000.00	2,031,621.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-25/11/25	3,000,000.00	3,025,088.55	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.33%-25/12/15	2,000,000.00	2,018,202.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.46%-26/02/15	3,000,000.00	3,035,539.35	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	1,000,000.00	1,021,464.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.3%-26/05/15	3,000,000.00	3,036,032.55	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.67%-26/06/15	2,000,000.00	2,007,316.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	1,000,000.00	1,020,284.55	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-26/08/15	3,000,000.00	3,034,487.85	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.39%-26/11/15	5,000,000.00	5,077,953.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-27/01/20	2,000,000.00	2,033,400.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.04%-27/02/25	4,000,000.00	4,038,847.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.48%-27/04/15	3,000,000.00	3,060,027.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.85%-27/05/15	2,000,000.00	2,011,554.70	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	3,000,000.00	3,068,250.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.62%-27/08/15	2,000,000.00	1,999,958.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.64%-28/01/15	2,000,000.00	2,055,748.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-28/04/15	3,000,000.00	3,083,738.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	4,000,000.00	4,177,400.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.48%-28/09/25	3,000,000.00	3,072,804.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	1,000,000.00	1,042,154.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-29/01/15	5,000,000.00	5,108,413.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-29/03/24	4,000,000.00	4,161,164.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.05%-29/04/15	1,000,000.00	1,009,086.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-29/06/15	3,000,000.00	3,117,907.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.91%-29/07/15	2,000,000.00	2,006,118.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.79%-29/12/15	4,000,000.00	4,178,846.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-30/03/25	2,000,000.00	2,090,601.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-30/06/25	1,000,000.00	1,035,641.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-30/09/15	3,000,000.00	3,103,468.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.54%-30/12/25	3,000,000.00	3,094,651.20	

		CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-31/03/25	4,000,000.00	4,059,280.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	2,000,000.00	2,129,649.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.87%-31/09/15	3,000,000.00	2,969,121.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.89%-31/11/18	1,000,000.00	1,054,922.25	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	3,000,000.00	3,134,468.85	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-32/09/01	1,000,000.00	1,034,993.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-33/02/25	3,000,000.00	3,180,459.45	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/05/25	3,000,000.00	3,119,763.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.52%-33/08/25	1,000,000.00	1,028,691.35	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/11/25	2,000,000.00	2,082,465.10	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.35%-34/02/25	3,000,000.00	3,047,658.45	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.27%-34/05/25	1,000,000.00	1,011,411.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.11%-34/08/25	3,000,000.00	2,989,471.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	2,000,000.00	2,554,806.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	1,000,000.00	1,264,100.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.32%-52/04/15	4,000,000.00	4,772,868.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-52/10/25	1,000,000.00	1,153,403.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-53/04/15	1,000,000.00	1,171,331.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.0%-53/10/15	1,800,000.00	2,053,090.71	
中国元小計			122,800,000.00	127,669,727.01 (2,749,673,978)	
イスラエルシュケル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	500,000.00	516,119.24	
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	620,000.00	638,979.14	
イスラエルシュケル小計			1,120,000.00	1,155,098.38 (46,732,508)	
合計				24,371,023,462 (24,371,023,462)	

(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　104銘柄	100.0%	46.8%
加ドル	国債証券　15銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券　8銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券　165銘柄	100.0%	29.6%
英ポンド	国債証券　31銘柄	100.0%	5.3%
スウェーデンクローナ	国債証券　3銘柄	100.0%	0.2%
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　4銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券　13銘柄	100.0%	1.2%
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%	1.2%

中国元	国債証券	50銘柄	100.0%	11.3%
イスラエルシュケル	国債証券	2銘柄	100.0%	0.2%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2024年10月31日現在です。

【年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	4,549,677,894円
Ⅱ　負債総額	19,835,818円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	4,529,842,076円
Ⅳ　発行済口数	1,404,218,895口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.2259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

Ⅰ　資産総額	63,455,401,811円
Ⅱ　負債総額	1,372,397,308円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	62,083,004,503円
Ⅳ　発行済口数	21,986,338,710口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.8237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

Ⅰ　資産総額	452,793,645,455円
Ⅱ　負債総額	111,172,854円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	452,682,472,601円
Ⅳ　発行済口数	65,052,020,732口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	6.9588円

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	28,182,757,020円
Ⅱ　負債総額	1,192,256,445円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	26,990,500,575円
Ⅳ　発行済口数	9,194,623,212口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.9355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

Ⅰ　資産総額	55,713,154,904円

Ⅱ　負債総額	196,495,657円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	55,516,659,247円
Ⅳ　発行済口数	42,104,972,640口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3185円

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	168,569,163,734円
Ⅱ　負債総額	349,109,283円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	168,220,054,451円
Ⅳ　発行済口数	55,106,452,878口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.0526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

Ⅰ　資産総額	25,371,205,801円
Ⅱ　負債総額	1,765,448,346円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	23,605,757,455円
Ⅳ　発行済口数	18,084,527,335口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3053円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換
該当事項はありません。
（２）受益者に対する特典
該当事項はありません。
（３）譲渡制限の内容
①　譲渡制限はありません。
②　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。
③　受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。
（４）受益証券の再発行
受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。
（５）受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。
（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2024年10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10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10月末現在）

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

２【事業の内容及び営業の概況】

・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
・委託会社の運用する、2024年10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			768	305,208
	株式投資信託		721	267,206
		単位型	266	7,163
		追加型	455	260,043
	公社債投資信託		47	38,001
		単位型	34	999
		追加型	13	37,002

３【委託会社等の経理状況】

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

並びに同規則第２条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年８月６日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
　また、当社の中間財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」並びに同規則第282条及び第306条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づいて作成しております。

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第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。
　また、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第66期中間会計期間（2024年４月１日から2024年９月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

		第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				
ソフトウエア		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						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	68,901	68,901	△2,067	89,417
当期変動額							
剰余金の配当				△7,420	△7,420		△7,420
当期純利益				17,826	17,826		17,826
自己株式の取得							
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）							
当期変動額合計	―	―	―	10,406	10,406	―	10,406
当期末残高	17,363	5,220	5,220	79,307	79,307	△2,067	99,823

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

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				
		資本剰余金	利益剰余金		

	資本金	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	自己株式	株主資本合計
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 ①　子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 ②　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) 金銭の信託 時価法 (3) デリバティブ 時価法
2　固定資産の減価償却の方法	(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、ソフトウエア(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。 (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。 ① 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。 ② 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。
4 収益の計上基準	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。 (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。 (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。 (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。
5 ヘッジ会計の方法	(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 (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。 (3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。 (4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。
6 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

（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)
※１ 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,437百万円 器具備品 879百万円	※１ 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,482百万円 器具備品 920百万円
※２ 信託資産 流動資産のその他のうち２百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。	※２ 信託資産 流動資産のその他のうち２百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。

※３　関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 未収収益　263百万円 (流動負債) 未払費用　1,778百万円	※３　関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。 (流動資産) 未収収益　248百万円 (流動負債) 未払費用　1,873百万円
※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。	※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。
※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。	※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。

（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		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		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

① 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。

② 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、バリュー・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。

③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

２　金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市場価格

のない株式等は、次表には含めておりません。
また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下３つのレベルに分類しております。
レベル１の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
レベル２の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル１のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
レベル３の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

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

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

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

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

資　産

有価証券

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

デリバティブ取引

株式関連

株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

① 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。

② 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、バリュー・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。

③ 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
金銭の信託	－	3,899	－	3,899
有価証券				

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	投資有価証券	6,132	－	△280
	豪ドル		105	－	0
	香港ドル		699	－	△34
	人民元		5,822	－	△1
	ユーロ		234	－	△10
合計			12,994	－	△328

(注) １　時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

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 米ドル	投資有価証券	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　ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況
(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

(注)　株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

①　ストックオプション（新株予約権）の数

	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。

②　単価情報

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

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

(注)　１　公正な評価単価に代え、本源的価値（評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
　　２　ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
　　当事業年度末における本源的価値の合計額　　344百万円

第65期(自　2023年４月１日　至　2024年３月31日)
１　ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況
(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

	2016年度ストックオプション(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

①　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。

②　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おりました（決定方針等を2022年8月26日付にて上記1に変更しております）。

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(シンガポールドル貨建)(注1)	3,318 (SGD 33,000千)	関係会社短期貸付金	－
							貸付金利息(シンガポールドル貨建)(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した。

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おりません。

２　１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第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。

中間財務諸表等

（１）中間貸借対照表

（単位：百万円）

		第66期中間会計期間 (2024年９月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		21,631
金銭の信託		13,876
有価証券		10
未収委託者報酬		17,767
未収収益		1,082
その他	※２	5,804
流動資産合計		60,173
固定資産		
有形固定資産	※１	335
無形固定資産		470
投資その他の資産		
投資有価証券		20,253
関係会社株式		44,647
長期差入保証金		244
繰延税金資産		50
投資その他の資産合計		65,195
固定資産合計		66,001
資産合計		126,174

（単位：百万円）

	第66期中間会計期間 (2024年９月30日)
負債の部	
流動負債	

未払金		8,826
未払費用		3,471
未払法人税等		2,272
未払消費税等	※３	625
関係会社短期借入金		6,688
賞与引当金		1,764
役員賞与引当金		120
その他		700
流動負債合計		24,470
固定負債		
退職給付引当金		1,489
賞与引当金		358
役員賞与引当金		72
その他		158
固定負債合計		2,079
負債合計		26,549
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		76,524
利益剰余金合計		76,524
自己株式		△2,067
株主資本合計		97,040
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		3,213
繰延ヘッジ損益		△629
評価・換算差額等合計		2,583
純資産合計		99,624
負債純資産合計		126,174

（２）中間損益計算書

（単位：百万円）

		第66期中間会計期間 (自　2024年４月１日 至　2024年９月30日)
営業収益		
委託者報酬		40,928
その他営業収益		2,050
営業収益合計		42,979
営業費用及び一般管理費	※１	38,534
営業利益		4,444
営業外収益	※２	3,213

営業外費用	※３	445
経常利益		7,212
特別利益	※４	172
特別損失	※５	50
税引前中間純利益		7,333
法人税等	※６	2,217
中間純利益		5,116

（３）中間株主資本等変動計算書

第66期中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024年９月30日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	82,591	82,591	△ 2,067	103,107
当中間期変動額							
剰余金の配当				△ 11,183	△ 11,183		△ 11,183
中間純利益				5,116	5,116		5,116
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）							
当中間期変動額合計	－	－	－	△ 6,066	△ 6,066	－	△ 6,066
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	76,524	76,524	△ 2,067	97,040

	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	4,523	△ 1,155	3,367	106,475
当中間期変動額				
剰余金の配当				△ 11,183
中間純利益				5,116
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 1,310	525	△ 784	△ 784
当中間期変動額合計	△ 1,310	525	△ 784	△ 6,851
当中間期末残高	3,213	△ 629	2,583	99,624

注記事項
（重要な会計方針）

項目	第66期中間会計期間 （自　2024年４月１日 至　2024年９月30日）
１　資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 ①子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法

	②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) 金銭の信託 時価法 (3) デリバティブ 時価法
2　固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年４月１日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウエア(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中間会計期間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中間会計期間負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 ①　退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②　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。
4　収益の計上基準	当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行業務の内容及び当該履行業務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。 (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。 (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。

	(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。
5　ヘッジ会計の方法	(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。 (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。 (3) ヘッジ方針 ヘッジ取引細則等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。 (4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。
6　その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1) 資産に係る控除対象外消費税等の会計処理 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は当中間会計期間の費用として処理しております。 (2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。

（中間貸借対照表関係）

第66期中間会計期間 (2024年９月30日)
※１　有形固定資産の減価償却累計額 2,372百万円
※２　信託資産 流動資産のその他のうち２百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
※３　消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
※４　保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド（旧社名「日興ＡＭエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」）が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大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。

（中間損益計算書関係）

第66期中間会計期間 (自　2024年４月１日 至　2024年９月30日)

※１　減価償却実施額

有形固定資産	46百万円
無形固定資産	48百万円

※２　営業外収益のうち主要なもの

有価証券評価益	1,788百万円
受取配当金	1,170百万円
為替差益	132百万円
デリバティブ収益	100百万円

有価証券評価益について、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、振替時の評価差額を営業外収益に計上しております。

※３　営業外費用のうち主要なもの

支払利息	420百万円

※４　特別利益のうち主要なもの

投資有価証券売却益	172百万円

※５　特別損失のうち主要なもの

投資有価証券売却損	42百万円

※６　中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。

（中間株主資本等変動計算書関係）

第66期中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024年９月30日）

１　発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２　自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

３　新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会計期間末残高(百万円)
		当事業年度期首	当中間会計期間増加	当中間会計期間減少	当中間会計期間末	
2016年度ストックオプション（2）	普通株式	121,000	－	121,000	－	－
2017年度ストックオプション（1）	普通株式	346,000	－	154,000	192,000	－
合計		467,000	－	275,000	192,000	－

(注) 1 当中間会計期間の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。
2 2017年度ストックオプション(1) 192,000株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

４　配当に関する事項

(1)配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	１株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2024年５月29日取締役会	普通株式	11,183	57.60	2024年３月31日	2024年６月25日

(2)基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間末後となるもの

該当事項はありません。

(リース取引関係)

第66期中間会計期間 (自　2024年４月１日 至　2024年９月30日)	
オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料	
１年内	862百万円
１年超	2,187百万円
合計	3,049百万円

（金融商品関係）

第66期中間会計期間(2024年９月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

（１）時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
金銭の信託	－	13,876	－	13,876
有価証券				
その他有価証券				
投資信託	6,989	10,736	－	17,725
資産計	6,989	24,613	－	31,602
デリバティブ取引(※１、２)				
株式関連	△257	－	－	△257
通貨関連	－	845	－	845
デリバティブ取引計	△257	845	－	587

（※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257百万円は、中間貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。また通貨関連のデリバティブ取引のうち890百万円は、流動資産のその他に、△45百万円は流動負債のその他に含まれております。

（２）時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、未収収益、未払金、未払費用及び関係会社短期借入金は、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

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

通貨関連

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

（注２）市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

区分	中間貸借対照表計上額
非上場株式	2,538
子会社株式	26,011
関連会社株式	18,635

（有価証券関係）

第66期中間会計期間(2024年９月30日)

１　子会社株式及び関連会社株式

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

２　その他有価証券

（単位：百万円）

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	16,629	11,861	4,767
	小計	16,629	11,861	4,767
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	1,096	1,294	△198
	小計	1,096	1,294	△198
合計		17,725	13,156	4,568

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

2 非上場株式（中間貸借対照表計上額2,538百万円）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。

（金銭の信託関係）

第66期中間会計期間(2024年９月30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	13,876	△22

（デリバティブ取引関係）

第66期中間会計期間(2024年９月30日)

１　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（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）
	株価指数先物取引				

市場取引	売建	17,372	-	△257	△257
合計		17,372	-	△257	△257

(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) 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 買建 シンガポールドル	6,688	―	△45	△45
合計		6,688	―	△45	△45

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

2　ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等（百万円）	契約額等のうち１年超（百万円）	時価（百万円）
原則的処理方法	為替予約取引 売建 米ドル	投資有価証券	6,664	―	641
	豪ドル		186	―	9
	ユーロ		2,374	―	171
	香港ドル		769	―	61
	人民元		1,456	―	6
合計			11,450	―	890

(持分法損益等)

第66期中間会計期間 (自　2024年４月１日 至　2024年９月30日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	5,341百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	17,354百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,083百万円

(収益認識関係)

第66期中間会計期間(2024年９月30日)

1　顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2　顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（ストックオプション等関係）

第66期中間会計期間(自　2024年４月１日　至　2024年９月30日)

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

セグメント情報

第66期中間会計期間(自　2024年４月１日　至　2024年９月30日)

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

関連情報

第66期中間会計期間(自　2024年４月１日　至　2024年９月30日)

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

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66期中間会計期間(自　2024年４月１日　至　2024年９月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第66期中間会計期間(自　2024年４月１日　至　2024年９月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第66期中間会計期間(自　2024年４月１日　至　2024年９月30日)

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

項目	第66期中間会計期間 (自　2024年４月１日 至　2024年９月30日)
１株当たり純資産額	513円12銭
１株当たり中間純利益金額	26円35銭

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

２　１株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第66期中間会計期間 (自　2024年４月１日 至　2024年９月30日)
中間純利益（百万円）	5,116
普通株主に帰属しない金額（百万円）	－
普通株式に係る中間純利益（百万円）	5,116
普通株式の期中平均株式数（千株）	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後１株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2017年度ストックオプション(1)192,000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66期中間会計期間 (2024年９月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額（百万円）	99,624
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	－
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額（百万円）	99,624
１株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数（千株）	194,152

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

４【利害関係人との取引制限】

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

（１）自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

（２）運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

（３）通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（４）、（５）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。

（４）委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

（５）上記（３）、（４）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

（１）定款の変更
委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

名　　称	資本金の額 (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
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	135,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
損保ジャパンＤＣ証券株式会社	3,000百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	
株式会社紀陽銀行	80,096百万円	
株式会社きらやか銀行	34,183百万円	
株式会社肥後銀行	18,128百万円	
株式会社百十四銀行	37,322百万円	
株式会社広島銀行	54,573百万円	
株式会社福岡銀行	82,329百万円	
株式会社横浜銀行	215,628百万円	
第一生命保険株式会社	60,000百万円	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
信金中央金庫	890,998百万円 （出資の総額）	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

２【関係業務の概要】

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

３【資本関係】

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

第３【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2024年 1月26日	有価証券届出書
2024年 1月26日	有価証券報告書
2024年 7月26日	有価証券届出書
2024年 7月26日	半期報告書

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

2025年1月15日

日興アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

PwC Japan有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　辻村　和之
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士　榊原　康太

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」に掲げられている年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）の2023年10月27日から2024年10月28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、年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）の2024年10月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。
当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。
財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。
当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。
その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)1.上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2.XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2024年12月５日

日興アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2024年４月１日から2025年３月31日までの第66期事業年度の中間会計期間（2024年４月１日から2024年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2024年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2024年４月１日から2024年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

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

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

利害関係

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

以　上

(注)1.上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2.ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。