

【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2月6日提出
【計算期間】	第22期(自 2023年11月7日至 2024年11月6日)
【ファンド名】	D C インデックスバランス(株式20)
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社 2025年9月1日にアモーヴァ・ア セットマネジメント株式会社へ変更
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 ステファニー・ドゥルーズ
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

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

内外

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

資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

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

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

年1回

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

グローバル(含む日本)

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

ファミリーファンド

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

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

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

2. インデックスファンドで構成しています。

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

<国内株式>

「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

<海外株式>

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

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

<国内債券>

「日本債券インデックスマザーファンド」

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

<海外債券>

「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

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

著作権などについて

- ※ TOPIX(東証株価指数): TOPIXの指数値およびTOPIXに係る標章または商標は、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「NFRIC」)が公表している指数で、その知的財産権はNFRICに帰属します。なお、NFRICは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行なわれる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- ※ FTSE世界国債インデックス(除く日本) 同指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

3. 株式に20%、債券などに80%投資します。

資産の標準実質組入比率は、株式20%、債券など80%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	15%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	5%
日本債券インデックスマザーファンド	65%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	10%
短期金融資産	5%

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

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

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

※当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。
購入申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて購入の申込みを行なう
資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。



主な投資制限

- ・株式への実質投資割合は、信託財産の総額の30%以下とします。
- ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。

分配方針

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

信託金限度額

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

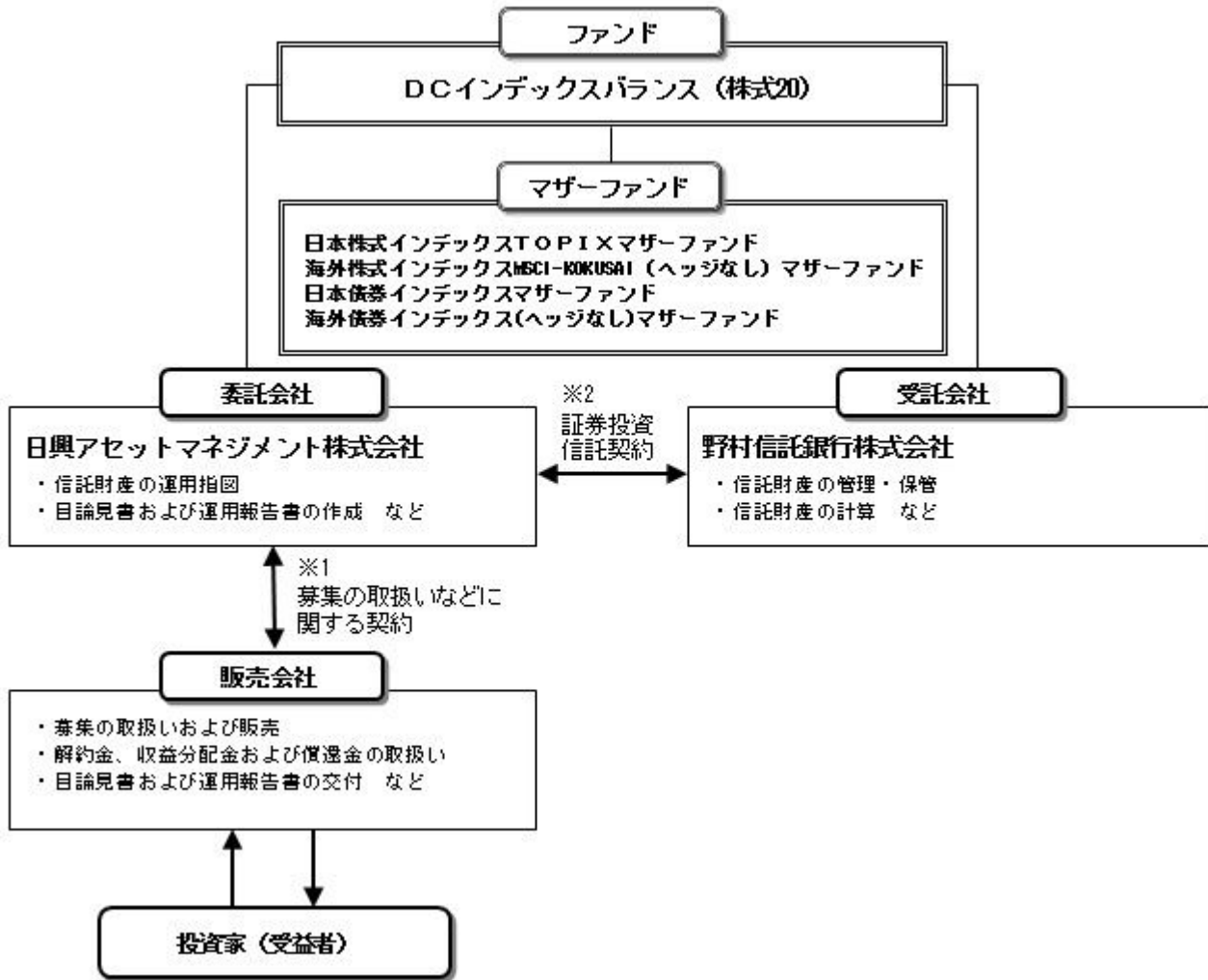
(2) 【ファンドの沿革】

2002年12月10日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み




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

委託会社の概況（2024年11月末現在）

- 1) 資本金
17,363百万円
- 2) 沿革
1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立
1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
2025年：「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に社名変更予定

2025年9月1日、日興アセットマネジメント株式会社は
「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に社名変更します。
社名変更後URL：www.amova-am.com



アモーヴァ・アセットマネジメント

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

- 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
- ・純資産総額に対する株式ならびに公社債および短期金融資産の実質組入比率については、次の標準実質組入比率を目処として投資を行ないます。

株式の標準実質組入比率.....	20%
公社債および短期金融資産の標準実質組入比率.....	80%
 - ・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があります。
 - ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

< DCインデックスバランス(株式20) >

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

- 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」
 - 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
 - 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
- 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限ります。)
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- 主として次のマザーファンドの受益証券ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。
- 1) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券
 - 2) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド」受益証券
 - 3) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券
 - 4) 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」受益証券
 - 5) 株券または新株引受権証書
 - 6) 国債証券
 - 7) 地方債証券
 - 8) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 9) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
 - 10) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 - 11) コマーシャル・ペーパー
 - 12) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
 - 13) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、5)~12)の証券または証書の性質を有するもの
 - 14) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。)
 - 15) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))で16)に定めるもの以外のもの
 - 16) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。))または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 17) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 - 18) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 - 19) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 - 20) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 21) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 - 22) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 23) 外国の者に対する権利で22)の有価証券の性質を有するもの
- 次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。))により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
- 次の取引ができます。
- 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付

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

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

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

投資対象とするマザーファンドの概要

< 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数）* 配当込みの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

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

ファンドに係る費用

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

その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社 2025年9月1日より「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に変更
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1999年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

運用の基本方針

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

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社 2025年9月1日より「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に変更
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	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI 総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・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	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社 2025年9月1日より「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に変更
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	<ul style="list-style-type: none"> 主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・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	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は行ないません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

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

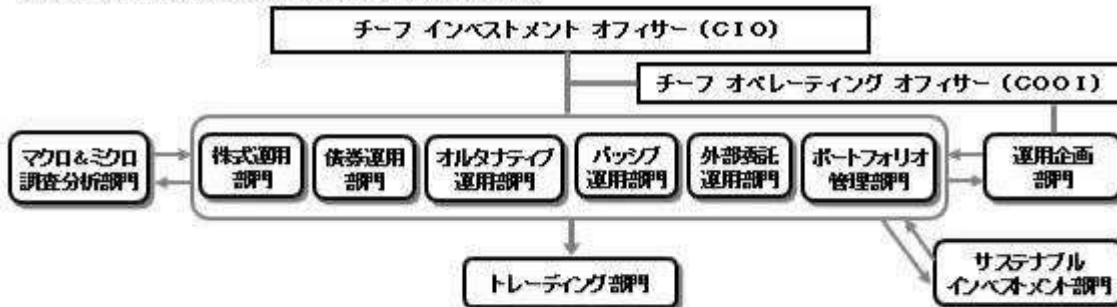
その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社 2025年9月1日より「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に変更
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

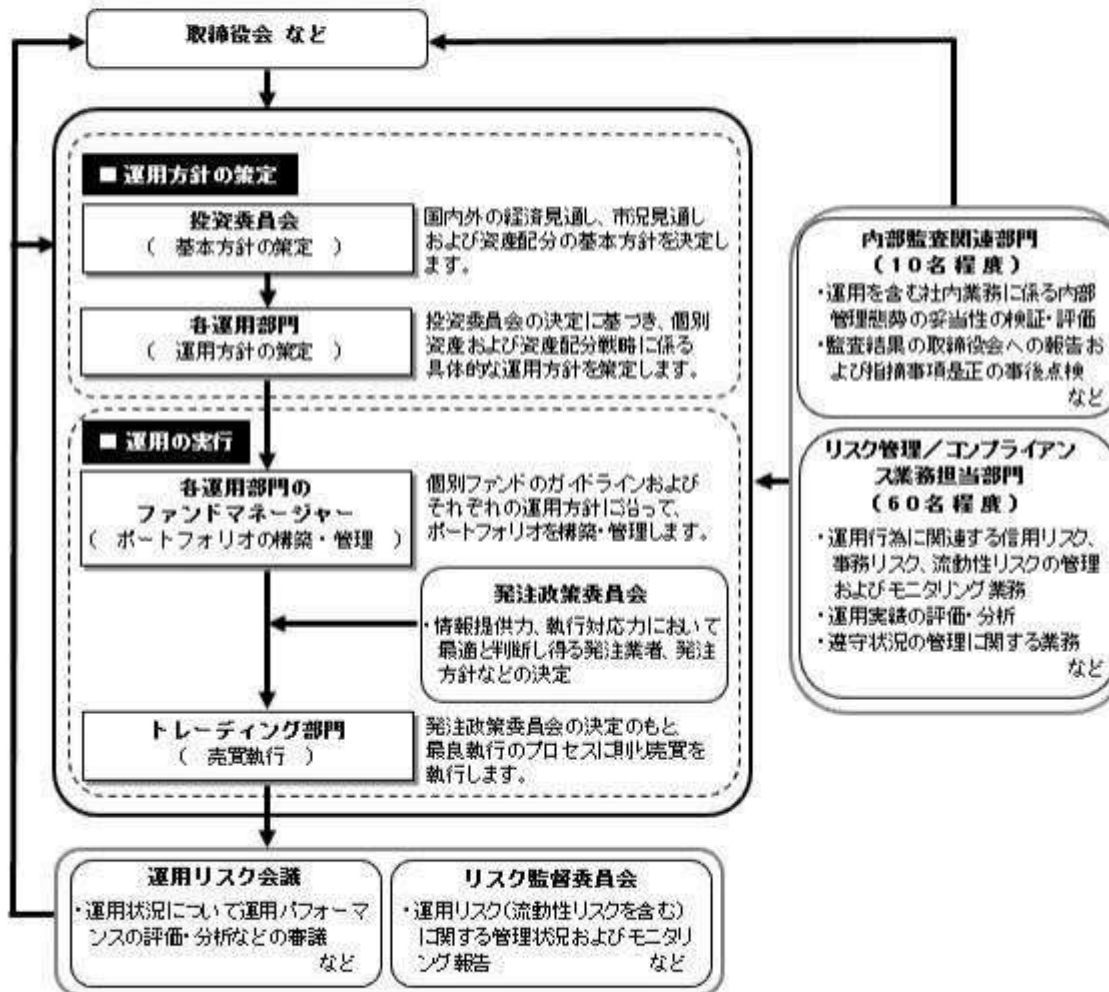
* FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

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

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



上記体制は2024年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

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

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

< DCインデックスバランス（株式20） >

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の30%以下とします。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て(解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入れ額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
- イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
- ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
- ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 16) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 17) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一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ものとします。

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

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

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

<海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

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

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

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

- ・投資者の皆様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。

価格変動リスク

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

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

流動性リスク

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

信用リスク

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

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

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

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

為替変動リスク

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

< その他の留意事項 >

・ システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・ 投資対象とする投資信託証券に関する事項

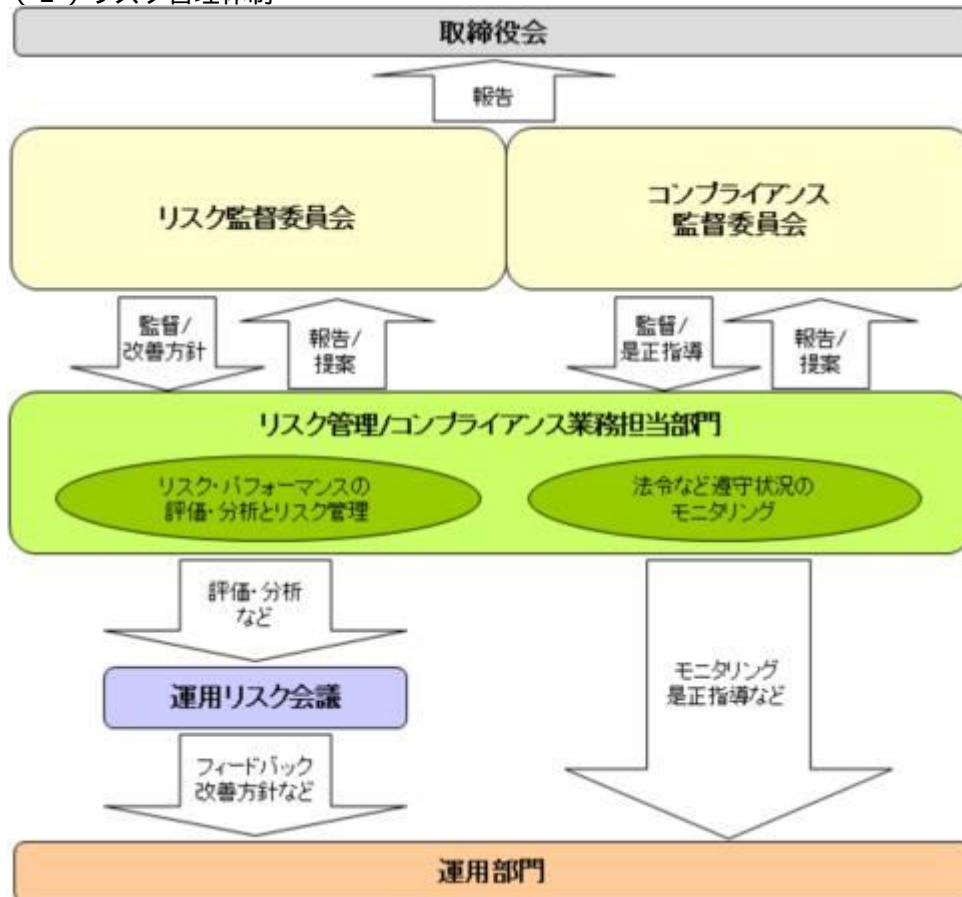
ファンドが投資対象とする投資信託証券(マザーファンドを含みます。)と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

・ 解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

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

(2) リスク管理体制



全社リスク管理

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

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

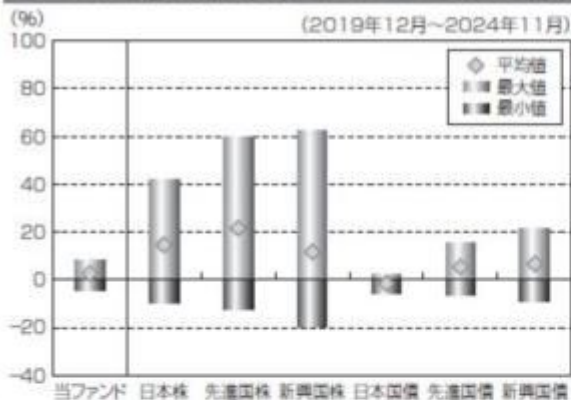
法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2024年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	2.6%	14.6%	21.6%	11.6%	-1.6%	5.3%	6.7%
最大値	7.8%	42.1%	59.8%	62.7%	2.3%	15.3%	21.5%
最小値	-4.4%	-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12月から2024年11月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<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J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

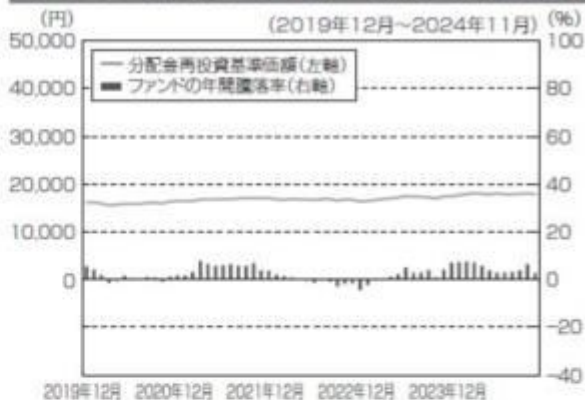
当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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

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

4【手数料等及び税金】

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2019年12月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料
ありません。
信託財産留保額
ありません。

(3) 【信託報酬等】

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

信託報酬の配分
信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

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

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

< 投資対象とするマザーファンドに係る費用 >

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

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

確定拠出年金の場合

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

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

確定拠出年金でない場合

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、15.315%(所得税のみ)の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

1) 各受益者の買付時の基準価額(申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。)が個別元本になります。

2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

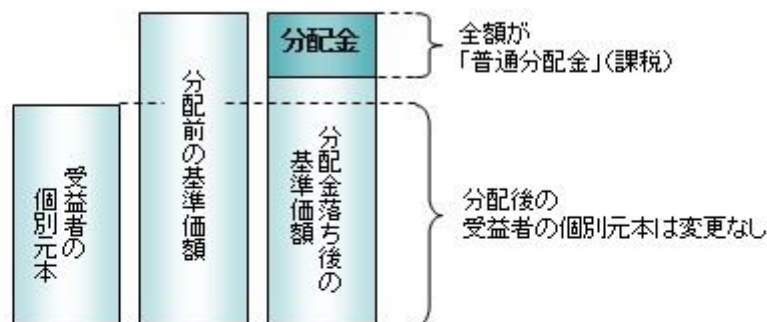
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

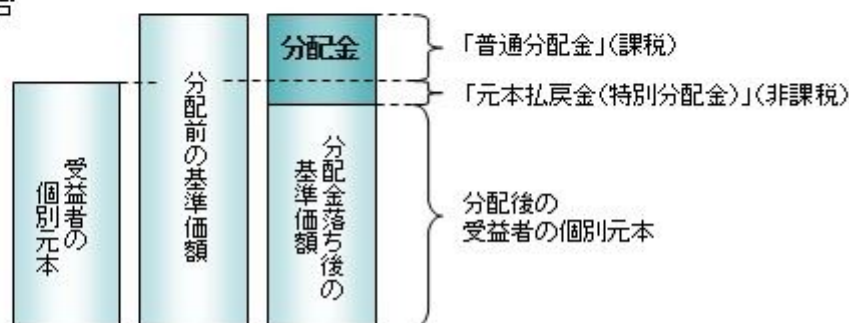
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は2025年2月6日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

(参考情報)ファンドの総経費率

対象期間:2023年11月7日~2024年11月6日

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

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

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

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

5【運用状況】

【DCインデックスバランス(株式20)】

以下の運用状況は2024年11月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	13,014,474,435	94.99
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		687,037,201	5.01
合計(純資産総額)		13,701,511,636	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	6,817,603,528	1.3148	8,964,318,791	1.3093	8,926,288,299	65.15
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	730,134,872	2.8449	2,077,187,721	2.8092	2,051,094,882	14.97
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	452,092,668	3.0373	1,373,160,789	2.9900	1,351,757,077	9.87
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	97,869,929	6.8978	675,087,197	7.0025	685,334,177	5.00

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	94.99
合計	94.99

【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】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額(百万円)	1口当たり純資産額(円)

期別	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第13計算期間末 (2015年11月 6日)	1,596	1,597	1.4811	1.4821
第14計算期間末 (2016年11月 7日)	1,897	1,898	1.4739	1.4749
第15計算期間末 (2017年11月 6日)	2,786	2,788	1.5734	1.5744
第16計算期間末 (2018年11月 6日)	3,972	3,975	1.5529	1.5539
第17計算期間末 (2019年11月 6日)	5,731	5,735	1.6095	1.6105
第18計算期間末 (2020年11月 6日)	7,255	7,259	1.6166	1.6176
第19計算期間末 (2021年11月 8日)	9,177	9,182	1.7154	1.7164
第20計算期間末 (2022年11月 7日)	10,172	10,178	1.6659	1.6669
第21計算期間末 (2023年11月 6日)	11,727	11,727	1.7194	1.7194
第22計算期間末 (2024年11月 6日)	13,631	13,631	1.8002	1.8002
2023年11月末日	11,956		1.7425	
12月末日	12,123		1.7481	
2024年 1月末日	12,393		1.7683	
2月末日	12,611		1.7912	
3月末日	12,876		1.8078	
4月末日	12,789		1.7962	
5月末日	12,875		1.7837	
6月末日	13,084		1.8022	
7月末日	13,037		1.7877	
8月末日	13,327		1.7893	
9月末日	13,509		1.7898	
10月末日	13,677		1.8030	
11月末日	13,701		1.7902	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	0.0010
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	0.0010
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	0.0010
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	0.0010
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	0.0010
第18期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	0.0010
第19期	2020年11月 7日～2021年11月 8日	0.0010
第20期	2021年11月 9日～2022年11月 7日	0.0010
第21期	2022年11月 8日～2023年11月 6日	0.0000
第22期	2023年11月 7日～2024年11月 6日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	4.31
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	0.42
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	6.82

第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	1.24
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	3.71
第18期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	0.50
第19期	2020年11月 7日～2021年11月 8日	6.17
第20期	2021年11月 9日～2022年11月 7日	2.83
第21期	2022年11月 8日～2023年11月 6日	3.21
第22期	2023年11月 7日～2024年11月 6日	4.70

(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13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	268,579,632	160,353,535
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	366,937,574	157,154,931
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	810,944,162	327,224,124
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	1,143,786,634	356,834,525
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	1,407,279,087	404,151,766
第18期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	1,684,200,125	757,447,846
第19期	2020年11月 7日～2021年11月 8日	1,741,623,241	879,579,719
第20期	2021年11月 9日～2022年11月 7日	1,619,299,323	862,987,766
第21期	2022年11月 8日～2023年11月 6日	1,584,599,335	869,954,642
第22期	2023年11月 7日～2024年11月 6日	1,866,388,782	1,115,574,643

（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11月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	61,192,551,220	98.83
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		725,269,648	1.17
合計（純資産総額）		61,917,820,868	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	750,120,000	1.21

(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	847,100	2,706.06	2,292,307,479	2,551.50	2,161,375,650	3.49
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,029,200	1,566.96	1,612,715,888	1,792.00	1,844,326,400	2.98
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	558,000	2,699.76	1,506,467,510	3,007.00	1,677,906,000	2.71
日本	株式	日立製作所	電気機器	414,400	4,027.49	1,668,991,954	3,751.00	1,554,414,400	2.51
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	127,800	9,238.51	1,180,682,651	10,385.00	1,327,203,000	2.14
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	327,400	3,162.46	1,035,392,453	3,686.00	1,206,796,400	1.95
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,900	66,367.10	1,055,237,000	64,720.00	1,029,048,000	1.66
日本	株式	任天堂	その他製品	100,600	8,160.32	820,928,349	8,810.00	886,286,000	1.43
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	153,200	5,521.31	845,864,820	5,564.00	852,404,800	1.38
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	113,300	7,538.80	854,146,238	7,384.00	836,607,200	1.35
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	211,800	3,118.52	660,503,743	3,784.00	801,451,200	1.29
日本	株式	信越化学工業	化学	143,100	5,593.17	800,383,760	5,554.00	794,777,400	1.28
日本	株式	三菱商事	卸売業	311,600	2,804.69	873,941,404	2,525.50	786,945,800	1.27
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	33,700	23,847.63	803,665,205	23,310.00	785,547,000	1.27
日本	株式	三井物産	卸売業	247,800	3,152.20	781,115,160	3,136.00	777,100,800	1.26
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4,753,700	146.83	697,985,840	153.40	729,217,580	1.18
日本	株式	第一三共	医薬品	150,800	4,894.15	738,038,600	4,749.00	716,149,200	1.16
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	78,800	9,008.68	709,884,672	8,936.00	704,156,800	1.14
日本	株式	三菱重工業	機械	281,400	2,082.58	586,038,600	2,197.50	618,376,500	1.00
日本	株式	HOYA	精密機器	31,200	20,102.31	627,192,072	19,260.00	600,912,000	0.97
日本	株式	KDDI	情報・通信業	117,500	4,764.86	559,871,121	4,950.00	581,625,000	0.94
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	142,200	4,133.38	587,766,670	4,083.00	580,602,600	0.94
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,557,000	188.22	481,288,747	193.10	493,756,700	0.80
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	377,600	1,580.23	596,697,812	1,291.50	487,670,400	0.79
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	9,500	50,438.00	479,161,000	51,110.00	485,545,000	0.78
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	186,200	2,276.74	423,929,637	2,604.00	484,864,800	0.78
日本	株式	富士通	電気機器	148,100	2,969.18	439,735,800	2,866.00	424,454,600	0.69
日本	株式	三菱電機	電気機器	163,700	2,342.53	383,472,260	2,547.00	416,943,900	0.67
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	50,200	8,215.05	412,395,858	8,240.00	413,648,000	0.67
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	95,300	4,133.50	393,923,264	4,219.00	402,070,700	0.65

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.25
		建設業	2.14
		食料品	3.14
		繊維製品	0.41
		パルプ・紙	0.13
		化学	5.29
		医薬品	4.52
		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	0.81
	非鉄金属	0.82
	金属製品	0.49
	機械	5.48
	電気機器	17.11
	輸送用機器	6.86
	精密機器	2.40
	その他製品	2.58
	電気・ガス業	1.28
	陸運業	2.35
	海運業	0.64
	空運業	0.35
	倉庫・運輸関連業	0.15
	情報・通信業	7.58
	卸売業	6.66
	小売業	4.59
	銀行業	8.68
	証券、商品先物取引業	0.88
	保険業	3.26
	その他金融業	1.22
	不動産業	1.80
	サービス業	5.09
合 計		98.83

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	28	日本円	749,710,450	750,120,000	1.21

(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11月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	328,990,636,793	72.76
	カナダ	14,875,201,715	3.29
	ドイツ	9,786,040,144	2.16

	イタリア	2,309,020,329	0.51
	フランス	10,659,880,267	2.36
	オランダ	6,939,660,047	1.53
	スペイン	2,863,452,867	0.63
	ベルギー	824,401,723	0.18
	オーストリア	192,012,336	0.04
	ルクセンブルク	659,840,736	0.15
	フィンランド	1,041,598,281	0.23
	アイルランド	8,842,629,839	1.96
	ポルトガル	146,827,858	0.03
	イギリス	15,493,847,179	3.43
	スイス	11,726,366,390	2.59
	スウェーデン	3,400,843,044	0.75
	ノルウェー	648,818,656	0.14
	デンマーク	3,520,223,352	0.78
	ケイマン	643,115,637	0.14
	オーストラリア	7,751,372,349	1.71
	バミューダ	428,160,594	0.09
	ニュージーランド	311,580,230	0.07
	香港	1,742,463,302	0.39
	シンガポール	1,338,767,988	0.30
	イスラエル	963,040,698	0.21
	ジャージー	632,874,315	0.14
	アラブ首長国連邦	0	0.00
	マン島	38,197,782	0.01
	小計	436,770,874,451	96.59
新株予約権証券	カナダ	0	0.00
投資証券	アメリカ	7,620,706,267	1.69
	カナダ	13,734,995	0.00
	フランス	145,400,720	0.03
	ベルギー	25,399,914	0.01
	イギリス	129,125,875	0.03
	オーストラリア	520,957,214	0.12
	香港	67,790,661	0.01
	シンガポール	90,246,335	0.02
	小計	8,613,361,981	1.90
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		6,796,126,708	1.50
合計（純資産総額）		452,180,363,140	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	5,893,557,150	1.30
	買建	ドイツ	890,134,960	0.20

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

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		5,916,786,595	1.31
	売建		13,117,208	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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	663,724	34,892.47	23,158,971,078	35,413.34	23,504,689,121	5.20
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,071,510	21,335.73	22,861,458,339	20,401.15	21,860,037,951	4.83
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	308,274	64,536.04	19,894,783,222	63,761.51	19,656,016,535	4.35
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	412,370	28,335.16	11,684,570,459	31,013.24	12,788,932,913	2.83
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	95,340	86,411.70	8,238,491,955	85,801.20	8,180,287,171	1.81
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	255,460	24,912.79	6,364,223,837	25,509.73	6,516,715,677	1.44
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	124,905	40,577.70	5,068,357,693	50,179.83	6,267,712,740	1.39
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	219,990	25,172.07	5,537,604,251	25,749.40	5,664,612,002	1.25
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	124,950	33,511.00	4,187,200,625	37,653.34	4,704,785,408	1.04
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	192,330	26,078.02	5,015,585,587	24,068.65	4,629,124,570	1.02
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	金融サービス	57,565	68,437.46	3,939,602,811	72,819.47	4,191,853,320	0.93
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	35,139	134,565.59	4,728,500,548	118,811.76	4,174,926,456	0.92
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	40,030	85,101.77	3,406,624,029	91,707.20	3,671,039,264	0.81
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	195,039	18,011.92	3,513,027,372	17,736.06	3,459,225,045	0.77
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	72,612	42,739.75	3,103,418,757	47,437.87	3,444,559,197	0.76
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	36,050	76,479.44	2,757,084,042	80,250.96	2,893,047,151	0.64
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	19,264	134,342.50	2,587,973,974	144,944.04	2,792,202,121	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	43,105	60,131.69	2,591,976,644	64,394.62	2,775,730,121	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	102,649	25,357.48	2,602,920,252	27,036.72	2,775,292,928	0.61

アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品 流通・小売 り	192,146	12,437.55	2,389,826,904	13,849.99	2,661,220,409	0.59
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・ 娯楽	18,760	113,760.46	2,134,146,290	132,250.23	2,481,014,345	0.55
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	104,431	24,251.05	2,532,561,528	23,424.99	2,446,295,757	0.54
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	140,050	16,736.96	2,344,011,528	15,953.78	2,234,327,449	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	306,329	6,314.49	1,934,314,041	7,200.84	2,205,829,118	0.49
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	76,836	28,316.50	2,175,727,286	27,597.47	2,120,479,912	0.47
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェ ア・サービ ス	42,146	43,783.94	1,845,317,952	49,745.70	2,096,582,584	0.46
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェ ア・サービ ス	71,963	26,156.40	1,882,293,359	27,540.19	1,981,875,269	0.44
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	76,051	22,733.09	1,728,874,943	24,436.46	1,858,417,326	0.41
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半 導体製造装 置	17,367	105,724.72	1,836,121,213	102,349.68	1,777,506,893	0.39
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	151,810	9,727.25	1,476,694,156	11,638.63	1,766,861,240	0.39

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	4.09
		素材	3.32
		資本財	7.06
		商業・専門サービス	1.59
		運輸	1.53
		自動車・自動車部品	1.92
		耐久消費財・アパレル	1.14
		消費者サービス	2.00
		メディア・娯楽	6.48
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.99
		生活必需品流通・小売り	1.82
		食品・飲料・タバコ	2.82
		家庭用品・パーソナル用品	1.48
		ヘルスケア機器・サービス	3.95
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.80
		銀行	5.75
		金融サービス	7.30
		保険	3.08
		ソフトウェア・サービス	10.04
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.72
電気通信サービス	1.17		

		公益事業	2.65
		半導体・半導体製造装置	8.61
		不動産管理・開発	0.29
新株予約権証券			
投資証券			1.90
合計			98.50

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2412	買建	130	米ドル	38,627,500	5,822,709,350	39,097,500	5,893,557,150	1.30
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2412	買建	130	ユーロ	5,644,660	898,629,872	5,591,300	890,134,960	0.20

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

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	34,500,000.00	5,280,971,310	5,164,085,350	1.14
	ユーロ	買建	4,750,000.00	773,190,905	752,701,245	0.17
	加ドル	売建	122,000.00	13,199,180	13,117,208	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2024年11月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	48,666,854,700	87.48
地方債証券	日本	2,580,148,546	4.64
特殊債券	日本	1,983,838,434	3.57
社債券	日本	2,215,732,605	3.98
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		182,485,092	0.33
合計(純資産総額)		55,629,059,377	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	99.79	698,572,000	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	99.14	694,008,000	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	98.75	671,547,600	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	99.02	653,578,200	0.100	2026/12/20	1.17
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	645,000,000	99.47	641,581,500	99.29	640,446,300	0.100	2026/6/20	1.15
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	630,000,000	99.61	627,561,900	99.45	626,547,600	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	98.45	580,902,200	0.100	2027/12/20	1.04
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	580,000,000	97.09	563,168,400	96.46	559,508,600	0.100	2030/9/20	1.01
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	560,000,000	97.55	546,302,400	96.97	543,082,400	0.100	2029/12/20	0.98
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	540,000,000	98.71	533,066,400	98.30	530,841,600	0.100	2028/3/20	0.95
日本	国債証券	第372回利付国債(10年)	500,000,000	99.62	498,135,000	98.94	494,710,000	0.800	2033/9/20	0.89
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	500,000,000	98.97	494,860,000	98.60	493,045,000	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	95.91	479,565,000	0.100	2031/6/20	0.86
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	500,000,000	96.21	481,060,000	95.67	478,350,000	0.100	2031/9/20	0.86
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	490,000,000	97.93	479,861,900	97.25	476,539,700	0.500	2032/12/20	0.86
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	480,000,000	96.57	463,540,800	95.87	460,219,200	0.400	2033/6/20	0.83
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	480,000,000	96.41	462,811,200	95.79	459,825,600	0.200	2032/3/20	0.83
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	460,000,000	99.18	456,246,400	98.90	454,944,600	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	96.32	443,081,200	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	95.21	428,445,000	0.200	2032/9/20	0.77
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	435,000,000	98.56	428,775,150	98.12	426,848,100	0.100	2028/6/20	0.77
日本	国債証券	第373回利付国債(10年)	440,000,000	97.58	429,391,600	96.96	426,632,800	0.600	2033/12/20	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	97.94	411,356,400	0.100	2028/9/20	0.74
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	420,000,000	97.67	410,251,800	96.98	407,345,400	0.500	2033/3/20	0.73
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	420,000,000	97.27	408,538,200	96.64	405,888,000	0.100	2030/6/20	0.73
日本	国債証券	第374回利付国債(10年)	410,000,000	99.04	406,096,800	98.38	403,366,200	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	95.49	401,062,200	0.200	2032/6/20	0.72
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	410,000,000	95.95	393,399,100	95.39	391,107,200	0.100	2031/12/20	0.70
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	400,000,000	98.23	392,948,000	97.75	391,008,000	0.100	2028/12/20	0.70
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	400,000,000	96.68	386,740,000	96.15	384,600,000	0.100	2031/3/20	0.69

□. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	87.48
地方債証券	4.64

特殊債券	3.57
社債券	3.98
合 計	99.67

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11月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	75,751,301,353	46.33
	カナダ	3,133,777,265	1.92
	メキシコ	1,167,642,146	0.71
	ドイツ	9,432,770,323	5.77
	イタリア	11,260,059,642	6.89
	フランス	12,029,983,090	7.36
	オランダ	2,148,433,929	1.31
	スペイン	7,278,643,744	4.45
	ベルギー	2,546,493,766	1.56
	オーストリア	1,784,643,467	1.09
	フィンランド	806,420,519	0.49
	アイルランド	771,160,939	0.47
	ポルトガル	950,295,120	0.58
	イギリス	8,361,639,286	5.11
	スウェーデン	269,568,765	0.16
	ノルウェー	250,272,124	0.15
	デンマーク	427,139,945	0.26
	ポーランド	828,452,351	0.51
	オーストラリア	2,072,605,489	1.27
	ニュージーランド	452,843,000	0.28
シンガポール	668,171,245	0.41	
マレーシア	816,112,194	0.50	
中国	18,116,088,487	11.08	
イスラエル	516,065,816	0.32	
	小計	161,840,584,005	98.97
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,678,723,940	1.03
合計（純資産総額）		163,519,307,945	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 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,450,000	15,289.49	1,291,962,573	15,234.16	1,287,286,626	4.625	2027/6/15	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,750,000	14,955.63	1,009,505,629	14,931.20	1,007,856,270	3.625	2026/5/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,940,000	13,514.18	937,884,627	13,497.41	936,720,278	1.750	2029/11/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	15,024.82	918,017,028	15,001.26	916,577,472	4.125	2032/11/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,950,000	15,101.66	898,548,817	15,052.50	895,624,016	4.125	2028/7/31	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,540,000	15,387.53	852,469,672	15,364.28	851,181,113	4.500	2033/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,020,000	12,917.70	777,646,113	12,912.70	777,344,838	1.625	2031/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,870,000	12,910.92	757,871,369	12,910.92	757,871,369	1.875	2032/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	15,182.03	759,101,767	15,127.28	756,364,329	4.250	2029/2/28	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,910,000	12,501.39	738,832,491	12,499.34	738,711,332	0.875	2030/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,773.10	738,655,394	14,735.42	736,771,144	3.250	2027/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,900,000	14,993.91	734,701,680	14,950.92	732,595,119	4.000	2030/7/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	15,238.86	732,989,375	15,218.84	732,026,496	4.375	2034/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,980,000	14,544.63	724,322,637	14,509.59	722,578,045	3.250	2029/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	15,231.79	715,894,348	15,179.98	713,459,309	4.500	2027/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	14,508.72	702,222,290	14,508.72	702,222,290	1.625	2026/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	13,648.43	696,070,274	13,634.31	695,349,933	2.750	2032/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,480,000	12,528.00	686,534,477	12,533.20	686,819,466	1.375	2031/11/15	0.42
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	2,103.76	673,206,389	2,106.48	674,074,573	2.180	2026/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	14,024.69	674,588,015	14,000.85	673,440,971	2.375	2029/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,930,000	13,623.41	671,634,305	13,607.51	670,850,284	1.500	2028/11/30	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	13,811.25	662,940,049	13,799.47	662,374,955	2.875	2032/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,490,000	14,673.58	658,844,162	14,673.89	658,857,698	2.250	2026/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,590,000	14,219.89	652,693,047	14,192.51	651,436,563	2.625	2029/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,630,000	14,044.12	650,243,184	14,016.16	648,948,531	2.375	2029/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,090,000	12,384.81	630,387,005	12,384.22	630,357,082	0.625	2030/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,450,000	13,639.60	606,962,351	13,637.25	606,857,707	0.375	2027/7/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	15,168.80	606,752,015	15,142.88	605,715,527	4.875	2025/11/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	14,445.12	606,695,368	14,411.27	605,273,407	2.875	2028/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,790,000	12,502.58	598,873,900	12,505.52	599,014,699	1.250	2031/8/15	0.37

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.97
合計	98.97

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

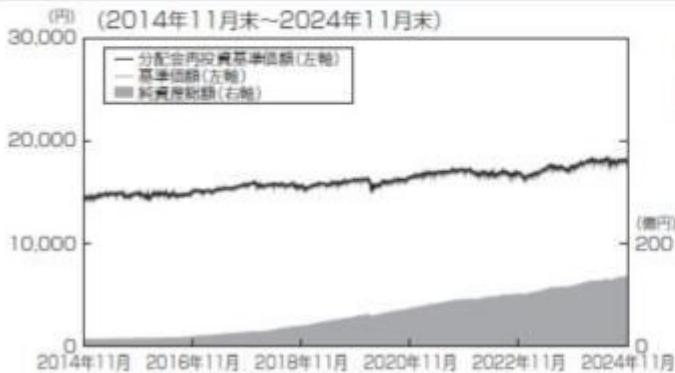
該当事項はありません。

参考情報

運用実績

2024年11月29日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額……………17,902円

純資産総額……………137.01億円

※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11月末の基準価額を起点として指数化しています。
 ※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2020年11月	2021年11月	2022年11月	2023年11月	2024年11月	設定来累計
10円	10円	10円	0円	0円	170円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	14.97%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	5.00%
日本債券インデックスマザーファンド	65.15%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	9.87%
現金その他	5.01%

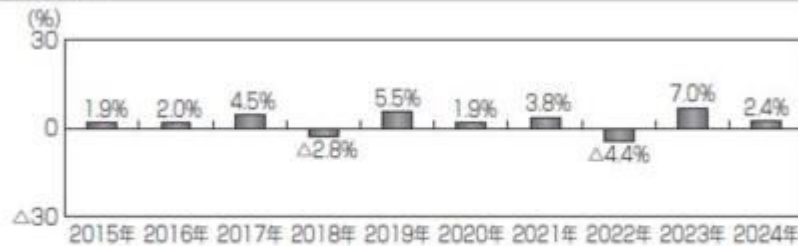
※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	業種	比率	
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.49%	
	2 三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.98%	
	3 ソニーグループ	電気機器	2.71%	
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	1 APPLE INC	テクノロジーハードウェアおよび機器	5.20%	
	2 NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	4.83%	
	3 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.35%	
組入資産	銘柄	種類	償還期限	比率
日本債券インデックス マザーファンド	1 第341回利付国債(10年)	国債証券	2025/12/20	1.26%
	2 第344回利付国債(10年)	国債証券	2026/9/20	1.25%
	3 第347回利付国債(10年)	国債証券	2027/6/20	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	2027/6/15	0.79%
	2 US TREASURY N/B (クーポン3.625%)	国債証券	2026/5/15	0.62%
	3 US TREASURY N/B (クーポン1.750%)	国債証券	2029/11/15	0.57%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2024年は、2024年11月末までの騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- (1) 申込方法
 - ・確定拠出年金制度の規定に従い、販売会社所定の方法でお申し込みください。
 - ・当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて取得の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。
- (2) 申込みの受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (3) 取扱時間
原則として、午後3時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です。
- (5) 申込単位
1円以上1円単位
- (6) 申込代金の支払い
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
- (7) 受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。
金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。

2【換金（解約）手続等】

< 解約請求による換金 >

- (1) 解約の受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間
原則として、午後3時30分までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (3) 解約制限
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (4) 解約価額
解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

2025年9月1日より「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に変更

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

2025年9月1日よりwww.amova-am.comに変更

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。

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

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

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

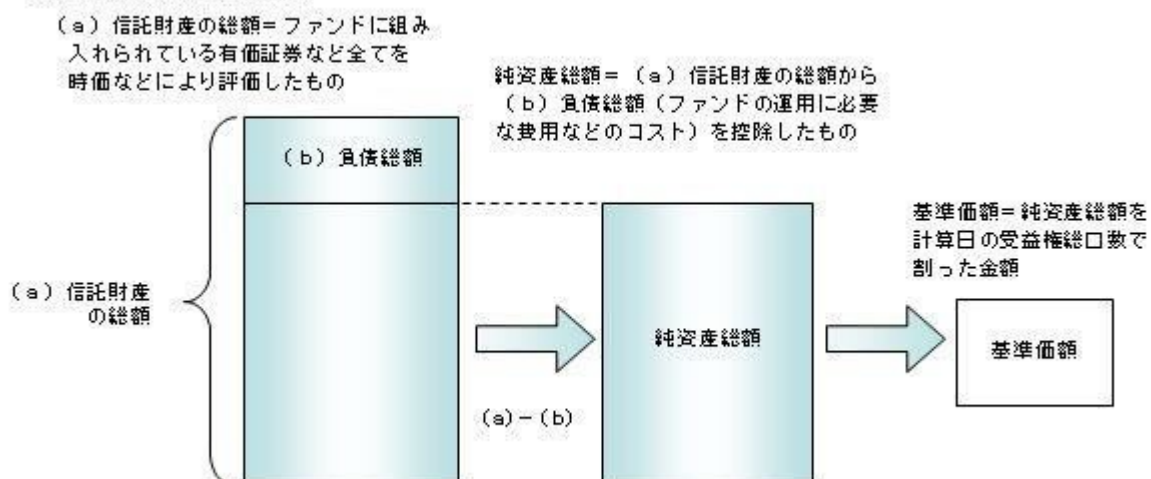
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

公社債(国内・外国)

原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。

- ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値)
 - ・金融商品取引業者(第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。)、銀行などの提示する価額(売気配相場を除きます。)
 - ・価格情報会社の提供する価額
- 残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

*外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

2025年9月1日より「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に変更

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

2025年9月1日よりwww.amova-am.comに変更

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします(2002年12月10日設定)。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年11月7日から翌年11月6日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) 【その他】

信託の終了(繰上償還)

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

償還金について

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

信託約款の変更

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

異議の申立て

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

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

2025年9月1日よりwww.amova-am.comに変更いたしますが、それ以前に本項に関連して法令改正が見込まれております。今後、法令改正の内容に応じて修正を行なう予定です。

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第22期計算期間(2023年11月7日から2024年11月6日まで)の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【DCインデックスバランス（株式20）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第21期 2023年11月 6日現在	第22期 2024年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	590,824,350	693,672,666
親投資信託受益証券	11,149,479,555	12,951,547,961
未収入金	13,612,754	6,159,976
未収利息	-	4,441
流動資産合計	11,753,916,659	13,651,385,044
資産合計	11,753,916,659	13,651,385,044
負債の部		
流動負債		
未払解約金	17,046,236	9,933,519
未払受託者報酬	1,254,899	1,445,053
未払委託者報酬	7,529,761	8,670,685
未払利息	108	-
その他未払費用	250,927	288,960
流動負債合計	26,081,931	20,338,217
負債合計	26,081,931	20,338,217
純資産の部		
元本等		
元本	6,821,026,947	7,571,841,086
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,906,807,781	6,059,205,741
（分配準備積立金）	751,311,373	1,045,890,091
元本等合計	11,727,834,728	13,631,046,827
純資産合計	11,727,834,728	13,631,046,827
負債純資産合計	11,753,916,659	13,651,385,044

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第21期		第22期	
	自	2022年11月 8日	自	2023年11月 7日
	至	2023年11月 6日	至	2024年11月 6日
営業収益				
受取利息		-		614,174
有価証券売買等損益		359,337,527		582,807,050
営業収益合計		359,337,527		583,421,224
営業費用				
支払利息		200,659		12,867
受託者報酬		2,401,048		2,802,352
委託者報酬		14,407,005		16,814,778
その他費用		480,792		560,384
営業費用合計		17,489,504		20,190,381
営業利益又は営業損失（ ）		341,848,023		563,230,843
経常利益又は経常損失（ ）		341,848,023		563,230,843
当期純利益又は当期純損失（ ）		341,848,023		563,230,843
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（ ）		26,695,073		62,250,727
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		4,066,054,665		4,906,807,781
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,106,467,699		1,460,959,940
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,106,467,699		1,460,959,940
剰余金減少額又は欠損金増加額		580,867,533		809,542,096
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		580,867,533		809,542,096
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（ ）		4,906,807,781		6,059,205,741

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第21期 2023年11月 6日現在	第22期 2024年11月 6日現在
1. 期首元本額	6,106,382,254円	6,821,026,947円
期中追加設定元本額	1,584,599,335円	1,866,388,782円
期中一部解約元本額	869,954,642円	1,115,574,643円
2. 受益権の総数	6,821,026,947口	7,571,841,086口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第21期 自 2022年11月 8日 至 2023年11月 6日		第22期 自 2023年11月 7日 至 2024年11月 6日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	128,342,839円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	154,607,630円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	248,761,045円
C 信託約款に定める収益調整金	4,155,496,408円	C 信託約款に定める収益調整金	5,013,315,650円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	622,968,534円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	642,521,416円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	4,906,807,781円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)	6,059,205,741円
F 分配対象収益(1万口当たり)	7,193円	F 分配対象収益(1万口当たり)	8,002円
G 分配金額	0円	G 分配金額	0円
H 分配金額(1万口当たり)	0円	H 分配金額(1万口当たり)	0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	第21期 自 2022年11月 8日 至 2023年11月 6日	第22期 自 2023年11月 7日 至 2024年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	第21期 2023年11月 6日現在	第22期 2024年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第21期（2023年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	317,378,053
合計	317,378,053

第22期（2024年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	488,195,452
合計	488,195,452

（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21期 2023年11月 6日現在	第22期 2024年11月 6日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7194円 (17,194円)	1.8002円 (18,002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	99,358,157	685,352,695	
	日本債券インデックスマザーファンド	6,711,526,424	8,825,657,247	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	449,934,113	1,366,674,868	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	728,847,667	2,073,863,151	
合計		7,989,666,361	12,951,547,961	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

（参考）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

2023年11月 6日現在

2024年11月 6日現在

資産の部		
流動資産		
コール・ローン	228,866,758	338,944,729
株式	52,617,187,660	61,801,121,520
派生商品評価勘定	21,521,250	9,669,350
未収入金	85,200	-
未収配当金	481,193,989	600,140,632
未収利息	-	2,170
前払金	-	4,490,800
流動資産合計	53,348,854,857	62,754,369,201
資産合計		
53,348,854,857		
負債の部		
流動負債		
前受金	9,973,500	-
未払金	-	196,656,040
未払解約金	37,082,278	17,831,413
未払利息	42	-
流動負債合計	47,055,820	214,487,453
負債合計		
47,055,820		
純資産の部		
元本等		
元本	22,068,149,455	21,979,468,365
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	31,233,649,582	40,560,413,383
元本等合計	53,301,799,037	62,539,881,748
純資産合計		
53,301,799,037		
負債純資産合計		
53,348,854,857		
62,754,369,201		

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
1.	期首	2022年11月 8日	2023年11月 7日
	期首元本額	22,926,701,557円	22,068,149,455円
	期首からの追加設定元本額	1,858,025,433円	2,870,263,745円
	期首からの一部解約元本額	2,716,577,535円	2,958,944,835円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	755,738,246円	728,847,667円
	DCインデックスバランス（株式40）	2,089,899,653円	2,052,607,854円
	DCインデックスバランス（株式60）	4,435,189,354円	4,607,508,315円
	DCインデックスバランス（株式80）	5,263,753,438円	5,933,248,779円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,836,216,644円	1,946,857,824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	2,697,793,534円	2,251,785,274円

	2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
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）	1,080,203円	2,577,917円
Ni つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	580,812円	1,402,475円
Ni つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	323,980円	592,331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）	209,312,833円	180,906,001円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	606,085,095円	565,181,303円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	961,417,051円	928,199,296円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	964,583,529円	963,580,169円
計	22,068,149,455円	21,979,468,365円
2. 受益権の総数	22,068,149,455口	21,979,468,365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	736,825,000円	734,851,500円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2022年11月 8日 至 2023年11月 6日	自 2023年11月 7日 至 2024年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、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11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（2024年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,300,978,373
合計	1,300,978,373

(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11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	615,933,900	-	637,470,000	21,536,100
	合計	615,933,900	-	637,470,000	21,536,100

（2024年11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	726,335,800	-	736,020,000	9,684,200
	合計	726,335,800	-	736,020,000	9,684,200

（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11月 6日現在		2024年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	2.4153円	1口当たり純資産額	2.8454円
(1万口当たり純資産額)	(24,153円)	(1万口当たり純資産額)	(28,454円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

（単位：円）

		評価額

銘柄	株式数	単価	金額	備考
極洋	900	4,035.00	3,631,500	
ニッセイ	22,200	913.40	20,277,480	
マルハニチロ	3,300	2,922.00	9,642,600	
雪国まいたけ	1,900	1,039.00	1,974,100	
カネコ種苗	700	1,381.00	966,700	
サカタのタネ	2,500	3,480.00	8,700,000	
ホクト	2,000	1,815.00	3,630,000	
ホクリヨウ	100	1,044.00	104,400	
住石ホールディングス	2,500	1,069.00	2,672,500	
日鉄鉱業	900	4,445.00	4,000,500	
I N P E X	67,300	2,020.00	135,946,000	
石油資源開発	12,200	1,135.00	13,847,000	
K & O エナジーグループ	1,000	3,090.00	3,090,000	
ショーボンドホールディングス	2,900	5,324.00	15,439,600	
ミライト・ワン	7,300	2,222.00	16,220,600	
タマホーム	1,400	3,800.00	5,320,000	
日本アクア	200	805.00	161,000	
キャンディル	100	531.00	53,100	
ダイセキ環境ソリューション	100	1,195.00	119,500	
第一カッター興業	600	1,492.00	895,200	
安藤・間	12,900	1,125.00	14,512,500	
東急建設	7,000	690.00	4,830,000	
コムシスホールディングス	7,900	3,149.00	24,877,100	
ビーアールホールディングス	3,300	346.00	1,141,800	
高松コンストラクショングループ	1,700	2,895.00	4,921,500	
東建コーポレーション	600	10,600.00	6,360,000	
ヤマウラ	1,100	1,200.00	1,320,000	
オリエンタル白石	8,200	379.00	3,107,800	
大成建設	14,100	6,485.00	91,438,500	
大林組	51,400	1,905.00	97,917,000	
清水建設	44,200	989.10	43,718,220	
長谷工コーポレーション	14,300	1,833.00	26,211,900	
松井建設	1,500	823.00	1,234,500	
鹿島建設	34,500	2,660.00	91,770,000	
不動テトラ	1,000	2,062.00	2,062,000	
鉄建建設	1,000	2,382.00	2,382,000	
西松建設	2,500	5,104.00	12,760,000	
三井住友建設	12,500	388.00	4,850,000	
大豊建設	400	3,450.00	1,380,000	
奥村組	2,800	4,305.00	12,054,000	
東鉄工業	1,700	3,210.00	5,457,000	

イチケン	100	2,521.00	252,100
浅沼組	6,200	658.00	4,079,600
戸田建設	19,100	929.90	17,761,090
熊谷組	2,600	3,485.00	9,061,000
植木組	100	1,500.00	150,000
矢作建設工業	2,100	1,533.00	3,219,300
ピーエス・コンストラクション	1,100	986.00	1,084,600
日本ハウスホールディングス	3,300	322.00	1,062,600
新日本建設	2,200	1,555.00	3,421,000
東亜道路工業	2,700	1,261.00	3,404,700
日本道路	1,600	1,635.00	2,616,000
東亜建設工業	4,700	963.00	4,526,100
日本国土開発	4,400	518.00	2,279,200
若築建設	500	3,565.00	1,782,500
東洋建設	4,500	1,313.00	5,908,500
五洋建設	20,400	636.10	12,976,440
世紀東急工業	2,200	1,497.00	3,293,400
福田組	600	5,570.00	3,342,000
住友林業	13,500	5,658.00	76,383,000
巴コーポレーション	400	864.00	345,600
大和ハウス工業	47,000	4,566.00	214,602,000
ライト工業	3,200	2,195.00	7,024,000
積水ハウス	47,200	3,667.00	173,082,400
日特建設	1,500	1,024.00	1,536,000
北陸電気工事	1,100	1,106.00	1,216,600
ユアテック	3,000	1,455.00	4,365,000
日本リーテック	1,200	1,077.00	1,292,400
四電工	2,000	1,470.00	2,940,000
中電工	2,400	3,400.00	8,160,000
関電工	8,500	2,163.00	18,385,500
きんでん	10,800	3,056.00	33,004,800
東京エネシス	1,600	1,069.00	1,710,400
トーエネック	2,600	927.00	2,410,200
住友電設	1,300	4,775.00	6,207,500
日本電設工業	2,900	1,837.00	5,327,300
エクシオグループ	16,500	1,545.50	25,500,750
新日本空調	1,000	3,505.00	3,505,000
九電工	3,400	5,526.00	18,788,400
三機工業	3,200	2,411.00	7,715,200
日揮ホールディングス	15,400	1,365.50	21,028,700
中外炉工業	500	2,888.00	1,444,000
ヤマト	300	960.00	288,000

太平電業	1,000	5,080.00	5,080,000
高砂熱学工業	3,700	5,413.00	20,028,100
朝日工業社	1,400	1,324.00	1,853,600
明星工業	2,700	1,334.00	3,601,800
大気社	2,000	4,910.00	9,820,000
ダイダン	2,000	3,265.00	6,530,000
日比谷総合設備	1,300	3,560.00	4,628,000
飛島ホールディングス	1,600	1,517.00	2,427,200
テスホールディングス	3,400	270.00	918,000
インフロニア・ホールディングス	16,300	1,137.50	18,541,250
東洋エンジニアリング	2,300	752.00	1,729,600
レイズネクスト	2,200	1,565.00	3,443,000
ニッポン	5,200	2,166.00	11,263,200
日清製粉グループ本社	16,300	1,810.50	29,511,150
日東富士製粉	300	6,770.00	2,031,000
昭和産業	1,300	2,825.00	3,672,500
中部飼料	2,200	1,361.00	2,994,200
フィード・ワン	2,300	850.00	1,955,000
東洋精糖	100	1,372.00	137,200
日本甜菜製糖	800	2,512.00	2,009,600
D M三井製糖ホールディングス	1,500	3,195.00	4,792,500
塩水港精糖	500	274.00	137,000
ウェルネオシュガー	900	2,226.00	2,003,400
森永製菓	6,500	2,771.00	18,011,500
中村屋	400	3,255.00	1,302,000
江崎グリコ	4,500	4,391.00	19,759,500
名糖産業	700	1,822.00	1,275,400
井村屋グループ	900	2,427.00	2,184,300
不二家	1,100	2,658.00	2,923,800
山崎製パン	10,500	2,924.50	30,707,250
モロゾフ	500	4,640.00	2,320,000
亀田製菓	1,000	4,340.00	4,340,000
寿スピリッツ	9,200	2,049.50	18,855,400
カルビー	7,200	3,198.00	23,025,600
森永乳業	6,000	3,393.00	20,358,000
六甲バター	1,100	1,423.00	1,565,300
ヤクルト本社	22,400	3,290.00	73,696,000
明治ホールディングス	20,900	3,483.00	72,794,700
雪印メグミルク	4,200	2,566.00	10,777,200
プリマハム	2,100	2,207.00	4,634,700
日本ハム	6,700	4,760.00	31,892,000
林兼産業	200	461.00	92,200

丸大食品	1,600	1,653.00	2,644,800
S Foods	1,700	2,752.00	4,678,400
柿安本店	600	2,670.00	1,602,000
伊藤ハム米久ホールディングス	2,400	3,770.00	9,048,000
サッポロホールディングス	5,100	7,131.00	36,368,100
アサヒグループホールディングス	117,400	1,793.00	210,498,200
キリンホールディングス	65,100	2,199.00	143,154,900
シマダヤ	600	1,439.00	863,400
宝ホールディングス	10,500	1,197.50	12,573,750
オエノンホールディングス	5,000	418.00	2,090,000
養命酒製造	500	2,496.00	1,248,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,000	1,943.00	21,373,000
ライフドリンク カンパニー	3,400	1,789.00	6,082,600
サントリー食品インターナショナル	11,000	5,064.00	55,704,000
ダイドーグループホールディングス	1,800	3,070.00	5,526,000
伊藤園	5,200	3,311.00	17,217,200
キーコーヒー	1,700	2,013.00	3,422,100
ユニカフェ	100	935.00	93,500
日清オイリオグループ	2,200	5,060.00	11,132,000
不二製油グループ本社	3,100	3,145.00	9,749,500
J - オイルミルズ	1,800	2,064.00	3,715,200
キッコーマン	51,800	1,802.50	93,369,500
味の素	36,700	5,839.00	214,291,300
ブルドックソース	800	1,803.00	1,442,400
キューピー	8,400	3,547.00	29,794,800
ハウス食品グループ本社	5,300	2,887.50	15,303,750
カゴメ	6,700	3,020.00	20,234,000
アリアケジャパン	1,600	5,190.00	8,304,000
エバラ食品工業	400	2,980.00	1,192,000
ニチレイ	6,400	4,156.00	26,598,400
東洋水産	7,200	8,906.00	64,123,200
イトアンドホールディングス	800	2,136.00	1,708,800
大冷	100	1,897.00	189,700
ヨシムラ・フード・ホールディングス	900	1,368.00	1,231,200
日清食品ホールディングス	20,200	4,023.00	81,264,600
フジッコ	1,600	1,727.00	2,763,200
ロック・フィールド	1,900	1,451.00	2,756,900
日本たばこ産業	95,000	4,123.00	391,685,000
ケンコーマヨネーズ	1,000	2,184.00	2,184,000
わらべや日洋ホールディングス	1,000	2,023.00	2,023,000
なとり	1,000	2,120.00	2,120,000
イフジ産業	100	1,545.00	154,500

ファーマフーズ	2,100	985.00	2,068,500
ユーグレナ	9,800	408.00	3,998,400
紀文食品	1,400	1,096.00	1,534,400
ピクルスホールディングス	900	1,059.00	953,100
理研ビタミン	1,300	2,678.00	3,481,400
片倉工業	1,500	2,015.00	3,022,500
グンゼ	1,100	5,060.00	5,566,000
東洋紡	6,900	973.00	6,713,700
ユニチカ	5,400	289.00	1,560,600
富士紡ホールディングス	600	4,780.00	2,868,000
倉敷紡績	1,100	4,675.00	5,142,500
シキボウ	1,200	1,005.00	1,206,000
日本毛織	4,100	1,275.00	5,227,500
ダイドーリミテッド	400	855.00	342,000
帝国繊維	1,800	2,672.00	4,809,600
帝人	15,300	1,371.00	20,976,300
東レ	116,300	845.50	98,331,650
住江織物	100	2,061.00	206,100
セーレン	3,100	2,583.00	8,007,300
小松マテーレ	2,300	782.00	1,798,600
ワコールホールディングス	3,300	4,621.00	15,249,300
ホギメディカル	2,100	4,600.00	9,660,000
クラウディアホールディングス	300	331.00	99,300
T S Iホールディングス	5,300	882.00	4,674,600
マツオカコーポレーション	100	1,800.00	180,000
ワールド	2,500	1,903.00	4,757,500
三陽商会	800	2,599.00	2,079,200
オンワードホールディングス	10,400	520.00	5,408,000
ルックホールディングス	500	2,530.00	1,265,000
ゴールドウイン	2,800	7,829.00	21,921,200
デサント	2,700	4,330.00	11,691,000
特種東海製紙	800	3,695.00	2,956,000
王子ホールディングス	60,200	572.50	34,464,500
日本製紙	8,200	891.00	7,306,200
三菱製紙	400	491.00	196,400
北越コーポレーション	8,900	1,542.00	13,723,800
中越パルプ工業	100	1,232.00	123,200
大王製紙	8,000	869.00	6,952,000
レンゴー	14,400	889.00	12,801,600
トモク	900	2,286.00	2,057,400
ザ・パック	1,200	3,740.00	4,488,000
北の達人コーポレーション	6,700	158.00	1,058,600

クラレ	23,200	2,092.00	48,534,400	
旭化成	107,600	1,117.50	120,243,000	
レゾナック・ホールディングス	14,300	3,698.00	52,881,400	
住友化学	128,000	399.50	51,136,000	
住友精化	700	5,090.00	3,563,000	
日産化学	8,200	5,287.00	43,353,400	
ラサ工業	600	2,756.00	1,653,600	
クレハ	3,300	2,823.00	9,315,900	
多木化学	600	3,655.00	2,193,000	
テイカ	1,100	1,619.00	1,780,900	
石原産業	2,600	1,498.00	3,894,800	
日本曹達	3,400	2,530.00	8,602,000	
東ソー	21,200	2,083.00	44,159,600	
トクヤマ	5,100	2,737.00	13,958,700	
セントラル硝子	2,000	3,460.00	6,920,000	
東亜合成	7,600	1,535.00	11,666,000	
大阪ソーダ	5,600	1,647.00	9,223,200	
関東電化工業	3,400	986.00	3,352,400	
デンカ	5,800	2,170.50	12,588,900	
信越化学工業	142,600	5,866.00	836,491,600	代用有価証券 24,000株
日本カーバイド工業	900	1,652.00	1,486,800	
堺化学工業	1,100	2,816.00	3,097,600	
第一稀元素化学工業	1,800	746.00	1,342,800	
エア・ウォーター	15,000	1,897.00	28,455,000	
日本酸素ホールディングス	15,400	5,046.00	77,708,400	
日本化学工業	600	2,611.00	1,566,600	
東邦アセチレン	400	346.00	138,400	
日本パーカラライジング	7,100	1,301.00	9,237,100	
高压ガス工業	2,300	904.00	2,079,200	
四国化成ホールディングス	1,800	2,170.00	3,906,000	
戸田工業	400	1,711.00	684,400	
ステラ ケミファ	900	4,410.00	3,969,000	
保土谷化学工業	500	4,370.00	2,185,000	
日本触媒	10,200	1,692.50	17,263,500	
大日精化工業	1,100	2,931.00	3,224,100	
カネカ	3,900	3,708.00	14,461,200	
三菱瓦斯化学	12,900	2,667.50	34,410,750	
三井化学	14,300	3,591.00	51,351,300	
東京応化工業	7,600	3,619.00	27,504,400	
大阪有機化学工業	1,300	2,967.00	3,857,100	
三菱ケミカルグループ	116,300	848.80	98,715,440	
KHネオケム	2,900	2,079.00	6,029,100	

ダイセル	18,100	1,371.50	24,824,150
住友ベークライト	5,000	4,016.00	20,080,000
積水化学工業	31,700	2,325.00	73,702,500
日本ゼオン	12,200	1,453.50	17,732,700
アイカ工業	4,000	3,370.00	13,480,000
U B E	8,200	2,509.00	20,573,800
積水樹脂	2,200	2,273.00	5,000,600
旭有機材	1,100	4,195.00	4,614,500
ニチバン	1,000	1,922.00	1,922,000
リケンテクノス	3,000	1,058.00	3,174,000
大倉工業	700	2,721.00	1,904,700
積水化成成品工業	2,600	367.00	954,200
群栄化学工業	400	2,777.00	1,110,800
タイガースポリマー	200	724.00	144,800
ダイキョーニシカワ	3,500	636.00	2,226,000
森六ホールディングス	900	2,311.00	2,079,900
恵和	1,000	1,032.00	1,032,000
日本化薬	11,100	1,195.50	13,270,050
カーリット	1,600	1,312.00	2,099,200
日本精化	1,100	2,417.00	2,658,700
扶桑化学工業	1,500	3,625.00	5,437,500
トリケミカル研究所	1,700	3,060.00	5,202,000
A D E K A	5,500	2,793.00	15,361,500
日油	18,700	2,544.00	47,572,800
ハリマ化成グループ	1,200	874.00	1,048,800
花王	38,700	6,511.00	251,975,700
第一工業製薬	600	3,765.00	2,259,000
石原ケミカル	700	2,259.00	1,581,300
三洋化成工業	1,000	4,125.00	4,125,000
大日本塗料	1,800	1,015.00	1,827,000
日本ペイントホールディングス	70,400	1,106.50	77,897,600
関西ペイント	13,300	2,425.00	32,252,500
中国塗料	3,600	2,535.00	9,126,000
日本特殊塗料	300	1,172.00	351,600
藤倉化成	2,000	486.00	972,000
太陽ホールディングス	2,800	4,060.00	11,368,000
D I C	5,600	3,253.00	18,216,800
サカタインクス	3,500	1,553.00	5,435,500
a r t i e n c e	2,800	3,685.00	10,318,000
富士フイルムホールディングス	96,000	3,637.00	349,152,000
資生堂	33,300	3,118.00	103,829,400
ライオン	20,300	1,655.50	33,606,650

高砂香料工業	1,100	5,020.00	5,522,000
マンダム	3,200	1,225.00	3,920,000
ミルボン	2,600	3,185.00	8,281,000
ファンケル	3,800	2,792.00	10,609,600
コーセー	3,200	7,998.00	25,593,600
コタ	1,600	1,636.00	2,617,600
ポーラ・オルビスホールディングス	8,200	1,463.00	11,996,600
ノエビアホールディングス	1,400	5,080.00	7,112,000
新日本製薬	900	1,715.00	1,543,500
I - n e	500	2,057.00	1,028,500
アクシージア	1,300	580.00	754,000
エステー	1,300	1,479.00	1,922,700
アグロ カネショウ	700	1,320.00	924,000
コニシ	5,000	1,348.00	6,740,000
長谷川香料	3,000	3,320.00	9,960,000
小林製薬	4,200	5,572.00	23,402,400
荒川化学工業	1,500	1,190.00	1,785,000
メック	1,300	3,530.00	4,589,000
日本高純度化学	400	3,175.00	1,270,000
タカラバイオ	5,000	1,030.00	5,150,000
J C U	1,800	3,495.00	6,291,000
O A Tアグリオ	700	1,848.00	1,293,600
デクセリアルズ	13,900	2,470.00	34,333,000
アース製薬	1,400	5,190.00	7,266,000
北興化学工業	1,400	1,284.00	1,797,600
大成ラミック	500	2,561.00	1,280,500
クミアイ化学工業	6,300	817.00	5,147,100
日本農薬	2,400	662.00	1,588,800
アキレス	900	1,514.00	1,362,600
有沢製作所	2,400	1,396.00	3,350,400
日東電工	50,400	2,580.50	130,057,200
レック	2,000	1,297.00	2,594,000
三光合成	2,000	607.00	1,214,000
Z A C R O S	1,300	4,270.00	5,551,000
前澤化成工業	1,100	1,806.00	1,986,600
未来工業	600	3,615.00	2,169,000
J S P	1,300	1,943.00	2,525,900
エフピコ	3,500	2,632.00	9,212,000
天馬	1,300	2,849.00	3,703,700
信越ポリマー	3,400	1,652.00	5,616,800
東リ	800	462.00	369,600
ニフコ	5,900	3,650.00	21,535,000

バルカー	1,200	3,295.00	3,954,000
ユニ・チャーム	33,200	4,760.00	158,032,000
協和キリン	19,300	2,572.00	49,639,600
武田薬品工業	141,700	4,282.00	606,759,400
アステラス製薬	139,700	1,743.00	243,497,100
住友ファーマ	14,200	590.00	8,378,000
塩野義製薬	52,800	2,148.00	113,414,400
日本新薬	4,200	4,097.00	17,207,400
中外製薬	49,800	7,229.00	360,004,200
科研製薬	2,700	3,862.00	10,427,400
エーザイ	21,100	5,058.00	106,723,800
ロート製薬	16,800	3,401.00	57,136,800
小野薬品工業	32,600	1,935.00	63,081,000
久光製薬	3,500	4,438.00	15,533,000
持田製薬	2,000	3,265.00	6,530,000
参天製薬	30,300	1,784.00	54,055,200
扶桑薬品工業	600	2,630.00	1,578,000
ツムラ	5,500	4,920.00	27,060,000
キッセイ薬品工業	2,600	3,685.00	9,581,000
生化学工業	3,100	853.00	2,644,300
栄研化学	2,500	2,207.00	5,517,500
鳥居薬品	800	4,200.00	3,360,000
JCRファーマ	5,400	705.00	3,807,000
東和薬品	2,100	3,120.00	6,552,000
富士製薬工業	1,200	1,293.00	1,551,600
ゼリア新薬工業	2,500	2,372.00	5,930,000
ネクセラファーマ	7,500	1,200.00	9,000,000
第一三共	150,300	4,838.00	727,151,400
杏林製薬	3,500	1,510.00	5,285,000
大幸薬品	3,700	376.00	1,391,200
ダイト	1,200	2,205.00	2,646,000
大塚ホールディングス	39,700	9,611.00	381,556,700
ペプチドリーム	7,700	2,853.50	21,971,950
セルソース	1,100	1,191.00	1,310,100
あすか製薬ホールディングス	1,500	2,123.00	3,184,500
サワイグループホールディングス	9,400	1,996.50	18,767,100
日本コークス工業	16,300	96.00	1,564,800
ニチレキグループ	1,700	2,461.00	4,183,700
ユシロ化学工業	800	1,542.00	1,233,600
ビーピー・カストロール	200	867.00	173,400
富士石油	4,300	336.00	1,444,800
MORESCO	200	1,221.00	244,200

出光興産	74,400	1,032.00	76,780,800
E N E O Sホールディングス	270,100	775.20	209,381,520
コスモエネルギーホールディングス	5,200	7,452.00	38,750,400
横浜ゴム	8,100	3,122.00	25,288,200
TOYO TIRE	9,100	2,176.00	19,801,600
ブリヂストン	46,600	5,540.00	258,164,000
住友ゴム工業	15,600	1,574.00	24,554,400
藤倉コンポジット	1,500	1,229.00	1,843,500
オカモト	800	5,230.00	4,184,000
フコク	1,000	1,777.00	1,777,000
ニッタ	1,600	3,695.00	5,912,000
住友理工	3,100	1,603.00	4,969,300
三ツ星ベルト	2,200	3,965.00	8,723,000
バンドー化学	2,400	1,803.00	4,327,200
日東紡績	1,800	6,530.00	11,754,000
A G C	15,500	4,783.00	74,136,500
日本板硝子	7,900	370.00	2,923,000
日本山村硝子	100	1,551.00	155,100
日本電気硝子	5,900	3,418.00	20,166,200
オハラ	700	1,285.00	899,500
住友大阪セメント	2,800	3,674.00	10,287,200
太平洋セメント	9,800	3,386.00	33,182,800
日本ヒューム	1,300	1,255.00	1,631,500
日本コンクリート工業	2,900	330.00	957,000
三谷セキサン	700	6,400.00	4,480,000
アジアパイルホールディングス	2,200	805.00	1,771,000
東海カーボン	14,600	883.20	12,894,720
日本カーボン	900	4,480.00	4,032,000
東洋炭素	1,100	5,380.00	5,918,000
ノリタケ	1,700	3,945.00	6,706,500
T O T O	11,500	4,382.00	50,393,000
日本碍子	18,500	2,005.00	37,092,500
日本特殊陶業	13,000	4,845.00	62,985,000
M A R U W A	700	47,000.00	32,900,000
品川リフラクトリーズ	1,900	1,791.00	3,402,900
黒崎播磨	1,100	2,461.00	2,707,100
ヨータイ	800	1,660.00	1,328,000
フジミインコーポレーテッド	4,300	2,468.00	10,612,400
ニチアス	4,000	5,583.00	22,332,000
ニチハ	2,000	3,435.00	6,870,000
日本製鉄	82,900	3,108.00	257,653,200
神戸製鋼所	32,900	1,690.50	55,617,450

中山製鋼所	3,400	756.00	2,570,400
合同製鐵	900	3,995.00	3,595,500
J F E ホールディングス	49,400	1,862.00	91,982,800
東京製鐵	4,600	1,517.00	6,978,200
共英製鋼	1,600	1,742.00	2,787,200
大和工業	3,100	7,800.00	24,180,000
東京鐵鋼	700	6,270.00	4,389,000
大阪製鐵	800	3,005.00	2,404,000
淀川製鋼所	1,500	5,370.00	8,055,000
中部鋼板	1,100	2,350.00	2,585,000
丸一鋼管	5,000	3,360.00	16,800,000
モリ工業	400	5,040.00	2,016,000
大同特殊鋼	10,300	1,187.50	12,231,250
日本高周波鋼業	200	386.00	77,200
日本冶金工業	1,100	4,105.00	4,515,500
山陽特殊製鋼	1,600	1,873.00	2,996,800
愛知製鋼	900	4,560.00	4,104,000
大平洋金属	1,500	1,386.00	2,079,000
新日本電工	9,700	293.00	2,842,100
栗本鐵工所	700	4,165.00	2,915,500
三菱製鋼	1,200	1,356.00	1,627,200
日本精線	1,300	1,277.00	1,660,100
エンビプロ・ホールディングス	1,800	498.00	896,400
新家工業	100	4,480.00	448,000
大紀アルミニウム工業所	2,400	1,083.00	2,599,200
日本軽金属ホールディングス	4,800	1,544.00	7,411,200
三井金属鉱業	4,100	4,792.00	19,647,200
三菱マテリアル	11,700	2,523.00	29,519,100
住友金属鉱山	20,700	4,335.00	89,734,500
D O W A ホールディングス	4,400	5,226.00	22,994,400
古河機械金属	2,200	1,672.00	3,678,400
エス・サイエンス	5,300	22.00	116,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,900	2,217.00	6,429,300
東邦チタニウム	3,400	1,025.00	3,485,000
U A C J	2,300	4,905.00	11,281,500
C K サンエツ	400	3,690.00	1,476,000
古河電気工業	5,500	3,825.00	21,037,500
住友電気工業	56,600	2,673.50	151,320,100
フジクラ	17,600	5,770.00	101,552,000
S W C C	2,200	5,450.00	11,990,000
カナレ電気	100	1,420.00	142,000
平河ヒューテック	1,100	1,573.00	1,730,300

リヨービ	1,800	1,917.00	3,450,600
アーレスティ	500	561.00	280,500
A R Eホールディングス	6,600	1,828.00	12,064,800
稲葉製作所	900	1,780.00	1,602,000
宮地エンジニアリンググループ	2,000	1,970.00	3,940,000
トーカロ	4,700	1,850.00	8,695,000
S U M C O	31,200	1,495.00	46,644,000
川田テクノロジーズ	1,100	2,453.00	2,698,300
R S T e c h n o l o g i e s	1,300	3,945.00	5,128,500
信和	300	734.00	220,200
東洋製罐グループホールディングス	10,400	2,274.50	23,654,800
ホッカンホールディングス	900	1,726.00	1,553,400
コロナ	1,100	935.00	1,028,500
横河ブリッジホールディングス	2,800	2,752.00	7,705,600
三和ホールディングス	16,300	4,500.00	73,350,000
文化シャッター	4,300	1,850.00	7,955,000
三協立山	2,100	762.00	1,600,200
アルインコ	1,300	969.00	1,259,700
東洋シャッター	100	781.00	78,100
L I X I L	23,900	1,755.50	41,956,450
ノーリツ	2,300	1,776.00	4,084,800
長府製作所	1,800	1,955.00	3,519,000
リンナイ	8,700	3,356.00	29,197,200
日東精工	2,400	592.00	1,420,800
岡部	2,900	791.00	2,293,900
ジーテクト	1,800	1,574.00	2,833,200
東プレ	2,900	1,762.00	5,109,800
高周波熱錬	2,400	997.00	2,392,800
東京製綱	1,000	1,150.00	1,150,000
サンコール	2,200	406.00	893,200
パイオラックス	2,200	2,429.00	5,343,800
エイチワン	1,700	923.00	1,569,100
日本発條	14,500	1,843.50	26,730,750
中央発條	1,100	1,259.00	1,384,900
立川ブラインド工業	700	1,335.00	934,500
日本ドライケミカル	100	3,430.00	343,000
日本製綱所	4,900	5,483.00	26,866,700
三浦工業	7,400	3,560.00	26,344,000
タクマ	5,400	1,591.00	8,591,400
ツガミ	3,400	1,425.00	4,845,000
オークマ	2,800	3,340.00	9,352,000
芝浦機械	2,100	3,720.00	7,812,000

アマダ	22,300	1,550.00	34,565,000
アイダエンジニアリング	3,600	795.00	2,862,000
F U J I	7,000	2,322.50	16,257,500
牧野フライス製作所	1,800	6,800.00	12,240,000
オーエスジー	7,100	1,814.00	12,879,400
旭ダイヤモンド工業	4,000	850.00	3,400,000
D M G 森精機	10,100	2,726.00	27,532,600
ソディック	4,200	776.00	3,259,200
ディスコ	7,700	46,750.00	359,975,000
日東工器	600	2,702.00	1,621,200
日進工具	1,300	747.00	971,100
富士ダイス	1,200	785.00	942,000
リケンNPR	2,000	2,343.00	4,686,000
島精機製作所	2,500	1,109.00	2,772,500
オプトラン	2,600	1,945.00	5,057,000
イワキポンプ	1,100	3,005.00	3,305,500
フリュー	1,500	1,095.00	1,642,500
ヤマシンフィルタ	3,400	587.00	1,995,800
日阪製作所	1,900	973.00	1,848,700
やまびこ	2,600	2,468.00	6,416,800
野村マイクロ・サイエンス	2,600	2,158.00	5,610,800
平田機工	800	5,020.00	4,016,000
P E G A S U S	2,100	448.00	940,800
マルマエ	700	1,723.00	1,206,100
タツモ	1,100	3,565.00	3,921,500
ナブテスコ	10,100	2,477.50	25,022,750
三井海洋開発	2,000	3,450.00	6,900,000
レオン自動機	1,700	1,434.00	2,437,800
S M C	4,800	68,720.00	329,856,000
ホソカワミクロン	1,100	4,010.00	4,411,000
ユニオンツール	700	6,980.00	4,886,000
瑞光	1,000	1,316.00	1,316,000
オイレス工業	2,200	1,981.00	4,358,200
日精エー・エス・ビー機械	500	4,655.00	2,327,500
サトーホールディングス	2,000	2,130.00	4,260,000
技研製作所	1,500	1,733.00	2,599,500
日本エアテック	700	1,199.00	839,300
日精樹脂工業	1,100	935.00	1,028,500
オカダアイヨン	100	2,082.00	208,200
ワイエイシイホールディングス	800	2,165.00	1,732,000
小松製作所	80,900	4,217.00	341,155,300
住友重機械工業	9,500	3,385.00	32,157,500

日立建機	6,400	3,520.00	22,528,000
日工	2,400	695.00	1,668,000
巴工業	600	3,810.00	2,286,000
井関農機	1,500	996.00	1,494,000
TOWA	4,900	2,059.00	10,089,100
北川鉄工所	700	1,239.00	867,300
ローツェ	8,400	2,277.00	19,126,800
タカキタ	200	393.00	78,600
クボタ	83,800	2,010.00	168,438,000
荏原実業	800	4,415.00	3,532,000
三菱化工機	600	3,195.00	1,917,000
月島ホールディングス	2,200	1,367.00	3,007,400
帝国電機製作所	1,100	2,860.00	3,146,000
新東工業	3,600	1,026.00	3,693,600
澁谷工業	1,500	3,695.00	5,542,500
アイチ コーポレーション	2,600	1,179.00	3,065,400
小森コーポレーション	3,900	1,106.00	4,313,400
鶴見製作所	1,200	4,160.00	4,992,000
酒井重工業	600	2,467.00	1,480,200
荏原製作所	32,900	2,399.00	78,927,100
西島製作所	1,400	2,839.00	3,974,600
北越工業	1,600	1,890.00	3,024,000
ダイキン工業	20,900	18,790.00	392,711,000
オルガノ	2,500	8,470.00	21,175,000
トーヨーカネツ	600	4,420.00	2,652,000
栗田工業	9,000	5,743.00	51,687,000
椿本チエイン	7,300	1,913.00	13,964,900
木村化工機	1,200	768.00	921,600
アネスト岩田	2,700	1,415.00	3,820,500
ダイフク	27,100	2,954.00	80,053,400
サムコ	400	3,305.00	1,322,000
加藤製作所	200	1,248.00	249,600
タダノ	9,200	995.30	9,156,760
フジテック	5,200	5,533.00	28,771,600
C K D	4,400	2,682.00	11,800,800
平和	5,300	2,071.00	10,976,300
理想科学工業	1,300	3,560.00	4,628,000
SANKYO	18,500	2,060.00	38,110,000
日本金銭機械	1,900	916.00	1,740,400
マースグループホールディングス	1,100	3,200.00	3,520,000
フクシマガリレイ	1,200	5,480.00	6,576,000
オーイズミ	200	358.00	71,600

ダイコク電機	700	3,400.00	2,380,000
竹内製作所	2,900	5,070.00	14,703,000
アマノ	4,500	4,341.00	19,534,500
J U K I	2,500	406.00	1,015,000
ジャノメ	1,400	891.00	1,247,400
マックス	2,000	3,325.00	6,650,000
グローリー	4,200	2,501.00	10,504,200
新晃工業	1,600	4,440.00	7,104,000
大和冷機工業	2,400	1,466.00	3,518,400
セガサミーホールディングス	14,300	2,959.00	42,313,700
T P R	2,000	2,326.00	4,652,000
ツバキ・ナカシマ	3,900	693.00	2,702,700
ホシザキ	10,300	4,967.00	51,160,100
大豊工業	1,600	619.00	990,400
日本精工	29,700	688.60	20,451,420
N T N	38,000	252.80	9,606,400
ジェイテクト	14,300	1,080.00	15,444,000
不二越	1,200	3,210.00	3,852,000
日本トムソン	4,300	496.00	2,132,800
T H K	9,200	2,602.00	23,938,400
ユーシン精機	1,500	662.00	993,000
前澤給装工業	1,200	1,253.00	1,503,600
イーグル工業	1,800	2,008.00	3,614,400
前澤工業	200	1,184.00	236,800
P I L L A R	1,500	4,400.00	6,600,000
キッツ	5,400	1,059.00	5,718,600
マキタ	20,000	4,895.00	97,900,000
三井E & S	8,600	1,156.00	9,941,600
カナデビア	13,100	1,081.00	14,161,100
三菱重工業	280,400	2,263.00	634,545,200
I H I	12,900	9,280.00	119,712,000
スター精密	2,700	1,979.00	5,343,300
日清紡ホールディングス	12,000	969.60	11,635,200
イビデン	9,200	5,200.00	47,840,000
コニカミノルタ	35,800	666.30	23,853,540
ブラザー工業	21,400	3,040.00	65,056,000
ミネベアミツミ	27,900	2,858.00	79,738,200
日立製作所	412,900	3,791.00	1,565,303,900
三菱電機	163,100	2,729.50	445,181,450
富士電機	9,800	8,639.00	84,662,200
安川電機	17,400	4,603.00	80,092,200
シンフォニアテクノロジー	1,600	5,360.00	8,576,000

明電舎	2,700	3,950.00	10,665,000
山洋電気	700	8,800.00	6,160,000
デンヨー	1,200	2,603.00	3,123,600
PHCホールディングス	3,000	1,000.00	3,000,000
KOKUSAI ELECTRIC	11,200	2,952.00	33,062,400
ソシオネクスト	16,000	2,602.00	41,632,000
東芝テック	2,400	3,570.00	8,568,000
芝浦メカトロニクス	1,200	11,050.00	13,260,000
マブチモーター	7,000	2,336.00	16,352,000
ニデック	70,800	2,993.00	211,904,400
トレックス・セミコンダクター	800	1,539.00	1,231,200
東光高岳	900	1,974.00	1,776,600
ダブル・スコープ	4,900	362.00	1,773,800
ダイヘン	1,500	6,690.00	10,035,000
ヤーマン	3,100	826.00	2,560,600
JVCケンウッド	12,600	1,275.00	16,065,000
ミマキエンジニアリング	1,300	1,462.00	1,900,600
I-PEX	900	1,565.00	1,408,500
大崎電気工業	3,500	752.00	2,632,000
オムロン	14,700	5,928.00	87,141,600
日東工業	2,200	2,925.00	6,435,000
IDEC	2,400	2,624.00	6,297,600
正興電機製作所	100	1,236.00	123,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	7,100	2,835.00	20,128,500
サクサ	100	2,406.00	240,600
メルコホールディングス	400	2,352.00	940,800
テクノメディカ	400	1,778.00	711,200
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	900	602.00	541,800
日本電気	22,700	13,160.00	298,732,000
富士通	147,600	2,801.50	413,501,400
沖電気工業	7,800	1,005.00	7,839,000
電気興業	700	1,900.00	1,330,000
サンケン電気	1,600	5,917.00	9,467,200
アイホン	1,000	2,847.00	2,847,000
ルネサスエレクトロニクス	122,200	2,040.50	249,349,100
セイコーエプソン	20,600	2,825.50	58,205,300
ワコム	11,300	708.00	8,000,400
アルバック	3,500	7,361.00	25,763,500
アクセル	800	1,382.00	1,105,600
EIZO	2,100	2,296.00	4,821,600
日本信号	3,600	949.00	3,416,400
京三製作所	3,700	545.00	2,016,500

能美防災	2,200	3,030.00	6,666,000
ホーチキ	1,000	2,233.00	2,233,000
星和電機	200	514.00	102,800
エレコム	3,800	1,439.00	5,468,200
パナソニック ホールディングス	189,400	1,348.50	255,405,900
シャープ	23,100	901.00	20,813,100
アンリツ	11,300	1,188.50	13,430,050
富士通ゼネラル	4,500	1,944.00	8,748,000
ソニーグループ	556,000	2,774.50	1,542,622,000
T D K	138,500	2,075.50	287,456,750
帝国通信工業	700	2,710.00	1,897,000
タムラ製作所	6,400	560.00	3,584,000
アルプスアルパイン	13,000	1,614.00	20,982,000
日本電波工業	1,500	1,042.00	1,563,000
鈴木	900	1,825.00	1,642,500
メイコー	1,600	5,600.00	8,960,000
日本トリム	400	3,535.00	1,414,000
フォスター電機	1,600	1,780.00	2,848,000
S M K	400	2,389.00	955,600
ヨコオ	1,400	1,523.00	2,132,200
ホシデン	4,000	2,332.00	9,328,000
ヒロセ電機	2,300	18,590.00	42,757,000
日本航空電子工業	4,200	2,774.00	11,650,800
T O A	1,600	933.00	1,492,800
マクセル	3,200	1,812.00	5,798,400
古野電気	1,900	2,541.00	4,827,900
スミダコーポレーション	2,200	984.00	2,164,800
アイコム	600	2,855.00	1,713,000
リオン	700	2,427.00	1,698,900
横河電機	17,500	3,598.00	62,965,000
新電元工業	600	2,403.00	1,441,800
アズビル	43,700	1,195.50	52,243,350
東亜ディーケーケー	200	732.00	146,400
日本光電工業	14,200	2,259.50	32,084,900
チノー	700	2,145.00	1,501,500
日本電子材料	1,000	2,407.00	2,407,000
堀場製作所	3,000	9,607.00	28,821,000
アドバンテスト	50,000	9,625.00	481,250,000
エスベック	1,400	2,616.00	3,662,400
キーエンス	15,900	69,360.00	1,102,824,000
日置電機	800	8,190.00	6,552,000
シスメックス	41,100	2,849.00	117,093,900

日本マイクロニクス	2,600	3,800.00	9,880,000
メガチップス	1,200	5,520.00	6,624,000
O B A R A G R O U P	1,000	4,240.00	4,240,000
原田工業	300	540.00	162,000
コーセル	1,700	1,248.00	2,121,600
イリソ電子工業	1,600	2,923.00	4,676,800
オブテックスグループ	2,900	1,632.00	4,732,800
千代田インテグレ	600	3,330.00	1,998,000
レーザーテック	7,300	20,730.00	151,329,000
スタンレー電気	9,900	2,605.00	25,789,500
ウシオ電機	7,000	2,136.50	14,955,500
岡谷電機産業	500	227.00	113,500
日本セラミック	1,500	2,559.00	3,838,500
遠藤照明	200	1,311.00	262,200
古河電池	1,200	1,373.00	1,647,600
山一電機	1,300	2,524.00	3,281,200
図研	1,400	3,550.00	4,970,000
日本電子	3,700	5,846.00	21,630,200
カシオ計算機	12,700	1,109.50	14,090,650
ファナック	76,800	4,337.00	333,081,600
日本シイエムケイ	4,700	410.00	1,927,000
エンプラス	500	5,550.00	2,775,000
大真空	2,000	562.00	1,124,000
ローム	28,800	1,703.00	49,046,400
浜松ホトニクス	25,500	2,042.50	52,083,750
三井ハイテック	7,000	829.00	5,803,000
新光電気工業	5,600	5,417.00	30,335,200
京セラ	98,700	1,585.00	156,439,500
太陽誘電	6,900	2,739.50	18,902,550
村田製作所	141,800	2,759.00	391,226,200
双葉電子工業	3,000	513.00	1,539,000
ニチコン	4,200	1,012.00	4,250,400
日本ケミコン	2,000	1,119.00	2,238,000
K O A	2,700	1,032.00	2,786,400
市光工業	2,900	450.00	1,305,000
小糸製作所	16,400	1,979.50	32,463,800
ミツバ	3,000	861.00	2,583,000
S C R E E Nホールディングス	6,600	10,440.00	68,904,000
キャノン電子	1,500	2,408.00	3,612,000
キャノン	79,200	5,003.00	396,237,600
リコー	41,800	1,673.00	69,931,400
象印マホービン	4,700	1,599.00	7,515,300

東京エレクトロン	33,600	23,460.00	788,256,000	代用有価証券 3,000株
イノテック	1,100	1,468.00	1,614,800	
トヨタ紡織	6,700	2,024.50	13,564,150	
芦森工業	100	2,521.00	252,100	
ユニプレス	2,800	1,114.00	3,119,200	
豊田自動織機	13,500	10,785.00	145,597,500	
モリタホールディングス	2,500	2,124.00	5,310,000	
三櫻工業	2,200	735.00	1,617,000	
デンソー	168,400	2,241.50	377,468,600	
東海理化電機製作所	4,500	2,170.00	9,765,000	
川崎重工業	12,000	6,285.00	75,420,000	
名村造船所	4,500	1,690.00	7,605,000	
日本車輛製造	600	2,225.00	1,335,000	
三菱ロジスネクスト	2,500	1,205.00	3,012,500	
日産自動車	209,000	401.20	83,850,800	
いすゞ自動車	49,100	1,920.50	94,296,550	
トヨタ自動車	843,900	2,684.50	2,265,449,550	代用有価証券 45,000株
日野自動車	23,900	368.60	8,809,540	
三菱自動車工業	62,000	454.20	28,160,400	
レシップホールディングス	200	513.00	102,600	
武蔵精密工業	3,900	1,943.00	7,577,700	
日産車体	2,400	1,000.00	2,400,000	
新明和工業	4,600	1,352.00	6,219,200	
極東開発工業	2,100	2,416.00	5,073,600	
トピー工業	1,300	1,969.00	2,559,700	
ティラド	400	3,455.00	1,382,000	
曙ブレーキ工業	9,700	118.00	1,144,600	
タチエス	2,900	1,778.00	5,156,200	
N O K	6,200	2,196.00	13,615,200	
フタバ産業	4,800	648.00	3,110,400	
カヤバ	1,300	4,745.00	6,168,500	
大同メタル工業	3,100	488.00	1,512,800	
プレス工業	6,200	543.00	3,366,600	
ミクニ	500	324.00	162,000	
太平洋工業	3,600	1,364.00	4,910,400	
アイシン	33,600	1,644.50	55,255,200	
マツダ	48,800	1,062.50	51,850,000	
本田技研工業	376,200	1,418.00	533,451,600	
スズキ	128,300	1,504.00	192,963,200	
S U B A R U	49,300	2,465.00	121,524,500	
安永	200	525.00	105,000	

ヤマハ発動機	67,100	1,336.50	89,679,150
エクセディ	2,600	4,135.00	10,751,000
豊田合成	4,500	2,584.50	11,630,250
愛三工業	3,000	1,369.00	4,107,000
ヨロズ	1,600	1,159.00	1,854,400
エフ・シー・シー	2,800	2,694.00	7,543,200
シマノ	6,900	23,260.00	160,494,000
テイ・エス テック	6,500	1,736.00	11,284,000
ジャムコ	1,000	1,221.00	1,221,000
テルモ	106,200	2,970.50	315,467,100
日機装	4,100	1,027.00	4,210,700
日本エム・ディ・エム	1,500	611.00	916,500
島津製作所	22,800	4,650.00	106,020,000
JMS	1,800	473.00	851,400
長野計器	1,000	2,445.00	2,445,000
ブイ・テクノロジー	800	2,453.00	1,962,400
東京計器	1,100	3,160.00	3,476,000
愛知時計電機	800	1,981.00	1,584,800
インターアクション	1,000	1,066.00	1,066,000
東京精密	3,200	8,926.00	28,563,200
マニー	6,300	1,899.50	11,966,850
ニコン	25,000	1,882.50	47,062,500
トプコン	9,000	1,585.00	14,265,000
オリンパス	90,900	2,701.00	245,520,900
理研計器	2,200	4,325.00	9,515,000
タムロン	2,200	4,185.00	9,207,000
HOYA	31,300	21,695.00	679,053,500
ノーリツ鋼機	1,500	3,920.00	5,880,000
A & Dホロンホールディングス	2,000	2,211.00	4,422,000
朝日インテック	19,300	2,452.50	47,333,250
シチズン時計	14,600	923.00	13,475,800
大研医器	300	500.00	150,000
メニコン	5,900	1,690.00	9,971,000
シンシア	200	466.00	93,200
松風	1,600	2,248.00	3,596,800
セイコーグループ	2,400	3,835.00	9,204,000
ニプロ	13,200	1,393.00	18,387,600
三井松島ホールディングス	1,100	4,180.00	4,598,000
パラマウントベッドホールディングス	3,700	2,600.00	9,620,000
トランザクション	1,000	2,395.00	2,395,000
粧美堂	100	485.00	48,500
ニホンフラッシュ	1,300	891.00	1,158,300

前田工織	2,800	1,774.00	4,967,200	
アートネイチャー	1,700	849.00	1,443,300	
フルヤ金属	1,500	4,035.00	6,052,500	
バンダイナムコホールディングス	43,100	3,348.00	144,298,800	
アイフィスジャパン	100	560.00	56,000	
SHOEI	4,400	2,336.00	10,278,400	
フランスベッドホールディングス	2,300	1,237.00	2,845,100	
パイロットコーポレーション	2,500	4,871.00	12,177,500	
萩原工業	1,000	1,430.00	1,430,000	
フジシールインターナショナル	3,600	2,525.00	9,090,000	
タカラトミー	6,700	4,215.00	28,240,500	
広済堂ホールディングス	5,900	531.00	3,132,900	
プロネクサス	1,600	1,273.00	2,036,800	
TOPPANホールディングス	20,800	4,550.00	94,640,000	
大日本印刷	32,900	2,665.00	87,678,500	
共同印刷	500	3,500.00	1,750,000	
NISSHA	2,700	1,926.00	5,200,200	
TAKARA & COMPANY	900	2,658.00	2,392,200	
アシックス	58,600	2,659.50	155,846,700	
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	1,200	1,511.00	1,813,200	
ヤマハ	29,000	1,147.00	33,263,000	
河合楽器製作所	500	2,844.00	1,422,000	
クリナップ	1,600	716.00	1,145,600	
ピジョン	10,100	1,601.00	16,170,100	
キングジム	1,400	860.00	1,204,000	
リンテック	3,200	3,235.00	10,352,000	
イトーキ	3,200	1,574.00	5,036,800	
任天堂	100,200	8,100.00	811,620,000	代用有価証券 18,000株
三菱鉛筆	2,200	2,610.00	5,742,000	
タカラスタンダード	3,600	1,699.00	6,116,400	
コクヨ	7,900	2,755.00	21,764,500	
ナカバヤシ	1,900	515.00	978,500	
グローブライド	1,600	1,945.00	3,112,000	
オカムラ	4,800	1,935.00	9,288,000	
美津濃	1,600	8,000.00	12,800,000	
グリムス	700	2,558.00	1,790,600	
東京電力ホールディングス	133,600	629.30	84,074,480	
中部電力	58,500	1,710.00	100,035,000	
関西電力	66,900	2,401.50	160,660,350	
中国電力	27,600	1,065.50	29,407,800	

北陸電力	16,200	1,008.00	16,329,600
東北電力	41,800	1,286.00	53,754,800
四国電力	14,800	1,310.50	19,395,400
九州電力	36,600	1,587.00	58,084,200
北海道電力	16,600	944.90	15,685,340
沖縄電力	4,100	1,028.00	4,214,800
電源開発	12,000	2,610.00	31,320,000
イーレックス	3,100	634.00	1,965,400
レノバ	4,400	875.00	3,850,000
東京瓦斯	30,900	3,680.00	113,712,000
大阪瓦斯	31,600	3,252.00	102,763,200
東邦瓦斯	6,200	3,769.00	23,367,800
北海道瓦斯	4,800	547.00	2,625,600
広島ガス	3,500	381.00	1,333,500
西部ガスホールディングス	1,700	1,737.00	2,952,900
静岡ガス	3,700	1,005.00	3,718,500
メタウォーター	2,200	1,780.00	3,916,000
SBSホールディングス	1,400	2,413.00	3,378,200
東武鉄道	16,700	2,454.50	40,990,150
相鉄ホールディングス	5,200	2,419.00	12,578,800
東急	44,500	1,899.00	84,505,500
京浜急行電鉄	19,600	1,203.00	23,578,800
小田急電鉄	26,300	1,579.50	41,540,850
京王電鉄	8,400	3,356.00	28,190,400
京成電鉄	9,200	4,044.00	37,204,800
富士急行	2,000	2,524.00	5,048,000
東日本旅客鉄道	87,600	3,058.00	267,880,800
西日本旅客鉄道	40,600	2,688.00	109,132,800
東海旅客鉄道	61,200	3,190.00	195,228,000
西武ホールディングス	17,300	3,396.00	58,750,800
鴻池運輸	2,700	2,442.00	6,593,400
西日本鉄道	4,600	2,170.00	9,982,000
ハマキョウレックス	5,400	1,216.00	6,566,400
サカイ引越センター	2,000	2,373.00	4,746,000
近鉄グループホールディングス	17,000	3,445.00	58,565,000
阪急阪神ホールディングス	21,100	3,932.00	82,965,200
南海電気鉄道	7,100	2,399.00	17,032,900
京阪ホールディングス	8,700	2,777.00	24,159,900
神戸電鉄	400	2,316.00	926,400
名古屋鉄道	17,500	1,663.50	29,111,250
山陽電気鉄道	1,200	2,038.00	2,445,600
アルプス物流	200	5,750.00	1,150,000

ヤマトホールディングス	19,300	1,600.00	30,880,000
山九	3,800	5,207.00	19,786,600
丸全昭和運輸	1,000	6,000.00	6,000,000
センコーグループホールディングス	9,300	1,411.00	13,122,300
トナミホールディングス	300	5,800.00	1,740,000
ニッコンホールディングス	9,000	1,930.00	17,370,000
福山通運	1,700	3,720.00	6,324,000
セイノーホールディングス	7,800	2,378.00	18,548,400
神奈川中央交通	500	3,300.00	1,650,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	4,900	1,029.00	5,042,100
九州旅客鉄道	12,100	3,933.00	47,589,300
S Gホールディングス	26,600	1,514.00	40,272,400
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	5,700	7,400.00	42,180,000
日本郵船	32,900	4,837.00	159,137,300
商船三井	30,100	5,140.00	154,714,000
川崎汽船	36,100	2,116.00	76,387,600
N Sユナイテッド海運	1,000	4,075.00	4,075,000
飯野海運	5,900	1,094.00	6,454,600
乾汽船	2,100	1,135.00	2,383,500
日本航空	36,400	2,420.00	88,088,000
A N Aホールディングス	43,200	2,855.00	123,336,000
トランコム	500	10,230.00	5,115,000
日新	1,100	4,230.00	4,653,000
三菱倉庫	18,500	1,007.50	18,638,750
三井倉庫ホールディングス	1,600	6,950.00	11,120,000
住友倉庫	4,700	2,615.00	12,290,500
澁澤倉庫	700	3,135.00	2,194,500
日本トランスシティ	3,200	940.00	3,008,000
中央倉庫	900	1,550.00	1,395,000
川西倉庫	100	1,064.00	106,400
安田倉庫	1,100	1,620.00	1,782,000
ファイズホールディングス	200	906.00	181,200
上組	7,300	3,130.00	22,849,000
キムラユニティー	100	1,446.00	144,600
キューソー流通システム	1,100	1,950.00	2,145,000
エーアイティー	1,000	1,770.00	1,770,000
内外トランスライン	600	2,768.00	1,660,800
日本コンセプト	600	1,785.00	1,071,000
N E C ネットエスアイ	6,200	3,255.00	20,181,000
クロスキャット	1,000	1,115.00	1,115,000
システナ	22,700	348.00	7,899,600
デジタルアーツ	1,000	5,820.00	5,820,000

日鉄ソリューションズ	5,400	3,990.00	21,546,000
キューブシステム	1,000	996.00	996,000
コア	700	1,857.00	1,299,900
手間いらず	300	3,105.00	931,500
ラクーンホールディングス	1,400	733.00	1,026,200
ソリトンシステムズ	900	1,245.00	1,120,500
ソフトクリエイイトホールディングス	1,200	2,095.00	2,514,000
T I S	16,800	3,714.00	62,395,200
グリー	5,400	427.00	2,305,800
コーエーテクモホールディングス	12,000	1,607.00	19,284,000
三菱総合研究所	800	4,280.00	3,424,000
電算	100	1,406.00	140,600
A G S	200	792.00	158,400
ファインデックス	1,300	871.00	1,132,300
ブレインパッド	1,400	802.00	1,122,800
K L a b	5,000	182.00	910,000
ポルトトゥウィンホールディングス	2,400	442.00	1,060,800
ネクソン	34,900	2,648.50	92,432,650
アイスタイル	5,400	429.00	2,316,600
エムアップホールディングス	2,000	1,327.00	2,654,000
セルシス	900	1,216.00	1,094,400
エニグモ	2,300	303.00	696,900
テクノスジャパン	300	703.00	210,900
コロプラ	5,500	532.00	2,926,000
ブロードリーフ	6,500	559.00	3,633,500
クロス・マーケティンググループ	300	689.00	206,700
デジタルハーツホールディングス	1,200	810.00	972,000
メディアドゥ	800	1,298.00	1,038,400
じげん	4,000	568.00	2,272,000
フィックスターズ	1,600	1,423.00	2,276,800
C A R T A H O L D I N G S	900	1,440.00	1,296,000
オブティム	1,700	591.00	1,004,700
セレス	800	1,663.00	1,330,400
S H I F T	1,100	15,850.00	17,435,000
ティーガイア	1,400	2,667.00	3,733,800
セック	300	4,060.00	1,218,000
テクマトリックス	3,400	2,365.00	8,041,000
プロシップ	700	1,499.00	1,049,300
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,900	3,409.00	13,295,100
G M O ペイメントゲートウェイ	3,600	8,986.00	32,349,600
システムリサーチ	1,100	1,462.00	1,608,200
インターネットイニシアティブ	8,700	2,867.00	24,942,900

さくらインターネット	2,500	4,905.00	12,262,500
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	2,898.00	1,449,000
SRAホールディングス	900	4,250.00	3,825,000
システムインテグレータ	300	315.00	94,500
朝日ネット	1,800	632.00	1,137,600
eBASE	2,300	666.00	1,531,800
アバントグループ	2,000	1,979.00	3,958,000
アドソル日進	700	1,831.00	1,281,700
フリービット	800	1,309.00	1,047,200
コムチュア	2,100	2,309.00	4,848,900
アステリア	1,600	505.00	808,000
アイル	900	3,095.00	2,785,500
マークラインズ	1,000	2,695.00	2,695,000
メディカル・データ・ビジョン	2,000	525.00	1,050,000
gumi	3,200	311.00	995,200
テラスカイ	600	1,870.00	1,122,000
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	200	956.00	191,200
ネオジャパン	500	1,813.00	906,500
PR TIMES	400	1,571.00	628,400
ラクス	7,500	2,056.50	15,423,750
ランドコンピュータ	200	728.00	145,600
ダブルスタンダード	600	1,608.00	964,800
アカツキ	800	2,107.00	1,685,600
ベネフィットジャパン	100	1,119.00	111,900
Ubicomホールディングス	600	1,331.00	798,600
カナミックネットワーク	2,100	536.00	1,125,600
ノムラシステムコーポレーション	1,000	115.00	115,000
チェンジホールディングス	4,000	1,207.00	4,828,000
シンクロ・フード	400	473.00	189,200
オークネット	700	2,345.00	1,641,500
エイトレッド	100	1,566.00	156,600
マクロミル	3,200	800.00	2,560,000
ビーグリー	100	1,374.00	137,400
オロ	700	2,367.00	1,656,900
ユーザーローカル	700	1,856.00	1,299,200
PKSHA Technology	1,000	3,580.00	3,580,000
マネーフォワード	3,900	4,990.00	19,461,000
Sun Asterisk	1,500	534.00	801,000
プラスアルファ・コンサルティング	2,000	2,100.00	4,200,000
電算システムホールディングス	700	2,631.00	1,841,700
Appier Group	4,900	1,632.00	7,996,800

ビジョナル	1,900	8,179.00	15,540,100
ソルクシーズ	500	281.00	140,500
ハイマックス	600	1,377.00	826,200
野村総合研究所	34,500	4,555.00	157,147,500
C Eホールディングス	300	431.00	129,300
日本システム技術	1,500	1,758.00	2,637,000
インテージホールディングス	1,800	1,560.00	2,808,000
東邦システムサイエンス	800	1,454.00	1,163,200
ソースネクスト	8,200	231.00	1,894,200
シンプレクス・ホールディングス	3,100	2,392.00	7,415,200
HEROZ	800	1,117.00	893,600
ラクスル	3,900	1,269.00	4,949,100
メルカリ	7,800	1,824.00	14,227,200
I P S	500	2,436.00	1,218,000
システムサポート	600	1,729.00	1,037,400
イーソル	1,300	705.00	916,500
東海ソフト	100	1,225.00	122,500
ウイングアーク1st	1,700	3,240.00	5,508,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	700	811.00	567,700
サーバーワークス	400	2,376.00	950,400
東名	100	2,200.00	220,000
トビラシステムズ	200	725.00	145,000
S a n s a n	5,200	2,319.00	12,058,800
L i n k - Uグループ	200	468.00	93,600
ギフトィ	1,500	941.00	1,411,500
メドレー	1,800	3,755.00	6,759,000
ベース	800	2,960.00	2,368,000
J M D C	1,900	4,618.00	8,774,200
フォーカスシステムズ	1,100	1,099.00	1,208,900
クレスコ	2,600	1,213.00	3,153,800
フジ・メディア・ホールディングス	15,300	1,721.50	26,338,950
オービック	29,500	5,083.00	149,948,500
ジャストシステム	2,300	3,385.00	7,785,500
T D Cソフト	2,700	1,193.00	3,221,100
L I N Eヤフー	254,400	421.10	107,127,840
トレンドマイクロ	8,400	8,189.00	68,787,600
I Dホールディングス	1,100	1,575.00	1,732,500
日本オラクル	3,000	14,780.00	44,340,000
アルファシステムズ	500	3,215.00	1,607,500
フューチャー	4,000	1,931.00	7,724,000
C A C H o l d i n g s	1,000	1,736.00	1,736,000
オービックビジネスコンサルタント	2,700	6,756.00	18,241,200

アイティフォー	1,900	1,391.00	2,642,900	
東計電算	400	4,585.00	1,834,000	
エクスネット	100	1,401.00	140,100	
大塚商会	18,000	3,498.00	62,964,000	
サイボウズ	2,200	2,081.00	4,578,200	
電通総研	1,500	4,900.00	7,350,000	
A C C E S S	1,700	1,270.00	2,159,000	
デジタルガレージ	2,500	3,095.00	7,737,500	
E Mシステムズ	2,800	539.00	1,509,200	
ウェザーニューズ	500	6,070.00	3,035,000	
C I J	4,000	422.00	1,688,000	
ビジネスエンジニアリング	400	4,000.00	1,600,000	
WOWOW	1,200	999.00	1,198,800	
スカラ	1,800	462.00	831,600	
インテリジェント ウェイブ	200	901.00	180,200	
A N Y C O L O R	2,200	2,210.00	4,862,000	
I M A G I C A G R O U P	1,900	478.00	908,200	
ネットワンシステムズ	6,700	3,605.00	24,153,500	
アルゴグラフィックス	1,500	4,685.00	7,027,500	
マーベラス	3,000	542.00	1,626,000	
エイベックス	3,000	1,492.00	4,476,000	
B I P R O G Y	5,400	4,335.00	23,409,000	
都築電気	1,000	2,419.00	2,419,000	
T B Sホールディングス	8,000	3,692.00	29,536,000	
日本テレビホールディングス	14,100	2,277.50	32,112,750	
朝日放送グループホールディングス	1,600	615.00	984,000	
テレビ朝日ホールディングス	3,900	1,938.00	7,558,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	12,400	846.00	10,490,400	
テレビ東京ホールディングス	1,000	3,255.00	3,255,000	
ビジョン	2,400	1,027.00	2,464,800	
U - N E X T H O L D I N G S	1,800	4,840.00	8,712,000	
日本通信	13,000	140.00	1,820,000	
クロップス	100	961.00	96,100	
日本電信電話	4,735,600	146.70	694,712,520	代用有価証券 700,000株
K D D I	117,100	4,827.00	565,241,700	
ソフトバンク	2,547,100	191.10	486,750,810	
光通信	1,800	30,940.00	55,692,000	
エムティーアイ	1,200	1,131.00	1,357,200	
G M Oインターネットグループ	5,200	2,632.00	13,686,400	
ファイバーゲート	1,000	989.00	989,000	
K A D O K A W A	8,400	3,309.00	27,795,600	
学研ホールディングス	2,900	986.00	2,859,400	

ゼンリン	2,800	817.00	2,287,600
アイネット	1,000	1,630.00	1,630,000
松竹	900	10,900.00	9,810,000
東宝	9,900	5,901.00	58,419,900
東映	2,600	5,010.00	13,026,000
NTTデータグループ	41,600	2,628.00	109,324,800
ピー・シー・エー	1,100	1,967.00	2,163,700
ビジネスブレイン太田昭和	700	1,860.00	1,302,000
D T S	2,900	3,955.00	11,469,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,000	6,057.00	48,456,000
シーイーシー	2,000	1,880.00	3,760,000
カプコン	31,600	3,157.00	99,761,200
アイ・エス・ビー	800	1,362.00	1,089,600
S C S K	13,000	2,824.00	36,712,000
N S W	700	3,020.00	2,114,000
アイネス	1,300	1,620.00	2,106,000
T K C	2,800	3,860.00	10,808,000
富士ソフト	4,400	9,204.00	40,497,600
N S D	6,100	3,346.00	20,410,600
コナミグループ	6,000	14,190.00	85,140,000
福井コンピュータホールディングス	1,100	2,646.00	2,910,600
J B C Cホールディングス	1,100	4,545.00	4,999,500
ミロク情報サービス	1,500	1,834.00	2,751,000
ソフトバンクグループ	78,500	9,405.00	738,292,500
リョーサン菱洋ホールディングス	2,800	2,545.00	7,126,000
高千穂交易	700	3,975.00	2,782,500
オルバヘルスケアホールディングス	100	1,955.00	195,500
伊藤忠食品	400	6,800.00	2,720,000
エレマテック	1,500	2,396.00	3,594,000
あらた	2,600	3,430.00	8,918,000
トーメンデバイス	200	6,480.00	1,296,000
東京エレクトロン デバイス	1,700	3,235.00	5,499,500
円谷フィールズホールディングス	2,700	1,977.00	5,337,900
双日	18,700	3,177.00	59,409,900
アルフレッサ ホールディングス	15,700	2,170.00	34,069,000
横浜冷凍	4,200	904.00	3,796,800
神栄	100	1,551.00	155,100
ラサ商事	900	1,415.00	1,273,500
アルコニックス	2,400	1,395.00	3,348,000
神戸物産	13,000	3,710.00	48,230,000
あい ホールディングス	2,700	2,331.00	6,293,700
ダイワボウホールディングス	7,400	2,803.00	20,742,200

マクニカホールディングス	13,000	1,764.50	22,938,500
ラクト・ジャパン	700	2,807.00	1,964,900
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,300	1,173.00	2,697,900
八洲電機	1,400	1,629.00	2,280,600
メディアスホールディングス	1,100	831.00	914,100
レスター	1,400	2,622.00	3,670,800
ジオリーブグループ	100	1,055.00	105,500
大光	200	622.00	124,400
OCHIホールディングス	100	1,286.00	128,600
TOKAIホールディングス	9,100	919.00	8,362,900
三洋貿易	1,700	1,492.00	2,536,400
ビューティガレージ	600	1,459.00	875,400
ウイン・パートナーズ	1,200	1,269.00	1,522,800
シップヘルスケアホールディングス	6,600	2,320.50	15,315,300
明治電機工業	700	1,393.00	975,100
デリカフーズホールディングス	200	506.00	101,200
スターティアホールディングス	100	1,928.00	192,800
コメダホールディングス	4,400	2,868.00	12,619,200
アセンテック	900	623.00	560,700
フルサト・マルカホールディングス	1,300	2,202.00	2,862,600
ヤマエグループホールディングス	1,800	1,942.00	3,495,600
小野建	1,800	1,494.00	2,689,200
南陽	100	1,101.00	110,100
佐島電機	1,200	1,915.00	2,298,000
エコートレーディング	100	909.00	90,900
伯東	1,000	4,590.00	4,590,000
コンドーテック	1,300	1,343.00	1,745,900
ナガイレーベン	2,100	2,256.00	4,737,600
三菱食品	1,500	4,845.00	7,267,500
松田産業	1,300	3,170.00	4,121,000
第一興商	6,500	1,854.00	12,051,000
メディバルホールディングス	18,200	2,429.00	44,207,800
S P K	700	2,062.00	1,443,400
萩原電気ホールディングス	700	3,400.00	2,380,000
アズワン	5,200	2,869.00	14,918,800
スズデン	700	1,773.00	1,241,100
シモジマ	1,100	1,316.00	1,447,600
ドウシシャ	1,500	2,077.00	3,115,500
高速	1,000	2,510.00	2,510,000
たけびし	700	2,038.00	1,426,600
リックス	400	2,708.00	1,083,200
丸文	1,500	1,093.00	1,639,500

ハビネット	1,300	4,065.00	5,284,500
橋本総業ホールディングス	800	1,193.00	954,400
日本ライフライン	4,500	1,280.00	5,760,000
タカショー	1,600	485.00	776,000
I D O M	5,700	1,008.00	5,745,600
進和	1,000	2,719.00	2,719,000
エスケイジャパン	100	656.00	65,600
ダイトロン	700	2,829.00	1,980,300
シークス	2,400	1,161.00	2,786,400
オーハシテクニカ	800	1,711.00	1,368,800
白銅	500	2,429.00	1,214,500
伊藤忠商事	112,900	7,938.00	896,200,200
丸紅	139,300	2,420.50	337,175,650
高島	200	1,204.00	240,800
長瀬産業	7,500	3,273.00	24,547,500
蝶理	900	4,060.00	3,654,000
豊田通商	50,500	2,710.50	136,880,250
三共生興	2,200	636.00	1,399,200
兼松	7,000	2,566.50	17,965,500
三井物産	251,600	3,270.00	822,732,000
日本紙パルプ商事	8,000	666.00	5,328,000
カメイ	1,800	1,956.00	3,520,800
スターゼン	1,100	2,950.00	3,245,000
山善	5,600	1,326.00	7,425,600
椿本興業	900	1,907.00	1,716,300
住友商事	100,700	3,306.00	332,914,200
内田洋行	700	6,430.00	4,501,000
三菱商事	322,500	2,783.50	897,678,750
第一実業	1,600	2,580.00	4,128,000
キャノンマーケティングジャパン	3,300	4,603.00	15,189,900
西華産業	800	3,880.00	3,104,000
佐藤商事	1,100	1,398.00	1,537,800
東京産業	1,700	700.00	1,190,000
ユアサ商事	1,400	4,740.00	6,636,000
神鋼商事	400	6,190.00	2,476,000
阪和興業	2,800	5,080.00	14,224,000
正栄食品工業	1,100	4,415.00	4,856,500
カナデン	1,200	1,456.00	1,747,200
R Y O D E N	1,300	2,367.00	3,077,100
岩谷産業	16,700	1,993.00	33,283,100
ナイス	100	1,651.00	165,100
ニチモウ	100	1,875.00	187,500

極東貿易	1,000	1,469.00	1,469,000
アステナホールディングス	3,100	518.00	1,605,800
三愛オブリ	3,900	1,926.00	7,511,400
稲畑産業	4,500	3,285.00	14,782,500
G S I クレオス	900	2,038.00	1,834,200
明和産業	2,400	644.00	1,545,600
ワキタ	2,500	1,562.00	3,905,000
東邦ホールディングス	4,500	4,345.00	19,552,500
サンゲツ	4,200	2,806.00	11,785,200
ミツウロコグループホールディングス	2,100	1,717.00	3,605,700
シナネンホールディングス	500	6,200.00	3,100,000
伊藤忠エネクス	4,200	1,623.00	6,816,600
サンリオ	13,600	4,888.00	66,476,800
サンワテクノス	800	2,153.00	1,722,400
新光商事	2,200	971.00	2,136,200
トーヨー	700	2,677.00	1,873,900
三信電気	700	2,057.00	1,439,900
東陽テクニカ	1,500	1,547.00	2,320,500
モスフードサービス	2,500	3,565.00	8,912,500
加賀電子	3,400	2,827.00	9,611,800
ソーダニッカ	1,600	1,149.00	1,838,400
立花エレテック	1,000	2,560.00	2,560,000
フォーバル	700	1,407.00	984,900
P A L T A C	2,600	4,116.00	10,701,600
三谷産業	2,900	317.00	919,300
西本Wismettacホールディングス	1,000	1,315.00	1,315,000
コア商事ホールディングス	1,500	608.00	912,000
K P P グループホールディングス	3,400	661.00	2,247,400
ヤマタネ	700	3,405.00	2,383,500
泉州電業	1,200	5,370.00	6,444,000
トラスコ中山	3,500	2,241.00	7,843,500
オートバックスセブン	5,800	1,416.00	8,212,800
モリト	1,300	1,421.00	1,847,300
加藤産業	2,100	4,070.00	8,547,000
イエローハット	3,000	2,517.00	7,551,000
J K ホールディングス	1,300	1,018.00	1,323,400
日伝	1,000	3,035.00	3,035,000
杉本商事	1,500	1,354.00	2,031,000
因幡電機産業	4,700	3,786.00	17,794,200
東テク	1,700	2,722.00	4,627,400
ミスミグループ本社	25,400	2,594.50	65,900,300
蔵王産業	100	2,440.00	244,000

スズケン	5,500	4,799.00	26,394,500
ジェコス	1,100	980.00	1,078,000
サンエー	2,900	2,802.00	8,125,800
カワチ薬品	1,300	2,500.00	3,250,000
エービーシー・マート	7,400	3,048.00	22,555,200
ハードオフコーポレーション	700	1,957.00	1,369,900
アスクル	4,000	1,904.00	7,616,000
ゲオホールディングス	1,900	1,536.00	2,918,400
アダストリア	2,300	3,510.00	8,073,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	200	533.00	106,600
くら寿司	2,000	4,080.00	8,160,000
キャンドウ	600	3,255.00	1,953,000
パルグループホールディングス	3,900	3,055.00	11,914,500
エディオン	7,300	1,768.00	12,906,400
サーラコーポレーション	3,500	825.00	2,887,500
ハローズ	700	4,230.00	2,961,000
フジオフードグループ本社	1,900	1,385.00	2,631,500
あみやき亭	1,200	1,638.00	1,965,600
大黒天物産	500	10,400.00	5,200,000
ハニーズホールディングス	1,500	1,640.00	2,460,000
ファーマライズホールディングス	200	617.00	123,400
アルペン	1,400	2,024.00	2,833,600
ハブ	200	739.00	147,800
クオールホールディングス	2,100	1,348.00	2,830,800
ジinzホールディングス	1,300	6,260.00	8,138,000
ビックカメラ	10,100	1,653.00	16,695,300
D C Mホールディングス	8,700	1,419.00	12,345,300
Monotaro	23,800	2,573.00	61,237,400
東京一番フーズ	200	496.00	99,200
J.フロント リテイリング	19,300	1,701.50	32,838,950
ドトール・日レスホールディングス	3,000	2,250.00	6,750,000
マツキヨココカラ&カンパニー	29,600	2,059.50	60,961,200
broncoビリー	1,000	3,770.00	3,770,000
Z O Z O	12,500	4,896.00	61,200,000
トレジャー・ファクトリー	1,200	1,344.00	1,612,800
物語コーポレーション	3,000	3,500.00	10,500,000
三越伊勢丹ホールディングス	25,500	2,307.00	58,828,500
Hamee	800	1,043.00	834,400
ウエルシアホールディングス	8,700	1,874.00	16,303,800
クリエイトSDホールディングス	2,400	2,958.00	7,099,200
丸善CHIホールディングス	700	316.00	221,200
ティーライフ	100	1,199.00	119,900

シュッピン	1,700	1,069.00	1,817,300
オイシックス・ラ・大地	2,700	1,244.00	3,358,800
ネクステージ	3,800	1,547.00	5,878,600
ジョイフル本田	4,700	1,998.00	9,390,600
エターナルホスピタリティグループ	600	3,480.00	2,088,000
ホットランド	1,300	2,338.00	3,039,400
すかいらーくホールディングス	23,000	2,375.50	54,636,500
SFPホールディングス	1,000	1,980.00	1,980,000
綿半ホールディングス	1,300	1,631.00	2,120,300
ヨシックスホールディングス	600	3,205.00	1,923,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,500	825.00	4,537,500
B E E N O S	1,100	2,780.00	3,058,000
あさひ	1,400	1,534.00	2,147,600
日本調剤	1,100	1,309.00	1,439,900
コスモス薬品	2,800	7,115.00	19,922,000
トーエル	200	769.00	153,800
セブン&アイ・ホールディングス	185,600	2,205.00	409,248,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	12,700	1,210.00	15,367,000
ツルハホールディングス	3,500	8,542.00	29,897,000
サンマルクホールディングス	1,400	2,275.00	3,185,000
トリドールホールディングス	4,700	3,941.00	18,522,700
ウイルプラスホールディングス	100	1,090.00	109,000
JMホールディングス	1,300	2,857.00	3,714,100
アレンザホールディングス	1,300	1,088.00	1,414,400
串カツ田中ホールディングス	600	1,546.00	927,600
パロックジャパンリミテッド	2,000	776.00	1,552,000
クスリのアオキホールディングス	5,600	3,167.00	17,735,200
力の源ホールディングス	1,300	1,080.00	1,404,000
FOOD & LIFE COMPANIE	9,000	2,948.00	26,532,000
メディカルシステムネットワーク	2,100	415.00	871,500
一家ホールディングス	200	669.00	133,800
ノジマ	5,500	2,170.00	11,935,000
カップ・クリエイト	2,700	1,603.00	4,328,100
良品計画	20,000	2,634.00	52,680,000
アドヴァングループ	1,500	951.00	1,426,500
アルビス	600	2,665.00	1,599,000
ハウス オブ ローゼ	100	1,462.00	146,200
G - 7ホールディングス	1,800	1,480.00	2,664,000
イオン北海道	4,200	887.00	3,725,400
コジマ	3,200	1,056.00	3,379,200
コーナン商事	1,900	3,565.00	6,773,500

エコス	600	2,047.00	1,228,200
ワタミ	2,000	1,058.00	2,116,000
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	34,000	3,847.00	130,798,000
西松屋チェーン	3,700	2,197.00	8,128,900
ゼンショーホールディングス	9,500	7,783.00	73,938,500
幸楽苑	1,300	1,271.00	1,652,300
サイゼリヤ	2,500	5,780.00	14,450,000
V Tホールディングス	6,600	469.00	3,095,400
魚力	600	2,397.00	1,438,200
フジ・コーポレーション	800	1,869.00	1,495,200
ユナイテッドアローズ	1,800	2,253.00	4,055,400
ハイデイ日高	2,700	2,713.00	7,325,100
コロワイド	9,500	1,688.50	16,040,750
壱番屋	6,700	1,035.00	6,934,500
スギホールディングス	9,000	2,573.00	23,157,000
薬王堂ホールディングス	800	2,051.00	1,640,800
スクロール	2,500	1,017.00	2,542,500
ヨンドシーホールディングス	1,600	1,839.00	2,942,400
木曽路	2,600	2,255.00	5,863,000
S R Sホールディングス	2,800	1,140.00	3,192,000
千趣会	3,500	314.00	1,099,000
リテールパートナーズ	2,500	1,315.00	3,287,500
上新電機	1,700	2,493.00	4,238,100
日本瓦斯	8,000	2,073.50	16,588,000
ロイヤルホールディングス	3,000	2,468.00	7,404,000
いなげや	1,200	1,169.00	1,402,800
チヨダ	1,600	1,392.00	2,227,200
ライフコーポレーション	1,800	3,300.00	5,940,000
リンガーハット	2,200	2,290.00	5,038,000
MrMaxHD	2,200	663.00	1,458,600
AOKIホールディングス	3,600	1,190.00	4,284,000
オークワ	2,700	894.00	2,413,800
コメリ	2,300	3,250.00	7,475,000
青山商事	3,600	1,334.00	4,802,400
しまむら	3,900	7,830.00	30,537,000
はせがわ	400	305.00	122,000
高島屋	23,400	1,225.50	28,676,700
松屋	2,900	843.00	2,444,700
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,200	1,961.50	16,084,300
近鉄百貨店	1,000	2,051.00	2,051,000
丸井グループ	11,200	2,404.50	26,930,400
アクシアル リテイリング	4,600	878.00	4,038,800

イオン	62,100	3,795.00	235,669,500
イズミ	2,600	3,195.00	8,307,000
平和堂	2,800	2,166.00	6,064,800
フジ	3,100	2,027.00	6,283,700
ヤオコー	2,000	9,096.00	18,192,000
ゼビオホールディングス	2,300	1,158.00	2,663,400
ケーズホールディングス	11,300	1,412.00	15,955,600
日産東京販売ホールディングス	600	433.00	259,800
シルバーライフ	700	725.00	507,500
Genky DrugStores	1,500	3,035.00	4,552,500
ナルミヤ・インターナショナル	100	1,215.00	121,500
ブックオフグループホールディングス	1,200	1,463.00	1,755,600
ギフトホールディングス	800	3,400.00	2,720,000
アインホールディングス	2,300	4,890.00	11,247,000
Genki Global Dining	1,000	4,035.00	4,035,000
ヤマダホールディングス	51,700	431.80	22,324,060
アークランズ	5,000	1,666.00	8,330,000
ニトリホールディングス	6,100	18,685.00	113,978,500
グルメ杵屋	1,400	1,032.00	1,444,800
ケーユーホールディングス	1,000	1,082.00	1,082,000
吉野家ホールディングス	6,600	3,129.00	20,651,400
松屋フーズホールディングス	800	6,390.00	5,112,000
サガミホールディングス	2,700	1,846.00	4,984,200
王将フードサービス	3,300	3,005.00	9,916,500
ミニストップ	1,400	1,764.00	2,469,600
アークス	2,800	2,489.00	6,969,200
パローホールディングス	3,200	2,089.00	6,684,800
ベルク	800	6,430.00	5,144,000
大庄	1,000	1,041.00	1,041,000
ファーストリテイリング	9,400	50,350.00	473,290,000
サンドラッグ	5,700	3,758.00	21,420,600
サクスパー ホールディングス	1,600	919.00	1,470,400
やまや	100	2,835.00	283,500
ベルーナ	4,100	733.00	3,005,300
いよぎんホールディングス	20,500	1,563.00	32,041,500
しずおかフィナンシャルグループ	34,400	1,294.50	44,530,800
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	13,100	1,597.00	20,920,700
楽天銀行	7,200	3,200.00	23,040,000
京都フィナンシャルグループ	19,700	2,343.50	46,166,950
じもとホールディングス	400	305.00	122,000
めぶきフィナンシャルグループ	78,500	618.70	48,567,950
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	4,150.00	8,300,000

九州フィナンシャルグループ	27,500	782.10	21,507,750	
ゆうちょ銀行	128,900	1,420.00	183,038,000	
富山第一銀行	4,900	1,151.00	5,639,900	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	83,200	824.40	68,590,080	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,600	1,783.00	17,116,800	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,748.00	2,447,200	
第四北越フィナンシャルグループ	4,900	2,537.00	12,431,300	
ひろぎんホールディングス	22,000	1,180.00	25,960,000	
おきなわフィナンシャルグループ	1,200	2,310.00	2,772,000	
十六フィナンシャルグループ	2,200	4,270.00	9,394,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,500	4,580.00	6,870,000	
プロクレアホールディングス	1,800	1,739.00	3,130,200	
あいちフィナンシャルグループ	2,900	2,360.00	6,844,000	
あおぞら銀行	10,800	2,710.50	29,273,400	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,025,400	1,715.50	1,759,073,700	代用有価証券 90,000株
りそなホールディングス	193,100	1,098.00	212,023,800	
三井住友トラストグループ	55,700	3,533.00	196,788,100	
三井住友フィナンシャルグループ	326,200	3,473.00	1,132,892,600	
千葉銀行	48,400	1,218.50	58,975,400	
群馬銀行	27,800	955.00	26,549,000	
武蔵野銀行	2,400	2,829.00	6,789,600	
千葉興業銀行	3,700	1,160.00	4,292,000	
筑波銀行	6,800	236.00	1,604,800	
七十七銀行	5,000	4,264.00	21,320,000	
秋田銀行	1,000	2,147.00	2,147,000	
山形銀行	1,700	993.00	1,688,100	
岩手銀行	1,000	2,395.00	2,395,000	
東邦銀行	13,400	266.00	3,564,400	
東北銀行	200	1,072.00	214,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	13,600	3,705.00	50,388,000	
スルガ銀行	10,500	1,092.00	11,466,000	
八十二銀行	36,600	882.50	32,299,500	
山梨中央銀行	1,800	1,750.00	3,150,000	
大垣共立銀行	3,000	1,879.00	5,637,000	
福井銀行	1,400	1,829.00	2,560,600	
清水銀行	700	1,461.00	1,022,700	
滋賀銀行	2,400	3,405.00	8,172,000	
南都銀行	2,300	3,135.00	7,210,500	
百五銀行	14,700	587.00	8,628,900	
紀陽銀行	5,600	1,856.00	10,393,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	8,800	1,716.50	15,105,200	
山陰合同銀行	9,800	1,297.00	12,710,600	

鳥取銀行	100	1,223.00	122,300
百十四銀行	1,500	2,625.00	3,937,500
四国銀行	2,300	974.00	2,240,200
阿波銀行	2,200	2,565.00	5,643,000
大分銀行	900	3,240.00	2,916,000
宮崎銀行	1,000	2,841.00	2,841,000
佐賀銀行	900	2,147.00	1,932,300
琉球銀行	3,600	1,024.00	3,686,400
セブン銀行	55,900	333.00	18,614,700
みずほフィナンシャルグループ	211,100	3,452.00	728,717,200
山口フィナンシャルグループ	15,300	1,606.00	24,571,800
名古屋銀行	1,000	6,240.00	6,240,000
北洋銀行	21,300	419.00	8,924,700
大光銀行	100	1,390.00	139,000
愛媛銀行	2,300	1,070.00	2,461,000
トマト銀行	100	1,118.00	111,800
京葉銀行	7,000	723.00	5,061,000
栃木銀行	7,100	273.00	1,938,300
北日本銀行	600	2,627.00	1,576,200
東和銀行	2,900	598.00	1,734,200
大東銀行	200	701.00	140,200
トモニホールディングス	14,900	412.00	6,138,800
フィデアホールディングス	1,600	1,460.00	2,336,000
池田泉州ホールディングス	21,600	352.00	7,603,200
F P G	5,600	2,769.00	15,506,400
ジャパンインベストメントアドバイザー	2,500	1,110.00	2,775,000
マーキュリアホールディングス	200	870.00	174,000
S B Iホールディングス	25,200	3,536.00	89,107,200
ジャフコ グループ	4,600	2,042.00	9,393,200
大和証券グループ本社	111,800	1,059.00	118,396,200
野村ホールディングス	263,000	871.30	229,151,900
岡三証券グループ	12,300	619.00	7,613,700
丸三証券	5,200	947.00	4,924,400
東洋証券	4,700	524.00	2,462,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,500	473.00	8,750,500
水戸証券	4,300	501.00	2,154,300
いちよし証券	3,100	823.00	2,551,300
松井証券	10,700	821.00	8,784,700
マネックスグループ	15,300	797.00	12,194,100
極東証券	2,000	1,301.00	2,602,000
岩井コスモホールディングス	1,800	2,111.00	3,799,800
アイザワ証券グループ	2,300	1,710.00	3,933,000

スパークス・グループ	1,700	1,415.00	2,405,500
かんぽ生命保険	18,200	2,587.00	47,083,400
F Pパートナー	700	2,991.00	2,093,700
S O M P Oホールディングス	76,400	3,394.00	259,301,600
アニコム ホールディングス	5,300	666.00	3,529,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	114,600	3,528.00	404,308,800
第一生命ホールディングス	73,500	3,981.00	292,603,500
東京海上ホールディングス	152,600	5,743.00	876,381,800
T & Dホールディングス	42,000	2,510.00	105,420,000
アドバンスクリエイト	1,200	755.00	906,000
N E X Y Z . G r o u p	100	771.00	77,100
全国保証	4,100	5,474.00	22,443,400
あんしん保証	300	170.00	51,000
ジェイリース	1,200	1,398.00	1,677,600
イントラスト	200	761.00	152,200
日本モーゲージサービス	200	421.00	84,200
S B Iアルヒ	1,600	817.00	1,307,200
プレミアグループ	2,600	2,318.00	6,026,800
ネットプロテクションズホールディングス	5,200	340.00	1,768,000
クレディセゾン	9,900	3,530.00	34,947,000
芙蓉総合リース	1,400	11,160.00	15,624,000
みずほリース	11,700	1,031.00	12,062,700
東京センチュリー	11,700	1,545.50	18,082,350
日本証券金融	5,700	1,983.00	11,303,100
アイフル	25,900	324.00	8,391,600
リコーリース	1,500	5,070.00	7,605,000
イオンフィナンシャルサービス	9,000	1,248.50	11,236,500
アコム	37,200	362.60	13,488,720
ジャックス	1,900	3,810.00	7,239,000
オリエントコーポレーション	5,100	839.00	4,278,900
オリックス	93,800	3,315.00	310,947,000
三菱H C キャピタル	78,400	1,046.00	82,006,400
日本取引所グループ	93,000	1,887.50	175,537,500
イー・ギャランティ	2,600	1,519.00	3,949,400
N E C キャピタルソリューション	800	3,735.00	2,988,000
大東建託	5,300	17,050.00	90,365,000
サムティホールディングス	3,100	3,295.00	10,214,500
いちご	13,200	405.00	5,346,000
日本駐車場開発	18,700	227.00	4,244,900
スター・マイカ・ホールディングス	1,700	655.00	1,113,500
S R E ホールディングス	600	3,780.00	2,268,000
ヒューリック	36,500	1,450.00	52,925,000

野村不動産ホールディングス	9,800	3,853.00	37,759,400
三重交通グループホールディングス	3,400	500.00	1,700,000
ディア・ライフ	2,700	861.00	2,324,700
コーセーアールイー	200	701.00	140,200
地主	1,400	2,131.00	2,983,400
プレサンスコーポレーション	2,100	1,936.00	4,065,600
THEグローバル社	300	617.00	185,100
JPMC	900	1,138.00	1,024,200
サンセイランディック	200	934.00	186,800
エストラスト	100	668.00	66,800
フージャースホールディングス	2,400	1,021.00	2,450,400
オープンハウスグループ	5,700	5,563.00	31,709,100
東急不動産ホールディングス	47,000	982.50	46,177,500
飯田グループホールディングス	15,000	2,166.00	32,490,000
イーランド	100	1,355.00	135,500
ムゲンエステート	200	1,795.00	359,000
ビーロッド	200	1,168.00	233,600
ファーストブラザーズ	100	1,121.00	112,100
And Doホールディングス	1,000	1,056.00	1,056,000
シーアールイー	800	1,201.00	960,800
ケイアイスター不動産	800	3,820.00	3,056,000
アグレ都市デザイン	100	1,620.00	162,000
グッドコムアセット	1,300	810.00	1,053,000
ジェイ・エス・ビー	700	2,726.00	1,908,200
ロードスターキャピタル	900	2,367.00	2,130,300
イノベーションホールディングス	200	915.00	183,000
グローバル・リンク・マネジメント	100	2,380.00	238,000
霞ヶ関キャピタル	600	15,230.00	9,138,000
パーク24	12,200	1,871.00	22,826,200
パラカ	600	1,820.00	1,092,000
ミガロホールディングス	100	1,689.00	168,900
宮越ホールディングス	700	1,845.00	1,291,500
三井不動産	217,000	1,353.50	293,709,500
三菱地所	90,600	2,302.50	208,606,500
平和不動産	2,500	4,200.00	10,500,000
東京建物	13,700	2,583.50	35,393,950
京阪神ビルディング	2,600	1,558.00	4,050,800
住友不動産	25,400	4,808.00	122,123,200
テーオーシー	2,800	607.00	1,699,600
レオパレス21	13,700	562.00	7,699,400
スターツコーポレーション	2,600	3,455.00	8,983,000
フジ住宅	2,000	759.00	1,518,000

空港施設	2,300	581.00	1,336,300
明和地所	1,300	979.00	1,272,700
ゴールドクレスト	1,100	3,020.00	3,322,000
エスリード	700	4,390.00	3,073,000
日神グループホールディングス	2,600	506.00	1,315,600
日本エスコン	4,100	997.00	4,087,700
M I R A R T Hホールディングス	9,200	494.00	4,544,800
イオンモール	9,500	2,031.50	19,299,250
毎日コムネット	200	722.00	144,400
カチタス	4,200	1,944.00	8,164,800
トーセイ	2,600	2,470.00	6,422,000
サンフロンティア不動産	2,600	1,854.00	4,820,400
F Jネクストホールディングス	1,700	1,123.00	1,909,100
グランディハウス	1,800	560.00	1,008,000
日本空港ビルデング	5,500	5,590.00	30,745,000
明豊ファシリティワークス	200	860.00	172,000
M I X I	3,100	2,783.00	8,627,300
ジェイエシーリクルートメント	6,000	724.00	4,344,000
日本M & Aセンターホールディングス	24,000	704.00	16,896,000
中広	200	447.00	89,400
U Tグループ	2,100	2,673.00	5,613,300
アイティメディア	900	1,560.00	1,404,000
ケアネット	3,400	669.00	2,274,600
E・Jホールディングス	1,000	1,706.00	1,706,000
オープンアップグループ	4,900	1,985.00	9,726,500
コシダカホールディングス	4,900	1,189.00	5,826,100
アルトナー	100	1,753.00	175,300
パソナグループ	2,000	1,982.00	3,964,000
C D S	100	1,795.00	179,500
リンクアンドモチベーション	4,100	546.00	2,238,600
エス・エム・エス	6,300	1,702.00	10,722,600
サニーサイドアップグループ	200	523.00	104,600
パーソルホールディングス	152,400	254.00	38,709,600
アイ・ケイ・ケイホールディングス	300	732.00	219,600
学情	900	1,717.00	1,545,300
スタジオアリス	800	2,049.00	1,639,200
エプコ	200	756.00	151,200
N J S	400	3,995.00	1,598,000
総合警備保障	27,300	1,064.50	29,060,850
カカクコム	11,800	2,443.50	28,833,300
アイロムグループ	700	2,777.00	1,943,900
セントケア・ホールディング	1,300	734.00	954,200

ルネサンス	1,300	1,019.00	1,324,700
ディップ	2,900	2,683.00	7,780,700
デジタルホールディングス	1,000	1,016.00	1,016,000
新日本科学	1,700	1,348.00	2,291,600
キャリアデザインセンター	100	1,770.00	177,000
エムスリー	32,300	1,513.50	48,886,050
ツカダ・グローバルホールディング	400	409.00	163,600
ウェルネット	300	888.00	266,400
ワールドホールディングス	700	1,922.00	1,345,400
ディー・エヌ・エー	6,500	1,963.00	12,759,500
博報堂D Yホールディングス	18,500	1,217.50	22,523,750
ぐるなび	3,200	307.00	982,400
タカミヤ	2,300	439.00	1,009,700
ファンコミュニケーションズ	2,400	413.00	991,200
ライク	700	1,375.00	962,500
エスプール	5,200	356.00	1,851,200
WDBホールディングス	900	1,724.00	1,551,600
ティア	400	428.00	171,200
アドウェイズ	2,500	333.00	832,500
バリューコマース	1,400	1,086.00	1,520,400
インフォマート	15,400	321.00	4,943,400
J Pホールディングス	4,200	690.00	2,898,000
プレステージ・インターナショナル	7,700	668.00	5,143,600
プロトコーポレーション	1,800	1,411.00	2,539,800
アミューズ	1,000	1,337.00	1,337,000
ドリームインキュベータ	500	2,857.00	1,428,500
クイック	1,100	2,012.00	2,213,200
電通グループ	17,700	4,838.00	85,632,600
ぴあ	600	3,135.00	1,881,000
イオンファンタジー	700	2,694.00	1,885,800
シーティーエス	2,300	905.00	2,081,500
H . U . グループホールディングス	4,800	2,633.00	12,638,400
アルプス技研	1,400	2,777.00	3,887,800
日本空調サービス	1,800	1,025.00	1,845,000
オリエンタルランド	97,200	3,751.00	364,597,200
ダスキン	3,600	3,770.00	13,572,000
明光ネットワークジャパン	2,100	685.00	1,438,500
ファルコホールディングス	700	2,379.00	1,665,300
ラウンドワン	15,400	961.00	14,799,400
リゾートトラスト	6,400	2,748.50	17,590,400
ビー・エム・エル	2,000	2,771.00	5,542,000
リソー教育	10,300	283.00	2,914,900

早稲田アカデミー	900	1,749.00	1,574,100
ユー・エス・エス	33,600	1,293.50	43,461,600
東京個別指導学院	2,300	397.00	913,100
サイバーエージェント	36,100	1,030.00	37,183,000
楽天グループ	115,000	933.00	107,295,000
クリーク・アンド・リバー社	900	1,607.00	1,446,300
SBIグローバルアセットマネジメント	3,200	620.00	1,984,000
テー・オー・ダブリュー	3,300	321.00	1,059,300
山田コンサルティンググループ	800	2,154.00	1,723,200
セントラルスポーツ	600	2,465.00	1,479,000
フルキャストホールディングス	1,300	1,524.00	1,981,200
エン・ジャパン	2,700	2,402.00	6,485,400
テクノプロ・ホールディングス	9,500	2,829.00	26,875,500
アイ・アールジャパンホールディングス	1,000	857.00	857,000
Keeper 技研	1,000	3,905.00	3,905,000
楽待	200	691.00	138,200
三機サービス	100	938.00	93,800
Gunosy	1,400	711.00	995,400
イー・ガーディアン	800	1,785.00	1,428,000
リブセンス	600	162.00	97,200
ジャパンマテリアル	5,000	1,813.00	9,065,000
ベクトル	2,200	948.00	2,085,600
チャーム・ケア・コーポレーション	1,400	1,250.00	1,750,000
キャリアリンク	600	2,540.00	1,524,000
I B J	1,500	666.00	999,000
アサンテ	800	1,705.00	1,364,000
バリューHR	1,500	1,781.00	2,671,500
M&Aキャピタルパートナーズ	1,300	2,526.00	3,283,800
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
E R Iホールディングス	100	1,834.00	183,400
シグマクシス・ホールディングス	2,400	1,668.00	4,003,200
ウィルグループ	1,400	991.00	1,387,400
メドピア	1,600	577.00	923,200
レアジョブ	200	393.00	78,600
リクルートホールディングス	127,300	9,321.00	1,186,563,300
エラン	2,200	810.00	1,782,000
日本郵政	182,800	1,437.50	262,775,000
ベルシステム24ホールディングス	1,800	1,291.00	2,323,800
鎌倉新書	1,700	531.00	902,700
一蔵	200	510.00	102,000
エアトリ	1,200	1,032.00	1,238,400
ストライク	800	3,810.00	3,048,000

ソラスト	4,500	480.00	2,160,000
セラク	600	1,308.00	784,800
インソース	3,500	1,044.00	3,654,000
ペイカレント	12,000	5,043.00	60,516,000
Orchestra Holdings	600	865.00	519,000
アイモパイル	2,100	503.00	1,056,300
MS - Japan	900	1,051.00	945,900
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,300	2,843.00	17,910,900
グリーンズ	100	1,572.00	157,200
エル・ティー・エス	300	1,750.00	525,000
ミダックホールディングス	1,000	1,816.00	1,816,000
キュービーネットホールディングス	1,000	1,010.00	1,010,000
マネジメントソリューションズ	800	1,872.00	1,497,600
プロレド・パートナーズ	700	478.00	334,600
フロンティア・マネジメント	600	1,179.00	707,400
コプロ・ホールディングス	200	1,390.00	278,000
アンビスホールディングス	3,500	1,973.00	6,905,500
カーブスホールディングス	4,500	796.00	3,582,000
フォーラムエンジニアリング	1,900	884.00	1,679,600
Fast Fitness Japan	700	1,329.00	930,300
Macbee Planet	500	2,678.00	1,339,000
ポピンズ	400	1,420.00	568,000
LITALICO	1,500	1,150.00	1,725,000
コンフィデンス・インターワークス	100	1,682.00	168,200
アドバンテッジリスクマネジメント	300	586.00	175,800
リログループ	9,100	1,852.00	16,853,200
東祥	1,400	679.00	950,600
ID&Eホールディングス	1,000	4,270.00	4,270,000
ビーウィズ	400	1,576.00	630,400
サンウェルズ	600	1,752.00	1,051,200
TREホールディングス	3,800	1,739.00	6,608,200
人・夢・技術グループ	700	1,634.00	1,143,800
NISSOホールディングス	1,500	822.00	1,233,000
大栄環境	3,600	2,976.00	10,713,600
日本管財ホールディングス	1,700	2,643.00	4,493,100
M&A総研ホールディングス	1,800	2,296.00	4,132,800
エイチ・アイ・エス	5,200	1,825.00	9,490,000
ラックランド	700	1,981.00	1,386,700
共立メンテナンス	5,100	2,480.00	12,648,000
イチネンホールディングス	1,600	1,930.00	3,088,000
建設技術研究所	800	4,580.00	3,664,000
スペース	1,200	1,136.00	1,363,200

燦ホールディングス	1,400	1,129.00	1,580,600	
スバル興業	600	3,245.00	1,947,000	
ナガワ	400	6,680.00	2,672,000	
東京都競馬	1,200	4,195.00	5,034,000	
カナモト	2,500	2,715.00	6,787,500	
ニシオホールディングス	1,400	3,700.00	5,180,000	
トランス・コスモス	2,100	3,445.00	7,234,500	
乃村工藝社	7,100	771.00	5,474,100	
藤田観光	700	8,820.00	6,174,000	
KNT-CTホールディングス	1,000	1,292.00	1,292,000	
トーカイ	1,400	2,176.00	3,046,400	
白洋舎	100	2,270.00	227,000	
セコム	33,300	5,416.00	180,352,800	
セントラル警備保障	900	2,765.00	2,488,500	
丹青社	3,500	799.00	2,796,500	
メイテックグループホールディングス	6,000	2,936.50	17,619,000	
応用地質	1,500	2,522.00	3,783,000	
船井総研ホールディングス	3,300	2,447.00	8,075,100	
オオバ	200	1,009.00	201,800	
学究社	700	1,883.00	1,318,100	
イオンディライト	1,800	4,280.00	7,704,000	
ナック	1,700	574.00	975,800	
ダイセキ	3,900	3,805.00	14,839,500	
ステップ	600	2,058.00	1,234,800	
合 計	29,824,500		61,801,121,520	

(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11月 6日現在	2024年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
預金	408,433,421	208,762,095
コール・ローン	3,625,129,197	4,354,123,881
株式	302,865,738,679	434,547,773,298
投資証券	6,178,478,022	8,665,411,394
派生商品評価勘定	136,284,443	179,255,652
未収入金	1,337,338	36,110,325
未収配当金	156,767,619	188,032,829
未収利息	-	27,881
差入委託証拠金	415,280,406	591,070,886

	2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
流動資産合計	313,787,449,125	448,770,568,241
資産合計	313,787,449,125	448,770,568,241
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	13,037,499	28,204,324
未払解約金	110,218,720	188,694,604
未払利息	668	-
流動負債合計	123,256,887	216,898,928
負債合計	123,256,887	216,898,928
純資産の部		
元本等		
元本	60,904,952,761	65,028,312,356
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	252,759,239,477	383,525,356,957
元本等合計	313,664,192,238	448,553,669,313
純資産合計	313,664,192,238	448,553,669,313
負債純資産合計	313,787,449,125	448,770,568,241

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

(貸借対照表に関する注記)

	2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
1. 期首	2022年11月 8日	2023年11月 7日
期首元本額	59,202,311,151円	60,904,952,761円
期首からの追加設定元本額	9,450,699,077円	10,608,323,025円
期首からの一部解約元本額	7,748,057,467円	6,484,963,430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）	33,249,241,900円	36,199,095,327円
DCインデックスバランス（株式20）	117,741,897円	99,358,157円
DCインデックスバランス（株式40）	322,405,329円	287,223,552円
DCインデックスバランス（株式60）	682,562,314円	647,947,867円
DCインデックスバランス（株式80）	814,906,805円	834,515,823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	1,252,135,558円	963,153,916円
日興五大陸株式ファンド	3,478,589,862円	3,421,767,621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）	5,879,043,409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）	8,712,673円	20,478,957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）	251,058,476円	4,135,452,006円
Tracers MSCIオール・カントリー・インデックス（全世界株式）	309,166,276円	620,098,981円
Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	266,848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）	151,348円	240,268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	955,818,454円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	16,033,125円	12,228,073円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	46,733,638円	39,026,317円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	73,720,471円	64,434,317円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	74,507,576円	65,796,773円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,215,722,153円	4,123,217,712円
計	60,904,952,761円	65,028,312,356円
2. 受益権の総数	60,904,952,761口	65,028,312,356口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2022年11月 8日 至 2023年11月 6日	自 2023年11月 7日 至 2024年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2023年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	10,640,554,988

投資証券	496,097,102
合計	11,136,652,090

(2024年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,254,747,121
投資証券	72,979,543
合計	2,327,726,664

(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11月 6日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,592,485,152	-	4,677,893,280	85,408,128
合計		4,592,485,152	-	4,677,893,280	85,408,128

(2024年11月 6日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,142,041,438	-	4,129,908,378	12,133,060
合計		4,142,041,438	-	4,129,908,378	12,133,060

(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11月 6日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,781,351,249	-	3,819,264,795	37,913,546
	米ドル	3,153,722,060	-	3,180,417,600	26,695,540
	ユーロ	627,629,189	-	638,847,195	11,218,006
	売建	10,877,700	-	10,952,430	74,730
	加ドル	10,877,700	-	10,952,430	74,730
合計		3,792,228,949	-	3,830,217,225	37,838,816

(2024年11月 6日現在)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,320,894,720	-	3,484,263,525	163,368,805
	米ドル	2,863,096,470	-	3,013,173,020	150,076,550
	ユーロ	457,798,250	-	471,090,505	13,292,255
	売建	135,914,960	-	136,099,377	184,417
	米ドル	99,215,000	-	99,331,500	116,500
	加ドル	11,838,960	-	11,891,772	52,812
	ユーロ	24,861,000	-	24,876,105	15,105
	合計	3,456,809,680	-	3,620,362,902	163,184,388

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年11月 6日現在		2024年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	5.1501円	1口当たり純資産額	6.8978円
(1万口当たり純資産額)	(51,501円)	(1万口当たり純資産額)	(68,978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	23.57	445,237.30	
	BAKER HUGHES CO	47,175	38.58	1,820,011.50	
	CHENIERE ENERGY INC	9,880	192.58	1,902,690.40	
	CHEVRON CORP	77,801	153.41	11,935,451.41	
	CHORD ENERGY CORP	2,600	126.64	329,264.00	
	CONOCOPHILLIPS	51,626	109.21	5,638,075.46	
	COTERRA ENERGY INC	32,460	23.32	756,967.20	
	DEVON ENERGY CORPORATION	25,260	39.34	993,728.40	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,580	175.63	1,331,275.40	
	EOG RESOURCES INC	26,282	122.11	3,209,295.02	
	EQT CORP	23,250	37.54	872,805.00	

EXPAND ENERGY CORP	8,220	86.67	712,427.40
EXXON MOBIL CORP	198,509	118.96	23,614,630.64
HALLIBURTON CO	37,607	28.53	1,072,927.71
HESS CORP	12,700	139.35	1,769,745.00
HF SINCLAIR CORP	5,940	39.98	237,481.20
KINDER MORGAN INC	91,790	24.71	2,268,130.90
MARATHON OIL CORP	28,380	27.60	783,288.00
MARATHON PETROLEUM CORP	15,742	149.56	2,354,373.52
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	28,351	50.40	1,428,890.40
ONEOK INC	26,380	98.61	2,601,331.80
OVINTIV INC	13,280	39.95	530,536.00
PHILLIPS 66	18,855	121.84	2,297,293.20
SCHLUMBERGER LTD	60,961	40.55	2,471,968.55
TARGA RESOURCES CORP	9,510	177.40	1,687,074.00
TEXAS PACIFIC LAND CORP	735	1,243.15	913,715.25
VALERO ENERGY CORP	14,682	132.06	1,938,904.92
WILLIAMS COS INC	55,354	53.05	2,936,529.70
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	10,125	306.37	3,101,996.25
ALBEMARLE CORP	4,750	99.78	473,955.00
AMCOR PLC	65,600	10.26	673,056.00
AVERY DENNISON CORP	3,040	206.75	628,520.00
BALL CORP	14,380	59.98	862,512.40
CELANESE CORP	4,090	91.00	372,190.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,820	86.56	676,899.20
CORTEVA INC	29,832	61.75	1,842,126.00
CRH PLC	29,300	96.91	2,839,463.00
CROWN HOLDINGS INC	6,535	93.90	613,636.50
DOW INC	31,205	47.90	1,494,719.50
DUPONT DE NEMOURS INC	19,162	85.67	1,641,608.54
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,815	100.88	485,737.20
ECOLAB INC	11,060	246.85	2,730,161.00
FREEMPORT-MCMORAN INC	61,328	46.99	2,881,802.72
INTERNATIONAL PAPER CO	13,670	57.56	786,845.20
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,755	99.10	1,164,920.50
LINDE PLC	21,260	454.89	9,670,961.40
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,860	85.37	1,097,858.20
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,720	582.52	1,584,454.40
MOSAIC CO/THE	13,580	28.08	381,326.40
NEWMONT CORP	49,002	46.00	2,254,092.00
NUCOR CORP	9,959	144.61	1,440,170.99
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	232.61	832,743.80
PPG INDUSTRIES INC	10,334	124.65	1,288,133.10
RELIANCE INC	2,770	291.70	808,009.00

RPM INTERNATIONAL INC	4,960	129.51	642,369.60
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,626	378.21	4,018,859.46
SMURFIT WESTROCK PLC	22,989	51.82	1,191,289.98
STEEL DYNAMICS INC	7,090	135.65	961,758.50
VULCAN MATERIALS CO	5,563	272.67	1,516,863.21
WESTLAKE CORP	1,360	132.55	180,268.00
3M CO	23,576	126.52	2,982,835.52
AECOM	7,170	109.91	788,054.70
AERCAP HOLDINGS NV	9,760	95.66	933,641.60
ALLEGION PLC	3,340	140.90	470,606.00
AMETEK INC	10,233	182.02	1,862,610.66
AXON ENTERPRISE INC	3,320	441.09	1,464,418.80
BOEING CO/THE	31,512	151.00	4,758,312.00
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	5,240	180.99	948,387.60
CARLISLE COS INC	2,250	434.31	977,197.50
CARRIER GLOBAL CORP	37,428	73.90	2,765,929.20
CATERPILLAR INC	21,646	383.37	8,298,427.02
CNH INDUSTRIAL NV	40,400	11.25	454,500.00
CUMMINS INC	6,355	354.46	2,252,593.30
DEERE & CO	11,625	400.37	4,654,301.25
DOVER CORP	6,680	192.15	1,283,562.00
EATON CORP PLC	17,676	337.48	5,965,296.48
EMCOR GROUP INC	2,010	475.78	956,317.80
EMERSON ELECTRIC CO	24,700	117.67	2,906,449.00
FASTENAL CO	24,326	78.09	1,899,617.34
FERGUSON ENTERPRISES INC	8,440	202.11	1,705,808.40
FORTIVE CORP	14,854	71.39	1,060,427.06
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	5,050	85.60	432,280.00
GE VERNOVA INC	11,966	315.77	3,778,503.82
GENERAL DYNAMICS CORP	10,277	296.65	3,048,672.05
GENERAL ELECTRIC CO	48,197	175.26	8,447,006.22
GRACO INC	8,120	84.60	686,952.00
HEICO CORP	1,800	253.06	455,508.00
HEICO CORP-CLASS A	3,120	198.32	618,758.40
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	29,006	208.78	6,055,872.68
HOWMET AEROSPACE INC	17,943	102.16	1,833,056.88
HUBBELL INC	2,320	439.64	1,019,964.80
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,530	193.24	295,657.20
IDEX CORP	3,640	224.71	817,944.40
ILLINOIS TOOL WORKS	12,835	266.43	3,419,629.05
INGERSOLL-RAND INC	16,398	97.70	1,602,084.60
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,570	40.66	267,136.20
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	29,834	74.86	2,233,373.24

L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	8,570	250.95	2,150,641.50
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,385	625.62	866,483.70
LOCKHEED MARTIN CORP	9,486	546.75	5,186,470.50
MASCO CORP	9,849	81.78	805,451.22
NORDSON CORP	2,345	253.38	594,176.10
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,154	512.90	3,156,386.60
OTIS WORLDWIDE CORP	17,124	100.16	1,715,139.84
OWENS CORNING	3,550	182.56	648,088.00
PACCAR INC	21,896	108.07	2,366,300.72
PARKER HANNIFIN CORP	5,775	653.45	3,773,673.75
PENTAIR PLC	6,918	102.29	707,642.22
QUANTA SERVICES INC	6,700	314.62	2,107,954.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,178	269.20	1,393,917.60
RTX CORP	58,476	118.98	6,957,474.48
SMITH (A.O.) CORP	5,020	75.92	381,118.40
SNAP-ON INC	2,525	334.18	843,804.50
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,226	96.70	698,754.20
TEXTRON INC	7,956	83.34	663,053.04
TORO CO	4,950	83.24	412,038.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	10,066	390.29	3,928,659.14
TRANSDIGM GROUP INC	2,560	1,337.60	3,424,256.00
UNITED RENTALS INC	3,005	798.00	2,397,990.00
VERTIV HOLDINGS CO	16,260	112.44	1,828,274.40
WABTEC CORP	8,150	192.70	1,570,505.00
WATSCO INC	1,540	487.90	751,366.00
WW GRAINGER INC	1,847	1,122.02	2,072,370.94
XYLEM INC	10,898	122.26	1,332,389.48
AUTOMATIC DATA PROCESSING	18,051	291.18	5,256,090.18
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,910	185.28	1,095,004.80
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	5,230	218.30	1,141,709.00
CINTAS CORP	15,528	208.99	3,245,196.72
COPART INC	37,560	52.89	1,986,548.40
DAYFORCE INC	7,010	77.16	540,891.60
EQUIFAX INC	5,024	269.63	1,354,621.12
JACOBS SOLUTIONS INC	6,200	141.69	878,478.00
LEIDOS HOLDINGS INC	5,950	190.07	1,130,916.50
PAYCHEX INC	14,002	139.76	1,956,919.52
PAYCOM SOFTWARE INC	2,765	218.54	604,263.10
REPUBLIC SERVICES INC	9,560	202.14	1,932,458.40
ROLLINS INC	14,385	48.55	698,391.75
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	71.90	608,993.00
TRANSUNION	7,940	100.97	801,701.80
VERALTO CORP	11,363	103.61	1,177,320.43

VERISK ANALYTICS INC	6,310	279.68	1,764,780.80
WASTE CONNECTIONS INC	11,916	178.78	2,130,342.48
WASTE MANAGEMENT INC	17,874	215.88	3,858,639.12
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,930	104.93	517,304.90
CSX CORP	84,959	34.02	2,890,305.18
DELTA AIR LINES INC	8,345	58.29	486,430.05
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,467	122.02	789,103.34
FEDEX CORP	10,298	275.42	2,836,275.16
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	77,000	4.19	322,630.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,750	185.56	695,850.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,140	54.00	331,560.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,745	252.11	2,456,811.95
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,450	207.01	1,749,234.50
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	30.63	167,546.10
U-HAUL HOLDING CO	3,375	69.30	233,887.50
UBER TECHNOLOGIES INC	83,530	74.15	6,193,749.50
UNION PACIFIC CORP	26,946	233.87	6,301,861.02
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	32,557	133.84	4,357,428.88
APTIV PLC	12,290	55.24	678,899.60
FORD MOTOR COMPANY	177,905	10.60	1,885,793.00
GENERAL MOTORS CORP	52,355	53.70	2,811,463.50
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	39,110	10.59	414,174.90
TESLA INC	126,915	251.44	31,911,507.60
DECKERS OUTDOOR CORP	7,320	163.67	1,198,064.40
DR HORTON INC	12,896	173.27	2,234,489.92
GARMIN LTD	7,025	204.23	1,434,715.75
LENNAR CORP-CL A	10,040	177.28	1,779,891.20
LULULEMON ATHLETICA INC	5,360	319.23	1,711,072.80
NIKE INC -CL B	54,038	77.98	4,213,883.24
NVR INC	148	9,455.81	1,399,459.88
PULTE GROUP INC	8,850	133.26	1,179,351.00
AIRBNB INC-CLASS A	18,550	137.82	2,556,561.00
BOOKING HOLDINGS INC	1,498	4,914.98	7,362,640.04
CARNIVAL CORP	43,817	22.45	983,691.65
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	60,100	56.18	3,376,418.00
DARDEN RESTAURANTS INC	4,853	161.38	783,177.14
DOMINO'S PIZZA INC	1,375	428.00	588,500.00
DOORDASH INC - A	12,760	159.46	2,034,709.60
DRAFTKINGS INC-CL A	20,420	36.45	744,309.00
EXPEDIA GROUP INC	6,032	164.87	994,495.84
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	7,820	229.15	1,791,953.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,650	235.65	2,509,672.50
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,680	143.10	240,408.00

LAS VEGAS SANDS CORP	16,310	50.34	821,045.40
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,673	259.66	2,771,351.18
MCDONALD'S CORP	31,791	297.32	9,452,100.12
MGM RESORTS INTERNATIONAL	12,900	36.23	467,367.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,018	210.77	2,322,263.86
STARBUCKS CORP	50,054	97.09	4,859,742.86
WYNN RESORTS LTD	4,180	86.72	362,489.60
YUM! BRANDS INC	13,354	134.72	1,799,050.88
ALPHABET INC-CL A	259,790	169.74	44,096,754.60
ALPHABET INC-CL C	223,110	171.41	38,243,285.10
CHARTER COMMUNICATION-A	4,316	382.38	1,650,352.08
COMCAST CORP-CLASS A	173,804	42.56	7,397,098.24
ELECTRONIC ARTS INC	10,834	155.50	1,684,687.00
FOX CORP - CLASS A	13,084	43.60	570,462.40
FOX CORP- CLASS B	5,466	40.66	222,247.56
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,096	29.77	449,407.92
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	10,280	81.40	836,792.00
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,420	117.62	755,120.40
MATCH GROUP INC	10,912	36.94	403,089.28
META PLATFORMS INC-CLASS A	96,790	572.43	55,405,499.70
NETFLIX INC	19,065	763.91	14,563,944.15
NEWS CORP - CLASS A	14,750	27.85	410,787.50
OMNICOM GROUP	9,397	103.18	969,582.46
PARAMOUNT GLOBAL	22,823	11.09	253,107.07
PINTEREST INC- CLASS A	27,330	32.72	894,237.60
ROBLOX CORP -CLASS A	21,110	51.18	1,080,409.80
ROKU INC	6,620	69.67	461,215.40
SEA LTD-ADR	16,470	95.74	1,576,837.80
SNAP INC - A	45,300	12.19	552,207.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,240	164.03	1,187,577.20
THE WALT DISNEY CO.	81,122	96.63	7,838,818.86
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	19,370	119.94	2,323,237.80
WARNER BROS DISCOVERY INC	94,890	8.21	779,046.90
AMAZON.COM INC	413,920	199.50	82,577,040.00
AUTOZONE INC	722	3,059.83	2,209,197.26
BATH & BODY WORKS INC	9,270	31.62	293,117.40
BEST BUY CO INC	7,814	92.84	725,451.76
BURLINGTON STORES INC	2,935	251.96	739,502.60
CARMAX INC	8,089	73.87	597,534.43
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,600	198.10	515,060.00
EBAY INC	21,897	61.51	1,346,884.47
GENUINE PARTS CO	5,751	116.60	670,566.60
GLOBAL-E ONLINE LTD	5,190	38.88	201,787.20

HOME DEPOT INC	43,925	400.09	17,573,953.25
LKQ CORP	10,260	37.66	386,391.60
LOWE'S COS INC	25,272	269.18	6,802,716.96
MERCADOLIBRE INC	2,020	2,090.01	4,221,820.20
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,610	1,162.33	3,033,681.30
POOL CORP	1,540	369.29	568,706.60
ROSS STORES INC	14,742	142.32	2,098,081.44
TJX COMPANIES INC	50,336	113.75	5,725,720.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,530	276.21	1,251,231.30
ULTA BEAUTY INC	2,100	382.91	804,111.00
WILLIAMS-SONOMA INC	6,000	134.83	808,980.00
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	17,570	18.55	325,923.50
COSTCO WHOLESALE CORP	19,584	890.17	17,433,089.28
DOLLAR GENERAL CORP	9,855	81.57	803,872.35
DOLLAR TREE INC	8,986	66.77	599,995.22
KROGER CO	30,580	57.39	1,754,986.20
SYSCO CORP	20,636	76.35	1,575,558.60
TARGET CORP	19,870	150.99	3,000,171.30
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	30,782	9.62	296,122.84
WALMART INC	195,256	83.68	16,339,022.08
ALTRIA GROUP INC	76,018	54.19	4,119,415.42
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,143	52.00	1,151,436.00
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	10,590	43.74	463,206.60
BUNGE GLOBAL SA	5,847	84.80	495,825.60
CAMPBELL SOUP CO	7,885	46.74	368,544.90
CELSIUS HOLDINGS INC	6,050	31.73	191,966.50
COCA-COLA CO/THE	180,712	65.37	11,813,143.44
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	10,150	77.84	790,126.75
CONAGRA BRANDS INC	20,640	29.08	600,211.20
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,870	237.15	1,629,220.50
GENERAL MILLS INC	25,189	68.31	1,720,660.59
HERSHEY CO/THE	6,245	180.11	1,124,786.95
HORMEL FOODS CORP	15,290	31.10	475,519.00
JM SMUCKER CO/THE	4,100	116.39	477,199.00
KELLANOVA	11,098	80.86	897,384.28
KEURIG DR PEPPER INC	46,480	32.61	1,515,712.80
KRAFT HEINZ CO/THE	38,121	33.51	1,277,434.71
LAMB WESTON HOLDING INC	6,150	79.17	486,895.50
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,420	78.83	821,408.60
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,570	55.98	423,768.60
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	59,855	69.05	4,132,987.75
MONSTER BEVERAGE CORP	31,880	54.11	1,725,026.80
PEPSICO INC	61,051	167.85	10,247,410.35

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	68,418	132.19	9,044,175.42
TYSON FOODS INC-CL A	12,336	59.26	731,031.36
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,310	104.14	1,073,683.40
CLOROX COMPANY	5,266	162.42	855,303.72
COLGATE-PALMOLIVE CO	34,820	94.26	3,282,133.20
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	10,080	65.86	663,868.80
KENVUE INC	89,200	23.23	2,072,116.00
KIMBERLY-CLARK CORP	14,753	134.83	1,989,146.99
PROCTER & GAMBLE CO	104,529	165.76	17,326,727.04
ABBOTT LABORATORIES	77,176	117.73	9,085,930.48
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,060	212.15	649,179.00
BAXTER INTERNATIONAL INC	23,599	36.10	851,923.90
BECTON DICKINSON AND CO	12,277	237.30	2,913,332.10
BOSTON SCIENTIFIC CORP	65,518	85.54	5,604,409.72
CARDINAL HEALTH INC	10,305	113.18	1,166,319.90
CENCORA INC	8,304	233.99	1,943,052.96
CENTENE CORP	22,367	64.80	1,449,381.60
CIGNA GROUP/THE	12,530	318.39	3,989,426.70
COOPER COS INC/THE	9,240	105.21	972,140.40
CVS HEALTH CORP	54,808	55.34	3,033,074.72
DAVITA INC	2,108	147.08	310,044.64
DEXCOM INC	16,520	69.00	1,139,880.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	26,110	66.69	1,741,275.90
ELEVANCE HEALTH INC	10,326	417.77	4,313,893.02
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	19,125	88.17	1,686,251.25
HCA HEALTHCARE INC	8,580	366.66	3,145,942.80
HENRY SCHEIN INC	5,280	68.99	364,267.20
HOLOGIC INC	9,858	78.80	776,810.40
HUMANA INC	5,055	260.60	1,317,333.00
IDEXX LABORATORIES INC	3,720	415.98	1,547,445.60
INSULET CORP	2,745	241.32	662,423.40
INTUITIVE SURGICAL INC	15,745	515.17	8,111,351.65
LABCORP HOLDINGS INC	4,005	229.11	917,585.55
MCKESSON CORP	5,929	525.28	3,114,385.12
MEDTRONIC PLC	58,348	89.68	5,232,648.64
MOLINA HEALTHCARE INC	2,655	333.39	885,150.45
QUEST DIAGNOSTICS	5,276	154.10	813,031.60
RESMED INC	6,510	245.74	1,599,767.40
SOLVENTUM CORP	5,894	73.16	431,205.04
STERIS PLC	4,240	227.44	964,345.60
STRYKER CORP	15,243	369.86	5,637,775.98
TELEFLEX INC	2,290	203.50	466,015.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	40,650	567.03	23,049,769.50

UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,720	212.17	577,102.40
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	6,870	212.65	1,460,905.50
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,902	108.92	1,078,525.84
ABBVIE INC	77,866	201.68	15,704,014.88
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,750	140.41	1,790,227.50
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,760	265.29	1,528,070.40
AMGEN INC	23,641	319.29	7,548,334.89
AVANTOR INC	27,110	22.77	617,294.70
BIO-RAD LABORATORIES-A	950	374.28	355,566.00
BIO-TECHNE CORP	6,730	77.62	522,382.60
BIOGEN INC	6,663	176.93	1,178,884.59
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,380	66.04	553,415.20
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	90,215	55.95	5,047,529.25
CATALENT INC	7,860	58.48	459,652.80
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,420	188.68	456,605.60
DANAHER CORP	29,569	250.07	7,394,319.83
ELI LILLY & CO	35,659	806.06	28,743,293.54
EXACT SCIENCES CORP	7,370	71.51	527,028.70
GILEAD SCIENCES INC	55,584	90.22	5,014,788.48
ILLUMINA INC	6,855	154.96	1,062,250.80
INCYTE CORP	7,670	77.28	592,737.60
IQVIA HOLDINGS INC	8,208	212.87	1,747,236.96
JOHNSON & JOHNSON	106,491	158.35	16,862,849.85
MERCK & CO. INC.	112,083	101.65	11,393,236.95
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	965	1,385.79	1,337,287.35
MODERNA INC	14,425	53.29	768,708.25
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,120	121.53	500,703.60
PFIZER INC	251,520	27.99	7,040,044.80
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,815	829.43	3,993,705.45
REVVITY INC	4,910	125.96	618,463.60
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,800	27.54	517,752.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	49,020	18.77	920,105.40
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	16,929	560.79	9,493,613.91
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,900	382.77	727,263.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,465	499.88	5,731,124.20
VIATRIS INC	53,899	11.61	625,767.39
WATERS CORP	2,661	387.17	1,030,259.37
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,550	323.47	1,148,318.50
ZOETIS INC	20,385	175.27	3,572,878.95
BANK OF AMERICA CORP	311,349	41.88	13,039,296.12
CITIGROUP INC	85,007	63.67	5,412,395.69
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,310	42.22	815,268.20
FIFTH THIRD BANCORP	29,319	43.16	1,265,408.04

FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	450	1,921.51	864,679.50
HUNTINGTON BANCSHARES INC	68,620	15.54	1,066,354.80
JPMORGAN CHASE & CO	126,780	221.49	28,080,502.20
KEYCORP	36,108	17.26	623,224.08
M & T BANK CORP	8,063	193.14	1,557,287.82
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	17,950	188.80	3,388,960.00
REGIONS FINANCIAL CORP	40,884	23.62	965,680.08
TRUIST FINANCIAL CORP	61,350	42.32	2,596,332.00
US BANCORP	70,761	47.61	3,368,931.21
WELLS FARGO & CO	154,290	64.07	9,885,360.30
ALLY FINANCIAL INC	12,240	35.22	431,092.80
AMERICAN EXPRESS CO	25,434	275.94	7,018,257.96
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,225	513.95	2,171,438.75
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	16,940	149.27	2,528,633.80
ARES MANAGEMENT CORP-A	8,510	164.44	1,399,384.40
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	32,742	76.01	2,488,719.42
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	58,535	445.06	26,051,587.10
BLACKROCK INC	6,620	1,014.35	6,714,997.00
BLACKSTONE INC	31,620	169.62	5,363,384.40
BLOCK INC	25,180	72.38	1,822,528.40
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,385	166.05	2,886,779.25
CARLYLE GROUP INC/THE	12,810	49.45	633,518.55
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,570	212.16	969,571.20
CME GROUP INC	15,350	225.19	3,456,666.50
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	8,570	193.96	1,662,237.20
COREBRIDGE FINANCIAL INC	12,150	30.00	364,500.00
CORPAY INC	2,880	330.81	952,732.80
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,750	151.85	1,632,387.50
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,420	44.49	641,545.80
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,590	467.96	744,056.40
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	26,148	86.57	2,263,632.36
FISERV INC	25,854	203.02	5,248,879.08
FRANKLIN RESOURCES INC	11,755	20.95	246,267.25
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	99.08	247,700.00
GLOBAL PAYMENTS INC	10,989	107.37	1,179,888.93
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,193	526.96	7,479,143.28
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	25,540	157.85	4,031,489.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,200	185.52	593,664.00
KKR & CO INC -A	27,920	138.99	3,880,600.80
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,185	275.81	878,454.85
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,545	279.15	431,286.75
MASTERCARD INC - A	36,610	505.56	18,508,551.60
MOODY'S CORP	7,072	462.20	3,268,678.40

MORGAN STANLEY	54,193	117.81	6,384,477.33
MSCI INC	3,715	588.32	2,185,608.80
NASDAQ INC	19,695	76.14	1,499,577.30
NORTHERN TRUST CORP	9,930	101.35	1,006,405.50
PAYPAL HOLDINGS INC	42,267	79.25	3,349,659.75
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,470	146.45	1,240,431.50
ROBINHOOD MARKETS INC - A	23,380	24.96	583,564.80
S&P GLOBAL INC	14,215	489.71	6,961,227.65
SCHWAB (CHARLES) CORP	67,403	71.31	4,806,507.93
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,375	76.78	335,912.50
STATE STREET CORP	12,947	92.91	1,202,905.77
SYNCHRONY FINANCIAL	19,010	56.82	1,080,148.20
T ROWE PRICE GROUP INC	10,315	114.52	1,181,273.80
TOAST INC-CLASS A	18,170	30.81	559,817.70
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,200	129.03	541,926.00
VISA INC-CLASS A SHARES	69,752	293.29	20,457,564.08
AFLAC INC	23,424	105.56	2,472,637.44
ALLSTATE CORP	11,983	185.06	2,217,573.98
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,660	127.44	338,990.40
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	30,345	75.39	2,287,709.55
AON PLC	8,567	368.70	3,158,652.90
ARCH CAPITAL GROUP LTD	16,205	96.50	1,563,782.50
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,950	283.14	2,817,243.00
ASSURANT INC	2,470	193.09	476,932.30
BROWN & BROWN INC	10,940	107.60	1,177,144.00
CHUBB LTD	16,995	277.29	4,712,543.55
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,350	140.37	1,031,719.50
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,090	408.69	445,472.10
EVEREST GROUP LTD	1,989	354.61	705,319.29
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	11,071	59.49	658,613.79
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,382	111.63	1,382,202.66
LOEWS CORP	9,765	78.39	765,478.35
MARKEL GROUP INC	530	1,558.85	826,190.50
MARSH & MCLENNAN COS	21,888	221.55	4,849,286.40
METLIFE INC	26,335	78.15	2,058,080.25
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,520	82.55	785,876.00
PROGRESSIVE CORP	25,750	248.07	6,387,802.50
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,962	120.18	1,798,133.16
TRAVELERS COS INC/THE	10,189	244.84	2,494,674.76
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,848	307.92	1,492,796.16
WR BERKLEY CORP	12,136	58.21	706,436.56
ACCENTURE PLC-CL A	27,723	345.49	9,578,019.27
ADOBE INC	19,589	486.42	9,528,481.38

AKAMA I TECHNOLOGIES INC	6,030	100.96	608,788.80
ANSYS INC	3,935	324.48	1,276,828.80
APPLOVIN CORP-CLASS A	9,200	165.18	1,519,656.00
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,300	241.00	313,300.00
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	6,850	221.58	1,517,823.00
AUTODESK INC	9,390	291.79	2,739,908.10
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	9,480	49.56	469,828.80
CADENCE DESIGN SYS INC	11,820	291.21	3,442,102.20
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,840	171.04	656,793.60
CLOUDFLARE INC-CLASS A	13,050	87.71	1,144,615.50
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	21,758	75.39	1,640,335.62
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,980	307.58	3,069,648.40
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,920	280.19	537,964.80
DATADOG INC-CLASS A	11,930	125.05	1,491,846.50
DOCUSIGN INC	8,320	72.25	601,120.00
DYNATRACE INC	12,980	54.77	710,914.60
EPAM SYSTEMS INC	2,500	192.22	480,550.00
FAIR ISAAC CORP	1,120	2,009.75	2,250,920.00
FORTINET INC	28,035	77.92	2,184,487.20
GARTNER INC	3,490	513.48	1,792,045.20
GEN DIGITAL INC	24,365	28.53	695,133.45
GODADDY INC-CLASS A	6,020	167.63	1,009,132.60
HUBSPOT INC	2,075	578.28	1,199,931.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	40,692	207.57	8,446,438.44
INTUIT INC	12,401	618.83	7,674,110.83
MANHATTAN ASSOCIATES INC	3,220	266.43	857,904.60
MICROSOFT CORP	311,884	411.46	128,327,790.64
MICROSTRATEGY INC-CL A	7,160	227.80	1,631,048.00
MONDAY.COM LTD	1,970	296.95	584,991.50
MONGODB INC	3,420	274.75	939,645.00
OKTA INC	7,610	74.07	563,672.70
ORACLE CORP	72,973	171.78	12,535,301.94
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	90,090	51.13	4,606,301.70
PALO ALTO NETWORKS INC	14,395	366.29	5,272,744.55
PTC INC	5,250	189.99	997,447.50
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,990	542.70	2,708,073.00
SALESFORCE INC	42,956	297.49	12,778,980.44
SAMSARA INC-CL A	9,840	48.24	474,681.60
SERVICENOW INC	9,040	971.04	8,778,201.60
SNOWFLAKE INC-CLASS A	13,900	116.50	1,619,350.00
SYNOPSYS INC	6,732	521.98	3,513,969.36
TWILIO INC - A	7,225	88.69	640,785.25
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,830	606.35	1,109,620.50

VERISIGN INC	4,530	179.15	811,549.50
WIX.COM LTD	2,280	165.80	378,024.00
WORKDAY INC-CLASS A	9,170	241.25	2,212,262.50
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	12,150	77.75	944,662.50
ZSCALER INC	3,630	186.91	678,483.30
AMPHENOL CORP-CL A	53,530	69.71	3,731,576.30
APPLE INC	643,644	223.45	143,822,251.80
ARISTA NETWORKS INC	11,860	405.12	4,804,723.20
CDW CORP/DE	5,895	192.99	1,137,676.05
CISCO SYSTEMS INC	177,400	56.16	9,962,784.00
CORNING INC	38,258	47.28	1,808,838.24
DELL TECHNOLOGIES -C	12,542	133.46	1,673,855.32
F5 INC	2,385	232.92	555,514.20
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	57,545	20.00	1,150,900.00
HP INC	45,695	36.64	1,674,264.80
JABIL INC	5,590	128.66	719,209.40
JUNIPER NETWORKS INC	13,453	39.15	526,684.95
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,160	154.89	1,109,012.40
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,290	462.09	3,368,636.10
NETAPP INC	9,416	116.40	1,096,022.40
PURE STORAGE INC - CLASS A	13,200	51.15	675,180.00
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	9,164	101.65	931,520.60
SUPER MICRO COMPUTER INC	22,800	27.70	631,560.00
TE CONNECTIVITY PLC	14,145	149.14	2,109,585.30
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,020	459.37	927,927.40
TRIMBLE INC	11,410	61.62	703,084.20
WESTERN DIGITAL CORP	14,028	66.83	937,491.24
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,075	379.69	787,856.75
AT&T INC	316,447	22.05	6,977,656.35
T-MOBILE US INC	23,319	227.11	5,295,978.09
VERIZON COMMUNICATIONS INC	186,197	41.26	7,682,488.22
AES CORP	27,958	15.51	433,628.58
ALLIANT ENERGY CORP	12,150	58.12	706,158.00
AMEREN CORPORATION	12,892	87.66	1,130,112.72
AMERICAN ELECTRIC POWER	22,348	100.40	2,243,739.20
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,295	137.11	1,274,437.45
ATMOS ENERGY CORP	6,760	137.98	932,744.80
CENTERPOINT ENERGY INC	31,272	29.55	924,087.60
CMS ENERGY CORP	15,200	69.11	1,050,472.00
CONSOLIDATED EDISON INC	16,506	99.82	1,647,628.92
CONSTELLATION ENERGY	14,338	233.75	3,351,507.50
DOMINION ENERGY INC	36,341	58.59	2,129,219.19
DTE ENERGY COMPANY	8,318	123.43	1,026,690.74

DUKE ENERGY CORP	34,456	114.08	3,930,740.48
EDISON INTERNATIONAL	16,329	81.97	1,338,488.13
ENERGY CORP	9,247	145.95	1,349,599.65
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,210	40.12	449,745.20
EVERGY INC	8,720	61.06	532,443.20
EVERSOURCE ENERGY	14,310	62.07	888,221.70
EXELON CORP	43,056	38.47	1,656,364.32
FIRSTENERGY CORP	23,295	41.90	976,060.50
NEXTERA ENERGY INC	91,420	78.65	7,190,183.00
NISOURCE INC	23,010	35.23	810,642.30
NRG ENERGY INC	9,770	91.25	891,512.50
P G & E CORP	85,070	20.24	1,721,816.80
PPL CORP	30,338	32.59	988,715.42
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	22,058	83.78	1,848,019.24
SEMPRA	27,094	82.25	2,228,481.50
SOUTHERN CO	48,275	88.70	4,281,992.50
VISTRA CORP	14,720	121.90	1,794,368.00
WEC ENERGY GROUP INC	14,270	96.10	1,371,347.00
XCEL ENERGY INC	26,934	66.33	1,786,532.22
ADVANCED MICRO DEVICES	71,644	141.66	10,149,089.04
ANALOG DEVICES INC	22,067	217.60	4,801,779.20
APPLIED MATERIALS INC	36,743	186.48	6,851,834.64
BROADCOM INC	195,160	173.90	33,938,324.00
ENPHASE ENERGY INC	6,430	89.94	578,314.20
ENTEGRIS INC	6,650	103.12	685,748.00
FIRST SOLAR INC	4,560	215.89	984,458.40
INTEL CORP	189,542	23.32	4,420,119.44
KLA CORP	5,909	670.33	3,960,979.97
LAM RESEARCH CORP	57,770	76.40	4,413,628.00
MARVELL TECHNOLOGY INC	40,254	87.19	3,509,746.26
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	23,418	75.09	1,758,457.62
MICRON TECHNOLOGY INC	48,957	105.49	5,164,473.93
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,200	762.97	1,678,534.00
NVIDIA CORP	1,086,420	139.91	152,001,022.20
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,887	224.65	2,445,764.55
ON SEMICONDUCTOR CORP	20,910	70.20	1,467,882.00
QORVO INC	4,240	71.80	304,432.00
QUALCOMM INC	49,502	165.91	8,212,876.82
SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,440	88.58	570,455.20
TERADYNE INC	6,880	105.45	725,496.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	40,182	202.46	8,135,247.72
CBRE GROUP INC - A	14,480	134.72	1,950,745.60
COSTAR GROUP INC	18,730	75.34	1,411,118.20

	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,500	4.95	200,475.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	6,370	62.80	400,036.00	
米ドル小計		16,265,721		2,193,365,435.08 (335,255,906,751)	
加ドル	ARC RESOURCES LTD	25,510	22.91	584,434.10	
	CAMECO CORP	19,282	70.98	1,368,636.36	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,918	47.59	4,469,557.62	
	CENOVUS ENERGY INC	68,613	22.33	1,532,128.29	
	ENBRIDGE INC	95,987	56.80	5,452,061.60	
	IMPERIAL OIL LTD	8,922	97.66	871,322.52	
	KEYERA CORP	8,460	42.87	362,680.20	
	MEG ENERGY CORP	11,500	26.49	304,635.00	
	PARKLAND CORP	6,170	31.69	195,527.30	
	PEMBINA PIPELINE CORP	29,072	58.49	1,700,421.28	
	SUNCOR ENERGY INC	53,489	53.18	2,844,545.02	
	TC ENERGY CORP	45,033	65.65	2,956,416.45	
	TOURMALINE OIL CORP	15,980	63.93	1,021,601.40	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	21,496	118.74	2,552,435.04	
	BARRICK GOLD CORP	84,324	26.11	2,201,699.64	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	82.23	472,822.50	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	18.67	422,875.50	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,125	185.27	1,505,318.75	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	24,510	19.58	479,905.80	
	KINROSS GOLD CORP	55,925	13.90	777,357.50	
	LUNDIN MINING CORP	25,010	13.84	346,138.40	
	NUTRIEN LTD	24,688	70.04	1,729,147.52	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	16,410	31.15	511,171.50	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	21,725	67.57	1,467,958.25	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,450	128.73	315,388.50	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,165	90.77	1,739,607.05	
	CAE INC	12,305	25.92	318,945.60	
	STANTEC INC	5,720	115.35	659,802.00	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,260	119.01	387,972.60	
	WSP GLOBAL INC	5,800	251.17	1,456,786.00	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	21,040	28.80	605,952.00	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	11,710	58.08	680,116.80	
	RB GLOBAL INC	7,560	119.85	906,066.00	
	THOMSON REUTERS CORP	7,350	236.87	1,740,994.50	
	AIR CANADA	7,190	22.18	159,474.20	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	23,418	150.89	3,533,542.02	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	41,421	109.76	4,546,368.96	
	TFI INTERNATIONAL INC	3,210	187.18	600,847.80	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	10,668	58.90	628,345.20	

BRP INC/CA- SUB VOTING	1,570	70.44	110,590.80
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,040	69.50	489,280.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	12,858	94.36	1,213,280.88
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,250	150.32	338,220.00
DOLLARAMA INC	12,990	149.49	1,941,875.10
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	34,600	73.64	2,547,944.00
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	41.18	286,201.00
LOBLAW COMPANIES LTD	6,339	180.77	1,145,901.03
METRO INC	9,570	84.14	805,219.80
WESTON (GEORGE) LTD	2,808	227.29	638,230.32
SAPUTO INC	9,620	26.80	257,816.00
BANK OF MONTREAL	30,681	126.33	3,875,930.73
BANK OF NOVA SCOTIA	52,339	73.52	3,847,963.28
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	42,300	88.23	3,732,129.00
NATIONAL BANK OF CANADA	16,550	132.80	2,197,840.00
ROYAL BANK OF CANADA	61,789	170.42	10,530,081.38
TORONTO-DOMINION BANK	77,700	77.09	5,989,893.00
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	13,859	76.85	1,065,064.15
BROOKFIELD CORP	57,209	77.07	4,409,097.63
IGM FINANCIAL INC	3,335	42.57	141,970.95
ONEX CORPORATION	2,765	102.94	284,629.10
TMX GROUP LTD	10,850	44.40	481,740.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	1,822.67	1,640,403.00
GREAT-WEST LIFECO INC	11,324	47.20	534,492.80
IA FINANCIAL CORP INC	4,075	115.01	468,665.75
INTACT FINANCIAL CORP	7,215	271.81	1,961,109.15
MANULIFE FINANCIAL CORP	84,561	41.49	3,508,435.89
POWER CORP OF CANADA	27,929	45.10	1,259,597.90
SUN LIFE FINANCIAL INC	24,774	79.94	1,980,433.56
CGI INC	9,510	156.11	1,484,606.10
CONSTELLATION SOFTWARE INC	870	4,251.02	3,698,387.40
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,740	149.24	558,157.60
OPEN TEXT CORP	11,190	39.97	447,264.30
SHOPIFY INC - CLASS-A	53,850	110.14	5,931,039.00
BCE INC	3,000	39.92	119,760.00
QUEBECOR INC -CL B	6,110	35.45	216,599.50
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	16,655	51.61	859,564.55
TELUS CORP	12,662	21.61	273,625.82
ALTAGAS LTD	11,170	33.12	369,950.40
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	44.07	239,961.15
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	35.68	162,700.80
EMERA INC	15,550	50.65	787,607.50
FORTIS INC	22,635	60.99	1,380,508.65

	HYDRO ONE LTD	13,230	44.69	591,248.70	
	FIRSTSERVICE CORP	1,500	260.11	390,165.00	
加ドル小計		1,803,243		129,606,189.44 (14,272,233,581)	
ユーロ	ENI SPA	100,696	14.11	1,421,424.73	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	18,755	16.18	303,549.67	
	NESTE OYJ	18,710	14.07	263,249.70	
	OMV AG	5,480	37.70	206,596.00	
	REPSOL SA	54,849	11.94	654,897.06	
	TENARIS SA	23,455	15.46	362,731.57	
	TOTALENERGIES SE	94,227	58.29	5,492,491.83	
	AIR LIQUIDE SA	25,534	166.32	4,246,814.88	
	AKZO NOBEL	6,937	58.08	402,900.96	
	ARCELORMITTAL	20,552	23.03	473,312.56	
	ARKEMA	2,215	80.65	178,639.75	
	BASF SE	41,325	44.05	1,820,366.25	
	COVESTRO AG	7,410	58.00	429,780.00	
	DSM-FIRMENICH AG	8,752	107.15	937,776.80	
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,230	20.10	326,223.00	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	5,715	105.15	600,932.25	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	25,365	10.30	261,259.50	
	SYENSQO SA	2,811	78.17	219,735.87	
	SYMRISE AG	5,790	109.80	635,742.00	
	UPM-KYMMENE OYJ	25,098	27.07	679,402.86	
	VOESTALPINE AG	4,249	19.64	83,450.36	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,876	44.30	348,906.80	
	AIRBUS GROUP SE	26,528	141.82	3,762,200.96	
	ALSTOM	13,962	20.59	287,477.58	
	BOUYGUES SA	8,460	30.37	256,930.20	
	BRENTAG SE	6,865	60.62	416,156.30	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	19,106	84.20	1,608,725.20	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	23,136	38.31	886,340.16	
	DASSAULT AVIATION SA	900	187.60	168,840.00	
	EIFFAGE	3,250	84.58	274,885.00	
	FERROVIAL SE	24,155	36.36	878,275.80	
	GEA GROUP AG	6,020	45.96	276,679.20	
	IMCD NV	2,120	144.45	306,234.00	
	KINGSPAN GROUP PLC	7,300	77.05	562,465.00	
	KNORR-BREMSE AG	2,970	73.15	217,255.50	
	KONE OYJ-B	13,614	51.00	694,314.00	
	LEGRAND SA	11,128	105.25	1,171,222.00	
	LEONARDO SPA	16,300	22.57	367,891.00	
	METSO CORPORATION	24,200	8.65	209,378.40	

MTU AERO ENGINES AG	2,540	311.90	792,226.00
PRYSMIAN SPA	12,035	64.08	771,202.80
RATIONAL AG	230	894.00	205,620.00
REXEL SA	11,150	26.73	298,039.50
RHEINMETALL AG	2,090	480.30	1,003,827.00
SAFRAN SA	14,810	217.20	3,216,732.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	24,348	239.65	5,834,998.20
SIEMENS AG-REG	33,566	184.00	6,176,144.00
SIEMENS ENERGY AG	31,643	38.95	1,232,494.85
THALES SA	4,925	149.95	738,503.75
VINCI SA	23,010	102.10	2,349,321.00
WARTSILA OYJ ABP	25,650	18.40	472,088.25
BUREAU VERITAS SA	16,910	29.66	501,550.60
RANDSTAD NV	4,675	42.23	197,425.25
TELEPERFORMANCE	2,240	100.70	225,568.00
WOLTERS KLUWER	11,667	159.60	1,862,053.20
ADP	1,630	106.10	172,943.00
AENA SA	3,750	201.20	754,500.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	6.19	147,817.20
DEUTSCHE POST AG-REG	46,023	35.84	1,649,464.32
GETLINK	17,310	15.41	266,747.10
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,355	72.62	969,840.10
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,150	67.40	212,310.00
CONTINENTAL AG	4,385	56.20	246,437.00
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	4,380	66.06	289,342.80
FERRARI NV	5,459	407.00	2,221,813.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	34,202	55.90	1,911,891.80
MICHELIN (CGDE)	30,986	31.30	969,861.80
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	38.32	217,274.40
RENAULT SA	8,247	40.89	337,219.83
STELLANTIS NV	98,206	12.65	1,242,305.90
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,083	88.08	800,030.64
ADIDAS AG	7,481	221.10	1,654,049.10
HERMES INTERNATIONAL	1,372	2,079.00	2,852,388.00
KERING	3,537	230.75	816,162.75
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	12,164	602.60	7,330,026.40
MONCLER SPA	10,320	48.95	505,164.00
PUMA SE	4,200	42.41	178,122.00
SEB SA	987	96.30	95,048.10
ACCOR SA	10,106	41.81	422,531.86
AMADEUS IT GROUP SA	21,100	67.88	1,432,268.00
DELIVERY HERO SE	9,610	39.65	381,036.50
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	39.56	154,284.00

SODEXO SA	3,240	81.45	263,898.00
BOLLORE SE	33,530	5.81	194,809.30
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	2,660	96.10	255,626.00
PUBLICIS GROUPE	9,305	101.05	940,270.25
SCOUT24 SE	2,970	83.85	249,034.50
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	36,410	23.16	843,255.60
VIVENDI SE	26,070	9.53	248,551.38
D' IETEREN GROUP	1,050	201.80	211,890.00
INDITEX	45,895	52.54	2,411,323.30
PROSUS NV	62,794	39.83	2,501,398.99
ZALANDO SE	8,260	27.77	229,380.20
CARREFOUR SA	22,633	14.95	338,363.35
JERONIMO MARTINS	10,585	18.21	192,752.85
KESKO OYJ-B SHS	10,930	19.96	218,162.80
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	40,028	30.83	1,234,063.24
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	41,131	53.96	2,219,428.76
DANONE	30,254	66.64	2,016,126.56
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	30,650	6.28	192,482.00
HEINEKEN HOLDING NV	7,005	62.75	439,563.75
HEINEKEN NV	12,733	74.04	942,751.32
JDE PEET'S NV	6,290	19.49	122,592.10
KERRY GROUP PLC-A	6,460	93.85	606,271.00
LOTUS BAKERIES	20	11,960.00	239,200.00
PERNOD-RICARD SA	9,916	113.70	1,127,449.20
BEIERSDORF AG	4,375	127.30	556,937.50
HENKEL AG & CO KGAA	4,520	73.25	331,090.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,793	80.44	546,428.92
L'OREAL	10,646	347.30	3,697,355.80
AMPLIFON SPA	4,830	25.55	123,406.50
BIOMERIEUX	1,690	103.00	174,070.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	56.75	91,367.50
DIASORIN ITALIA SPA	930	101.45	94,348.50
ESSILORLUXOTTICA	12,675	223.60	2,834,130.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	9,583	36.96	354,187.68
FRESENIUS SE & CO KGAA	20,905	33.82	707,007.10
KONINKLIJKE PHILIPS NV	38,028	24.86	945,376.08
SIEMENS HEALTHINEERS AG	13,430	48.38	649,743.40
ARGENX SE	2,495	548.00	1,367,260.00
BAYER AG-REG	43,824	24.58	1,077,193.92
EUROFINS SCIENTIFIC	5,050	45.81	231,340.50
IPSEN	1,600	111.70	178,720.00
MERCK KGAA	5,940	152.45	905,553.00
ORION OYJ-CLASS B	4,500	44.88	201,960.00

QIAGEN N.V.	10,072	39.94	402,275.68
RECORDATI SPA	3,720	51.75	192,510.00
SANOFI	50,646	96.52	4,888,351.92
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,230	238.40	293,232.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	189.00	204,120.00
UCB SA	5,398	179.45	968,671.10
ABN AMRO BANK NV-CVA	23,550	15.38	362,199.00
AIB GROUP PLC	70,100	5.40	378,890.50
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	267,563	9.60	2,570,210.17
BANCO BPM SPA	49,000	6.51	318,990.00
BANCO DE SABADELL SA	232,000	1.87	434,768.00
BANCO SANTANDER SA	694,189	4.63	3,215,136.35
BANK OF IRELAND GROUP PLC	44,790	8.95	400,870.50
BNP PARIBAS	44,242	62.74	2,775,743.08
CAIXABANK S.A	163,050	5.78	943,081.20
COMMERZBANK AG	50,774	16.59	842,594.53
CREDIT AGRICOLE SA	49,662	14.31	710,663.22
ERSTE GROUP BANK AG	15,328	53.28	816,675.84
FINECOBANK SPA	23,540	14.45	340,270.70
ING GROEP NV-CVA	146,925	15.62	2,295,262.35
INTESA SANPAOLO	621,793	4.10	2,549,351.30
KBC GROEP NV	11,219	69.30	777,476.70
MEDIOBANCA SPA	19,520	15.31	298,851.20
NORDEA BANK ABP	131,132	10.89	1,428,027.48
SOCIETE GENERALE	30,909	26.77	827,588.47
UNICREDIT SPA	64,276	42.84	2,753,583.84
ADYEN NV	935	1,399.80	1,308,813.00
AMUNDI SA	2,140	67.15	143,701.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	80,935	15.91	1,288,161.46
DEUTSCHE BOERSE AG	8,250	217.40	1,793,550.00
EDENRED	9,626	30.03	289,068.78
EURAZEO SE	2,497	68.75	171,668.75
EURONEXT NV	3,470	102.50	355,675.00
EXOR NV	4,164	93.05	387,460.20
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,452	66.50	229,558.00
NEXI SPA	21,240	5.72	121,577.76
SOFINA	655	222.80	145,934.00
AEGON LTD	69,679	5.88	409,712.52
AGEAS	5,924	48.68	288,380.32
ALLIANZ SE-REG	17,203	291.90	5,021,555.70
ASR NEDERLAND NV	5,880	45.13	265,364.40
AXA SA	83,692	34.39	2,878,167.88
GENERALI	50,398	25.48	1,284,141.04

HANNOVER RUECK SE-REG	2,775	239.10	663,502.50
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,046	475.30	2,873,663.80
NN GROUP NV	10,270	45.91	471,495.70
POSTE ITALIANE SPA	19,560	13.15	257,214.00
SAMPO OYJ-A SHS	19,639	41.00	805,199.00
TALANX AG	2,500	71.50	178,750.00
BECHTLE AG	3,070	31.90	97,933.00
CAP GEMINI SA	6,509	159.80	1,040,138.20
DASSAULT SYSTEMES SE	30,390	31.53	958,196.70
NEMETSCHKE SE	2,350	99.30	233,355.00
SAP SE	46,042	215.65	9,928,957.30
NOKIA OYJ	251,336	4.29	1,078,231.44
CELLNEX TELECOM SA	24,690	33.41	824,892.90
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	151,666	28.14	4,267,881.24
ELISA OYJ	6,005	43.60	261,818.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	10.19	154,582.30
KONINKLIJKE KPN NV	204,956	3.60	738,456.46
ORANGE S.A.	83,604	10.06	841,474.26
TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.22	91,677.42
TELEFONICA SA	195,629	4.32	845,117.28
ACCIONA SA	830	120.50	100,015.00
E.ON SE	108,799	12.35	1,344,211.64
EDP RENOVAVEIS SA	11,333	12.64	143,249.12
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	126,131	3.57	450,918.32
ELIA GROUP SA/NV	1,356	87.95	119,260.20
ENDESA SA	12,050	19.97	240,638.50
ENEL SPA	344,237	6.99	2,408,970.52
ENGIE	82,214	15.27	1,255,407.78
FORTUM OYJ	16,755	13.69	229,459.72
IBERDROLA SA	272,062	13.74	3,739,492.19
REDEIA CORP SA	20,650	16.71	345,061.50
RWE AG	25,835	30.38	784,867.30
SNAM SPA	91,120	4.40	401,748.08
TERNA SPA	71,827	7.95	571,024.65
VEOLIA ENVIRONNEMENT	31,150	29.47	917,990.50
VERBUND AG	2,780	76.00	211,280.00
ASM INTERNATIONAL NV	2,105	514.40	1,082,812.00
ASML HOLDING NV	17,697	624.00	11,042,928.00
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	3,290	101.95	335,415.50
INFINEON TECHNOLOGIES AG	56,495	29.34	1,657,563.30
STMICROELECTRONICS NV	29,593	24.49	724,732.57
LEG IMMOBILIEN SE	3,010	87.72	264,037.20
VONOVIA SE	33,969	29.83	1,013,295.27

ユーロ小計		8,046,126		224,479,049.85 (37,234,339,998)
英ポンド	BP PLC	739,418	3.85	2,847,498.71
	SHELL PLC-NEW	282,377	26.08	7,365,804.04
	ANGLO AMERICAN PLC	54,004	24.28	1,311,217.12
	ANTOFAGASTA PLC	17,080	17.92	306,159.00
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,131	37.20	228,073.20
	ENDEAVOUR MINING PLC	6,490	16.85	109,356.50
	GLENCORE PLC	453,603	4.07	1,847,978.62
	MONDI PLC	16,700	12.47	208,249.00
	RIO TINTO PLC	49,485	50.25	2,486,621.25
	ASHTED GROUP PLC	20,500	59.68	1,223,440.00
	BAE SYSTEMS PLC ORD	134,535	12.80	1,722,048.00
	BUNZL PLC	17,316	34.58	598,787.28
	DCC PLC	3,820	49.24	188,096.80
	MELROSE INDUSTRIES PLC	63,400	4.98	316,239.20
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	380,331	5.60	2,129,853.60
	SMITHS GROUP PLC	13,603	15.36	208,942.08
	SPIRAX GROUP PLC	2,890	65.10	188,139.00
	EXPERIAN PLC	43,618	38.51	1,679,729.18
	INTERTEK GROUP PLC	6,025	47.42	285,705.50
	RELX PLC	83,125	36.54	3,037,387.50
	RENTOKIL INITIAL PLC	115,300	3.97	458,432.80
	BARRATT REDROW PLC	76,220	4.48	342,075.36
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,356	43.96	191,489.76
	PERSIMMON PLC	12,440	14.71	182,992.40
	TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.45	180,675.04
	COMPASS GROUP PLC	72,268	25.96	1,876,077.28
	ENTAIN PLC	24,860	7.27	180,732.20
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,473	85.54	639,240.42
	PEARSON PLC	26,089	11.85	309,154.65
	WHITBREAD PLC	8,110	30.74	249,301.40
	AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	8.40	306,577.92
	INFORMA PLC	56,580	8.13	459,995.40
	WPP PLC	41,144	8.36	343,963.84
	JD SPORTS FASHION PLC	97,350	1.23	119,837.85
	KINGFISHER PLC	78,137	2.97	232,613.84
	NEXT PLC	5,667	100.40	568,966.80
	SAINSBURY (J) PLC	70,601	2.66	187,798.66
	TESCO PLC	338,158	3.53	1,196,741.16
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,295	23.62	432,127.90
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	84,677	27.21	2,304,061.17
	COCA-COLA HBC AG-CDI	11,230	27.72	311,295.60

	DIAGEO PLC	95,292	23.65	2,253,655.80
	IMPERIAL BRANDS PLC	38,792	23.84	924,801.28
	HALEON PLC	298,551	3.68	1,099,563.33
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	30,695	49.59	1,522,165.05
	UNILEVER PLC	109,872	47.26	5,192,550.72
	NMC HEALTH PLC	8,090	-	-
	SMITH & NEPHEW PLC	33,906	9.66	327,599.77
	ASTRAZENECA PLC	68,352	101.14	6,913,121.28
	GSK PLC	182,410	13.91	2,538,235.15
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,740	18.20	104,468.00
	BARCLAYS PLC	639,751	2.44	1,566,750.19
	HSBC HOLDINGS PLC	833,261	7.22	6,019,477.46
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,972,636	0.54	1,630,788.10
	NATWEST GROUP PLC	275,835	3.86	1,066,653.94
	STANDARD CHARTERED PLC	95,420	9.32	889,505.24
	3I GROUP PLC	40,649	33.40	1,357,676.60
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	20,707	108.80	2,252,921.60
	M&G PLC	99,522	1.96	195,710.01
	SCHRODERS PLC	30,300	3.13	95,081.40
	WISE PLC - A	29,200	7.70	224,986.00
	ADMIRAL GROUP PLC	12,845	25.43	326,648.35
	AVIVA PLC	134,324	4.59	617,218.78
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	294,051	2.20	648,382.45
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,230	4.95	149,880.34
	PRUDENTIAL PLC	121,002	6.48	784,092.96
	SAGE GROUP PLC/THE	49,540	9.90	490,545.08
	HALMA PLC	14,690	25.18	369,894.20
	BT GROUP PLC	267,752	1.47	394,666.44
	VODAFONE GROUP PLC	996,528	0.72	722,084.18
	CENTRICA PLC	209,200	1.15	241,939.80
	NATIONAL GRID PLC	204,765	9.91	2,030,040.21
	SEVERN TRENT PLC	13,573	26.48	359,413.04
	SSE PLC	53,447	17.50	935,589.73
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	10.59	276,582.47
	英債券小計	12,041,009		83,886,165.98 (16,628,754,682)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,990	12.16	97,158.40
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	671.50	181,305.00
	GIVAUDAN-REG	423	4,049.00	1,712,727.00
	HOLCIM LTD	22,219	87.76	1,949,939.44
	SIG GROUP AG	10,900	18.69	203,721.00
	SIKA AG-REG	6,605	242.20	1,599,731.00
	ABB LTD-REG	70,005	49.47	3,463,147.35

GEBERIT AG-REG	1,490	529.40	788,806.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,070	249.50	266,965.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	255.80	378,584.00	
VAT GROUP AG	1,295	359.80	465,941.00	
ADECCO GROUP AG-REG	6,817	25.40	173,151.80	
SGS SA-REG	5,950	92.26	548,947.00	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,810	213.20	599,092.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	23,819	124.15	2,957,128.85	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,525	174.45	266,036.25	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,950	34.55	67,372.50	
AVOLTA AG	3,460	34.18	118,262.80	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	130	1,542.00	200,460.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	40	10,260.00	410,400.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	101,400.00	507,000.00	
NESTLE SA-REG	117,690	80.82	9,511,705.80	
ALCON INC	22,714	80.00	1,817,120.00	
SONOVA HOLDING AG-REG	2,051	323.10	662,678.10	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,520	118.10	651,912.00	
BACHEM HOLDING AG	1,400	74.60	104,440.00	
GALDERMA GROUP AG	2,090	82.84	173,135.60	
LONZA GROUP AG-REG	3,333	543.60	1,811,818.80	
NOVARTIS AG-REG	86,923	93.98	8,169,023.54	
ROCHE HOLDING AG-BR	1,640	293.60	481,504.00	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	30,993	268.30	8,315,421.90	
SANDOZ GROUP AG	21,268	39.94	849,443.92	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,510	86.05	129,935.50	
JULIUS BAER GROUP LTD	8,420	54.38	457,879.60	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	995	1,198.50	1,192,507.50	
UBS GROUP AG-REG	146,722	27.39	4,018,715.58	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,740	168.10	292,494.00	
HELVETIA HOLDING AG-REG	1,320	146.80	193,776.00	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,285	716.00	920,060.00	
SWISS RE AG	14,419	112.10	1,616,369.90	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,521	517.20	3,372,661.20	
TEMENOS AG	2,280	59.95	136,686.00	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	72.44	482,450.40	
SWISSCOM AG-REG	1,024	529.00	541,696.00	
BKW AG	840	153.60	129,024.00	
SWISS PRIME SITE-REG	3,441	94.50	325,174.50	
スイスフラン小計	663,052		63,313,510.23 (11,152,041,691)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	10,290	342.90	3,528,441.00
	HOLMEN AB-B SHARES	3,520	421.20	1,482,624.00

SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	22,680	142.15	3,223,962.00
ADDTECH AB-B SHARES	11,400	311.80	3,554,520.00
ALFA LAVAL AB	15,220	474.30	7,218,846.00
ASSA ABLOY AB-B	42,940	340.00	14,599,600.00
ATLAS COPCO AB-A SHS	122,590	178.10	21,833,279.00
ATLAS COPCO AB-B SHS	67,170	157.10	10,552,407.00
BEIJER REF AB	15,480	175.80	2,721,384.00
EPIROC AB-A	31,565	210.30	6,638,119.50
EPIROC AB-B	15,450	186.20	2,876,790.00
HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	68.30	1,024,500.00
INDUTRADE AB	10,180	291.00	2,962,380.00
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	297.30	2,021,640.00
LIFCO AB-B SHS	8,470	324.40	2,747,668.00
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	63,000	54.80	3,452,400.00
SAAB AB-B	11,120	228.45	2,540,364.00
SANDVIK AB	49,820	209.70	10,447,254.00
SKANSKA AB-B SHS	14,390	220.00	3,165,800.00
SKF AB-B SHARES-B	14,079	208.40	2,934,063.60
TRELLEBORG AB-B SHS	9,190	361.80	3,324,942.00
VOLVO AB-A SHS	9,530	280.60	2,674,118.00
VOLVO AB-B SHS-B	70,890	278.80	19,764,132.00
SECURITAS AB-B SHS	17,788	127.55	2,268,859.40
VOLVO CAR AB-B	39,400	22.97	905,018.00
EVOLUTION AB	8,150	995.00	8,109,250.00
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,848	162.00	4,511,376.00
ESSITY AKTIEBOLAG-B	29,035	303.70	8,817,929.50
GETINGE AB-B SHS	9,470	188.85	1,788,409.50
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	8,148	326.20	2,657,877.60
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	72,400	154.85	11,211,140.00
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60,120	114.25	6,868,710.00
SWEDBANK AB - A SHARES	34,550	221.90	7,666,645.00
EQT AB	17,960	306.00	5,495,760.00
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	368.20	1,835,108.80
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	367.60	2,198,248.00
INVESTOR AB-B SHS	79,850	303.50	24,234,475.00
LUNDBERGS AB-B SHS	3,590	529.00	1,899,110.00
ERICSSON LM-B SHS	114,915	89.06	10,234,329.90
HEXAGON AB-B SHS	94,990	100.40	9,536,996.00
TELE2 AB-B SHS	23,245	111.50	2,591,817.50
TELIA CO AB	118,530	31.83	3,772,809.90
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	23,220	84.30	1,957,446.00
SAGAX AB-B	11,880	251.40	2,986,632.00
	1,446,827		256,837,182.20

スウェーデンクローナ小計				(3,644,519,615)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	12,100	228.20	2,761,220.00	
	EQUINOR ASA	39,014	260.40	10,159,245.60	
	NORSK HYDRO A S	50,660	70.24	3,558,358.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,670	334.20	2,229,114.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,900	1,135.00	4,426,500.00	
	MOWI ASA	16,360	190.95	3,123,942.00	
	ORKLA ASA	32,290	102.00	3,293,580.00	
	SALMAR ASA	3,590	547.00	1,963,730.00	
	DNB BANK ASA	45,435	230.20	10,459,137.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,410	198.60	1,471,626.00	
	TELENOR ASA	23,915	136.10	3,254,831.50	
ノルウェークローネ小計		241,344		46,701,284.50	(647,746,816)
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	16,690	427.00	7,126,630.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	315	2,960.00	932,400.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	47,690	119.35	5,691,801.50	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	115	11,020.00	1,267,300.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	195	11,455.00	2,233,725.00	
	DSV A/S	8,890	1,508.00	13,406,120.00	
	PANDORA A/S	3,310	1,059.50	3,506,945.00	
	CARLSBERG AS-B	3,910	745.60	2,915,296.00	
	COLOPLAST-B	6,475	886.00	5,736,850.00	
	DEMANT A/S	3,640	256.20	932,568.00	
	GENMAB A/S	2,920	1,518.00	4,432,560.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	142,520	745.40	106,234,408.00	
	ZEALAND PHARMA A/S	2,810	827.00	2,323,870.00	
	DANSKE BANK A/S	31,185	209.70	6,539,494.50	
	TRYG A/S	13,945	161.90	2,257,695.50	
ORSTED A/S	7,570	419.70	3,177,129.00		
デンマーククローネ小計		292,180		168,714,792.50	(3,752,216,985)
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	28.02	245,875.50	
	SANTOS LTD	151,760	6.79	1,030,450.40	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	84,316	23.90	2,015,152.40	
	BHP GROUP LTD	225,267	42.63	9,603,132.21	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	20.56	376,453.60	
	FORTESCUE LTD	73,745	19.09	1,407,792.05	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	20,365	47.99	977,316.35	
	MINERAL RESOURCES LTD	7,320	38.20	279,624.00	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	53,090	17.72	940,754.80	
	ORICA LIMITED	17,675	17.16	303,303.00	
	PILBARA MINERALS LTD	114,530	3.00	343,590.00	

RIO TINTO LTD	16,698	119.42	1,994,075.16		
SOUTH32 LTD	207,787	3.75	779,201.25		
REECE LTD	10,200	22.63	230,826.00		
SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	8,410	42.33	355,995.30		
BRAMBLES LTD	54,798	18.57	1,017,598.86		
COMPUTERSHARE LTD	20,910	26.59	555,996.90		
QANTAS AIRWAYS LTD	35,030	8.27	289,698.10		
TRANSURBAN GROUP	151,796	12.87	1,953,614.52		
ARISTOCRAT LEISURE LTD	29,060	62.43	1,814,215.80		
LOTTERY CORP LTD/THE	85,554	5.01	428,625.54		
CAR GROUP LTD	14,500	38.17	553,465.00		
REA GROUP LTD	1,820	230.00	418,600.00		
SEEK LTD	12,860	24.74	318,156.40		
WESFARMERS LTD	47,855	66.64	3,189,057.20		
COLES GROUP LTD	57,925	17.51	1,014,266.75		
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	82,662	4.69	387,684.78		
WOOLWORTHS GROUP LTD	54,692	29.64	1,621,070.88		
TREASURY WINE ESTATES LTD	43,206	11.28	487,363.68		
COCHLEAR LTD	2,947	287.29	846,643.63		
PRO MEDICUS LTD	2,450	194.82	477,309.00		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,105	39.27	279,013.35		
SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	26.63	470,285.80		
CSL LTD	21,382	283.99	6,072,274.18		
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	126,149	31.10	3,923,233.90		
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	74,307	143.85	10,689,061.95		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	135,333	38.64	5,229,267.12		
WESTPAC BANKING CORP	148,101	31.92	4,727,383.92		
ASX LTD	7,105	64.30	456,851.50		
MACQUARIE GROUP LTD	16,084	218.21	3,509,689.64		
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,370	32.65	273,280.50		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	7.39	702,973.75		
MEDIBANK PRIVATE LTD	108,430	3.60	390,348.00		
QBE INSURANCE GROUP LTD	70,410	17.01	1,197,674.10		
SUNCORP GROUP LTD	55,536	17.73	984,653.28		
WISETECH GLOBAL LTD	7,450	121.18	902,791.00		
XERO LTD	5,960	150.30	895,788.00		
TELSTRA GROUP LTD	164,284	3.87	635,779.08		
APA GROUP	69,418	6.91	479,678.38		
ORIGIN ENERGY LTD	93,120	9.79	911,644.80		
豪ドル小計	2,947,642		78,988,581.31 (7,967,578,196)		
ニュージーランド ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,165	7.42	349,964.30	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,130	36.66	847,945.80	

	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	2.97	227,433.69	
	MERCURY NZ LTD	34,100	6.58	224,378.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	57,830	5.99	346,401.70	
ニュージーランドドル小計		238,802		1,996,123.49 (182,206,152)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	125,708	41.35	5,198,025.80	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	17,517	66.80	1,170,135.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	58,500	113.90	6,663,150.00	
	MTR CORP	62,500	28.85	1,803,125.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	22.60	1,175,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	91,000	35.65	3,244,150.00	
	SANDS CHINA LTD	96,600	21.05	2,033,430.00	
	WH GROUP LTD	450,894	6.01	2,709,872.94	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	203,500	26.15	5,321,525.00	
	HANG SENG BANK LTD	36,900	96.55	3,562,695.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	52,800	330.40	17,445,120.00	
	AIA GROUP LTD	482,390	62.70	30,245,853.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	9.79	1,468,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	53.50	1,337,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	71,500	67.05	4,794,075.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	456,237	6.14	2,801,295.18	
	POWER ASSETS HOLDINGS	58,000	51.40	2,981,200.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	80,538	32.65	2,629,565.70	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	25.95	1,502,530.95	
	SINO LAND CO	189,050	7.92	1,497,276.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,480	86.20	5,213,376.00		
WHARF HOLDINGS LTD	43,000	22.95	986,850.00		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	24.00	1,531,200.00		
香港ドル小計		2,985,815		107,315,651.17 (2,109,825,702)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	68,560	6.40	438,784.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	63,300	4.54	287,382.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	6.48	349,272.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.84	177,324.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	3.13	231,494.80	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	84,034	39.09	3,284,889.06	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	150,740	15.11	2,277,681.40	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	57,300	32.13	1,841,049.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	11.41	484,925.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	354,480	3.16	1,120,156.80	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	30,200	5.06	152,812.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	105,000	2.91	305,550.00	
		1,295,074		10,951,320.06	

シンガポールドル小計				(1,267,396,270)
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	39,490	16.25	641,712.50
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,010	887.00	895,870.00
	BANK HAPOALIM BM	50,495	40.37	2,038,483.15
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	62,565	38.37	2,400,619.05
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	48,330	22.50	1,087,425.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,900	156.10	1,077,090.00
	NICE LTD	3,040	645.50	1,962,320.00
	AZRIELI GROUP LTD	1,780	290.30	516,734.00
イスラエルシュケル小計		213,610		10,620,253.70 (433,006,859)
合 計		48,480,445		434,547,773,298 (434,547,773,298)

(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	786,634.40	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	12,110	428,694.00	
		AMERICAN TOWER CORP	20,829	4,454,281.65	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	18,847	363,181.69	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,790	1,310,740.20	
		BXP INC	5,717	465,249.46	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,810	567,580.00	
		CROWN CASTLE INC	18,590	2,020,733.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,395	2,605,782.90	
		EQUINIX INC	4,208	3,825,029.92	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	9,580	671,462.20	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	15,450	1,112,863.50	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,020	878,820.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	9,880	1,665,175.20	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,340	575,845.20	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36,875	830,056.25	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	33,579	592,669.35	
		INVITATION HOMES INC	25,700	829,082.00	
		IRON MOUNTAIN INC	13,365	1,680,381.45	
		KIMCO REALTY CORP	29,910	737,281.50	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,630	872,818.90	
		PROLOGIS INC	40,885	4,678,470.55	
		PUBLIC STORAGE	6,849	2,332,769.40	
		REALTY INCOME CORP	39,211	2,306,391.02	
REGENCY CENTERS CORP	7,565	553,455.40			
SBA COMMUNICATIONS CORP	4,735	1,081,284.60			

		SIMON PROPERTY GROUP INC	15,054	2,625,267.06	
		SUN COMMUNITIES INC	5,920	788,662.40	
		UDR INC	12,100	522,962.00	
		VENTAS INC	17,025	1,097,601.75	
		VICI PROPERTIES INC	45,610	1,461,344.40	
		WELLTOWER INC	27,660	3,737,419.20	
		WEYERHAEUSER CO	29,998	956,036.26	
		WP CAREY INC	8,610	480,265.80	
米ドル小計			567,757	49,896,292.61	(7,626,648,325)
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	128,688.00	
	投資証券小計		2,800	128,688.00	(14,171,122)
加ドル小計			3,610	128,688.00	(14,171,122)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	100,773.75	
		GECINA SA	1,950	189,247.50	
		KLEPIERRE	8,402	242,313.68	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,990	370,856.80	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,730	165,731.20	
ユーロ小計			24,997	1,068,922.93	(177,302,246)
英ポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	158,412.80	
		SEGRO PLC	65,733	515,872.58	
英ポンド小計			92,357	674,285.38	(133,663,590)
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	42,067	300,358.38	
		GOODMAN GROUP	70,642	2,564,304.60	
		GPT GROUP	71,335	335,987.85	
		MIRVAC GROUP	159,875	345,330.00	
		SCENTRE GROUP	280,871	974,622.37	
		STOCKLAND	102,400	527,360.00	
		VICINITY CENTRES	154,902	333,039.30	
豪ドル小計			882,092	5,381,002.50	(542,781,722)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	104,160	3,869,544.00	
香港ドル小計			104,160	3,869,544.00	(76,075,235)
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,243	371,873.67	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	221,291	447,007.82	
シンガポールドル小計			359,534	818,881.49	(94,769,154)

合計	8,665,411,394
	(8,665,411,394)

(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%			75.9%
	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%			2.5%
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%			0.8%
豪ドル	株式 50銘柄	93.6%			1.8%
	投資証券 7銘柄			6.4%	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%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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11月 6日現在	2024年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	53,075,666	148,041,415
国債証券	44,231,096,480	48,618,222,970
地方債証券	2,727,118,380	2,393,913,882
特殊債券	2,500,538,000	1,989,440,676
社債券	1,295,094,000	2,118,219,918
未収利息	102,092,835	111,755,447
前払費用	1,936,952	5,037,437
流動資産合計	50,910,952,313	55,384,631,745

2023年11月 6日現在

2024年11月 6日現在

資産合計	50,910,952,313	55,384,631,745
負債の部		
流動負債		
未払解約金	22,903,111	10,898,657
未払利息	9	-
流動負債合計	22,903,120	10,898,657
負債合計	22,903,120	10,898,657
純資産の部		
元本等		
元本	38,488,019,140	42,108,169,838
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	12,400,030,053	13,265,563,250
元本等合計	50,888,049,193	55,373,733,088
純資産合計	50,888,049,193	55,373,733,088
負債純資産合計	50,910,952,313	55,384,631,745

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
1.	期首	2022年11月 8日	2023年11月 7日
	期首元本額	35,316,879,855円	38,488,019,140円
	期首からの追加設定元本額	4,833,830,321円	6,643,373,019円
	期首からの一部解約元本額	1,662,691,036円	3,023,222,321円
	元本の内訳		
	D C インデックスバランス（株式 2 0）	5,699,306,266円	6,711,526,424円
	D C インデックスバランス（株式 4 0）	5,467,907,582円	6,487,652,576円
	D C インデックスバランス（株式 6 0）	4,301,495,149円	5,406,430,000円
	D C インデックスバランス（株式 8 0）	771,286,086円	1,046,210,157円
	インデックスファンド日本債券（D C 専用）	2,209,100,357円	2,168,132,973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
	T r a c e r s グローバル 3 分法（おとなのバランス）	15,166,730円	41,834,402円
	N i つみインデックスラップ世界 1 0 指数（均等型）	1,006,379円	2,993,339円
	N i つみインデックスラップ世界 1 0 指数（安定成長型）	1,134,007円	2,535,893円
	国際分散型ファンド 4 0（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 2 0）	1,573,090,800円	1,678,396,699円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 4 0）	1,582,207,086円	1,774,689,724円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 6 0）	932,525,480円	1,090,871,564円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 8 0）	140,336,480円	168,510,780円
	インデックスファンド日本債券（1 年決算型）	5,934,750,434円	5,693,402,266円
	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	408,532,559円	426,321,563円
	計	38,488,019,140円	42,108,169,838円

2. 受益権の総数	38,488,019,140口	42,108,169,838口
-----------	-----------------	-----------------

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2022年11月 8日 至 2023年11月 6日	自 2023年11月 7日 至 2024年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、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11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

(2024年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	35,680,840
地方債証券	1,390,862
特殊債券	1,047,324
社債券	1,703,079
合計	39,822,105

(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11月 6日現在		2024年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.3222円	1口当たり純資産額	1.3150円
(1万口当たり純資産額)	(13,222円)	(1万口当たり純資産額)	(13,150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 4 5 5 回利付国債 (2 年)	100,000,000	99,638,000	
	第 4 5 6 回利付国債 (2 年)	100,000,000	99,702,000	
	第 4 5 7 回利付国債 (2 年)	150,000,000	149,491,500	
	第 4 5 8 回利付国債 (2 年)	130,000,000	129,676,300	
	第 4 6 0 回利付国債 (2 年)	100,000,000	99,823,000	
	第 4 6 1 回利付国債 (2 年)	150,000,000	149,929,500	
	第 4 6 3 回利付国債 (2 年)	150,000,000	149,871,000	
	第 1 4 9 回利付国債 (5 年)	100,000,000	99,157,000	
	第 1 5 0 回利付国債 (5 年)	50,000,000	49,517,500	
	第 1 5 1 回利付国債 (5 年)	290,000,000	286,879,600	
	第 1 5 2 回利付国債 (5 年)	100,000,000	99,146,000	
	第 1 5 3 回利付国債 (5 年)	300,000,000	296,394,000	
	第 1 5 5 回利付国債 (5 年)	100,000,000	99,386,000	
	第 1 5 6 回利付国債 (5 年)	200,000,000	198,158,000	
	第 1 5 7 回利付国債 (5 年)	150,000,000	148,437,000	
	第 1 5 8 回利付国債 (5 年)	230,000,000	226,842,100	
	第 1 5 9 回利付国債 (5 年)	150,000,000	147,711,000	
	第 1 6 0 回利付国債 (5 年)	120,000,000	118,594,800	
	第 1 6 1 回利付国債 (5 年)	120,000,000	119,019,600	
	第 1 6 2 回利付国債 (5 年)	130,000,000	128,792,300	
	第 1 6 3 回利付国債 (5 年)	270,000,000	268,515,000	
	第 1 6 4 回利付国債 (5 年)	130,000,000	128,116,300	
	第 1 6 5 回利付国債 (5 年)	130,000,000	128,638,900	
	第 1 6 6 回利付国債 (5 年)	140,000,000	139,098,400	
	第 1 6 7 回利付国債 (5 年)	120,000,000	119,104,800	
	第 1 6 8 回利付国債 (5 年)	150,000,000	150,159,000	
	第 1 7 0 回利付国債 (5 年)	150,000,000	150,033,000	
	第 1 7 1 回利付国債 (5 年)	100,000,000	99,123,000	
	第 1 7 2 回利付国債 (5 年)	200,000,000	199,146,000	
	第 1 回利付国債 (4 0 年)		70,000,000	75,418,700

第2回利付国債(40年)	125,000,000	129,201,250	
第3回利付国債(40年)	85,000,000	87,199,800	
第4回利付国債(40年)	115,000,000	117,249,400	
第5回利付国債(40年)	95,000,000	92,305,800	
第6回利付国債(40年)	110,000,000	103,782,800	
第7回利付国債(40年)	130,000,000	116,226,500	
第8回利付国債(40年)	115,000,000	94,386,250	
第9回利付国債(40年)	210,000,000	123,566,100	
第10回利付国債(40年)	175,000,000	120,802,500	
第11回利付国債(40年)	140,000,000	91,938,000	
第12回利付国債(40年)	175,000,000	100,546,250	
第13回利付国債(40年)	210,000,000	117,789,000	
第14回利付国債(40年)	210,000,000	124,912,200	
第15回利付国債(40年)	230,000,000	150,551,100	
第16回利付国債(40年)	220,000,000	157,361,600	
第17回利付国債(40年)	80,000,000	74,352,800	
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	59,359,800	
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	68,877,900	
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	50,258,000	
第341回利付国債(10年)	700,000,000	699,531,000	
第342回利付国債(10年)	630,000,000	627,473,700	
第343回利付国債(10年)	645,000,000	641,478,300	
第344回利付国債(10年)	700,000,000	695,331,000	
第345回利付国債(10年)	660,000,000	654,944,400	
第346回利付国債(10年)	460,000,000	456,071,600	
第347回利付国債(10年)	680,000,000	673,492,400	
第348回利付国債(10年)	500,000,000	494,550,000	
第349回利付国債(10年)	590,000,000	582,754,800	
第350回利付国債(10年)	540,000,000	532,585,800	
第351回利付国債(10年)	435,000,000	428,361,900	
第352回利付国債(10年)	420,000,000	412,918,800	
第353回利付国債(10年)	400,000,000	392,592,000	
第354回利付国債(10年)	325,000,000	318,357,000	
第355回利付国債(10年)	350,000,000	342,289,500	
第356回利付国債(10年)	350,000,000	341,558,000	
第357回利付国債(10年)	560,000,000	545,686,400	
第358回利付国債(10年)	390,000,000	379,470,000	
第359回利付国債(10年)	420,000,000	408,034,200	
第360回利付国債(10年)	580,000,000	562,443,400	
第361回利付国債(10年)	460,000,000	445,243,200	

第362回利付国債(10年)	400,000,000	386,316,000	
第363回利付国債(10年)	500,000,000	481,790,000	
第364回利付国債(10年)	500,000,000	480,650,000	
第365回利付国債(10年)	410,000,000	393,185,900	
第366回利付国債(10年)	480,000,000	462,542,400	
第367回利付国債(10年)	420,000,000	403,498,200	
第368回利付国債(10年)	450,000,000	431,127,000	
第369回利付国債(10年)	490,000,000	479,523,800	
第370回利付国債(10年)	420,000,000	409,957,800	
第371回利付国債(10年)	480,000,000	463,214,400	
第372回利付国債(10年)	500,000,000	497,935,000	
第373回利付国債(10年)	440,000,000	429,237,600	
第374回利付国債(10年)	410,000,000	405,932,800	
第375回利付国債(10年)	280,000,000	283,950,800	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	55,242,500	
第3回利付国債(30年)	70,000,000	76,411,300	
第5回利付国債(30年)	80,000,000	87,851,200	
第6回利付国債(30年)	50,000,000	55,868,000	
第7回利付国債(30年)	50,000,000	55,763,000	
第8回利付国債(30年)	170,000,000	183,674,800	
第9回利付国債(30年)	70,000,000	73,453,100	
第10回利付国債(30年)	50,000,000	51,216,000	
第11回利付国債(30年)	70,000,000	75,107,900	
第12回利付国債(30年)	50,000,000	55,336,500	
第13回利付国債(30年)	180,000,000	197,598,600	
第14回利付国債(30年)	108,000,000	122,413,680	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	167,963,670	
第16回利付国債(30年)	65,000,000	74,291,100	
第17回利付国債(30年)	50,000,000	56,718,000	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	123,719,200	
第19回利付国債(30年)	40,000,000	44,968,800	
第20回利付国債(30年)	60,000,000	68,688,000	
第21回利付国債(30年)	70,000,000	78,710,800	
第22回利付国債(30年)	70,000,000	80,223,500	
第23回利付国債(30年)	75,000,000	85,947,750	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	77,911,680	
第25回利付国債(30年)	60,000,000	67,374,000	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	192,793,600	
第27回利付国債(30年)	89,000,000	101,896,990	
第28回利付国債(30年)	144,000,000	164,705,760	
第29回利付国債(30年)	176,000,000	198,748,000	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	163,800,630	

第3 1 回利付国債(30年)	160,000,000	175,752,000	
第3 2 回利付国債(30年)	160,000,000	177,310,400	
第3 3 回利付国債(30年)	195,000,000	207,363,000	
第3 4 回利付国債(30年)	180,000,000	195,910,200	
第3 5 回利付国債(30年)	193,000,000	203,794,490	
第3 6 回利付国債(30年)	195,000,000	205,180,950	
第3 7 回利付国債(30年)	211,000,000	217,977,770	
第3 8 回利付国債(30年)	135,000,000	136,792,800	
第3 9 回利付国債(30年)	135,000,000	138,622,050	
第4 0 回利付国債(30年)	100,000,000	100,852,000	
第4 1 回利付国債(30年)	130,000,000	128,700,000	
第4 2 回利付国債(30年)	135,000,000	133,251,750	
第4 3 回利付国債(30年)	125,000,000	123,097,500	
第4 4 回利付国債(30年)	130,000,000	127,630,100	
第4 5 回利付国債(30年)	140,000,000	132,330,800	
第4 6 回利付国債(30年)	160,000,000	150,824,000	
第4 7 回利付国債(30年)	155,000,000	148,330,350	
第4 8 回利付国債(30年)	135,000,000	124,170,300	
第4 9 回利付国債(30年)	140,000,000	128,289,000	
第5 0 回利付国債(30年)	165,000,000	133,364,550	
第5 1 回利付国債(30年)	160,000,000	114,624,000	
第5 2 回利付国債(30年)	190,000,000	141,994,600	
第5 3 回利付国債(30年)	135,000,000	102,709,350	
第5 4 回利付国債(30年)	160,000,000	126,899,200	
第5 5 回利付国債(30年)	140,000,000	110,566,400	
第5 6 回利付国債(30年)	140,000,000	110,096,000	
第5 7 回利付国債(30年)	190,000,000	148,781,400	
第5 8 回利付国債(30年)	180,000,000	140,351,400	
第5 9 回利付国債(30年)	170,000,000	128,766,500	
第6 0 回利付国債(30年)	120,000,000	94,989,600	
第6 1 回利付国債(30年)	130,000,000	97,506,500	
第6 2 回利付国債(30年)	120,000,000	84,945,600	
第6 3 回利付国債(30年)	120,000,000	82,161,600	
第6 4 回利付国債(30年)	130,000,000	88,475,400	
第6 5 回利付国債(30年)	140,000,000	94,710,000	
第6 6 回利付国債(30年)	180,000,000	120,951,000	
第6 7 回利付国債(30年)	165,000,000	116,772,150	
第6 8 回利付国債(30年)	140,000,000	98,600,600	
第6 9 回利付国債(30年)	145,000,000	104,502,950	
第7 0 回利付国債(30年)	140,000,000	100,433,200	
第7 1 回利付国債(30年)	160,000,000	114,244,800	
第7 2 回利付国債(30年)	160,000,000	113,710,400	

第73回利付国債(30年)	150,000,000	106,107,000	
第74回利付国債(30年)	150,000,000	114,840,000	
第75回利付国債(30年)	150,000,000	123,726,000	
第76回利付国債(30年)	150,000,000	126,427,500	
第77回利付国債(30年)	130,000,000	114,754,900	
第78回利付国債(30年)	150,000,000	125,746,500	
第79回利付国債(30年)	140,000,000	111,120,800	
第80回利付国債(30年)	130,000,000	119,447,900	
第81回利付国債(30年)	150,000,000	131,116,500	
第82回利付国債(30年)	150,000,000	137,335,500	
第83回利付国債(30年)	150,000,000	150,000,000	
第84回利付国債(30年)	50,000,000	48,878,500	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	133,192,800	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	308,979,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	16,517,280	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	258,545,000	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	62,063,400	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	62,168,400	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	51,924,000	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	85,899,920	
第96回利付国債(20年)	248,000,000	258,480,480	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	47,196,450	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	98,322,120	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	122,784,480	
第100回利付国債(20年)	80,000,000	84,499,200	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	70,148,760	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	86,420,520	
第103回利付国債(20年)	71,000,000	75,499,270	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	34,856,910	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	81,582,270	
第106回利付国債(20年)	62,000,000	65,924,600	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	138,140,600	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	141,312,380	
第109回利付国債(20年)	107,000,000	113,107,560	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	104,428,800	
第111回利付国債(20年)	95,000,000	101,941,650	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	85,486,400	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	310,723,400	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	55,900,520	
第115回利付国債(20年)	125,000,000	134,997,500	
第116回利付国債(20年)	135,000,000	146,300,850	
第117回利付国債(20年)	243,000,000	262,077,930	

第118回利付国債(20年)	70,000,000	75,324,200	
第119回利付国債(20年)	60,000,000	63,912,000	
第120回利付国債(20年)	170,000,000	179,186,800	
第121回利付国債(20年)	142,000,000	152,377,360	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	18,146,140	
第123回利付国債(20年)	195,000,000	212,072,250	
第124回利付国債(20年)	90,000,000	97,348,500	
第125回利付国債(20年)	90,000,000	98,705,700	
第126回利付国債(20年)	105,000,000	113,836,800	
第127回利付国債(20年)	50,000,000	53,902,000	
第128回利付国債(20年)	135,000,000	145,797,300	
第129回利付国債(20年)	85,000,000	91,258,550	
第130回利付国債(20年)	150,000,000	161,287,500	
第131回利付国債(20年)	92,000,000	98,318,560	
第132回利付国債(20年)	135,000,000	144,445,950	
第133回利付国債(20年)	130,000,000	139,980,100	
第134回利付国債(20年)	120,000,000	129,379,200	
第135回利付国債(20年)	70,000,000	74,980,500	
第136回利付国債(20年)	70,000,000	74,463,900	
第137回利付国債(20年)	100,000,000	107,153,000	
第138回利付国債(20年)	120,000,000	126,804,000	
第139回利付国債(20年)	100,000,000	106,430,000	
第140回利付国債(20年)	318,000,000	341,077,260	
第141回利付国債(20年)	235,000,000	252,082,150	
第142回利付国債(20年)	165,000,000	178,323,750	
第143回利付国債(20年)	154,000,000	163,979,200	
第144回利付国債(20年)	130,000,000	137,348,900	
第145回利付国債(20年)	215,000,000	230,688,550	
第146回利付国債(20年)	195,000,000	209,186,250	
第147回利付国債(20年)	208,000,000	221,106,080	
第148回利付国債(20年)	220,000,000	231,598,400	
第149回利付国債(20年)	225,000,000	236,423,250	
第150回利付国債(20年)	250,000,000	259,915,000	
第151回利付国債(20年)	240,000,000	244,634,400	
第152回利付国債(20年)	250,000,000	254,217,500	
第153回利付国債(20年)	270,000,000	276,577,200	
第154回利付国債(20年)	230,000,000	232,796,800	
第155回利付国債(20年)	270,000,000	267,059,700	
第156回利付国債(20年)	200,000,000	184,552,000	
第157回利付国債(20年)	220,000,000	197,267,400	
第158回利付国債(20年)	230,000,000	212,720,100	
第159回利付国債(20年)	210,000,000	195,736,800	

第160回利付国債(20年)	210,000,000	197,311,800	
第161回利付国債(20年)	180,000,000	166,341,600	
第162回利付国債(20年)	210,000,000	193,260,900	
第163回利付国債(20年)	195,000,000	178,600,500	
第164回利付国債(20年)	255,000,000	229,420,950	
第165回利付国債(20年)	200,000,000	179,004,000	
第166回利付国債(20年)	180,000,000	164,791,800	
第167回利付国債(20年)	200,000,000	177,110,000	
第168回利付国債(20年)	180,000,000	156,322,800	
第169回利付国債(20年)	190,000,000	161,600,700	
第170回利付国債(20年)	160,000,000	135,259,200	
第171回利付国債(20年)	170,000,000	142,835,700	
第172回利付国債(20年)	230,000,000	195,237,800	
第173回利付国債(20年)	190,000,000	160,310,600	
第174回利付国債(20年)	200,000,000	167,820,000	
第175回利付国債(20年)	200,000,000	169,744,000	
第176回利付国債(20年)	190,000,000	160,398,000	
第177回利付国債(20年)	200,000,000	165,030,000	
第178回利付国債(20年)	220,000,000	183,823,200	
第179回利付国債(20年)	220,000,000	182,813,400	
第180回利付国債(20年)	190,000,000	165,630,600	
第181回利付国債(20年)	210,000,000	185,463,600	
第182回利付国債(20年)	200,000,000	182,056,000	
第183回利付国債(20年)	190,000,000	181,100,400	
第184回利付国債(20年)	200,000,000	180,676,000	
第185回利付国債(20年)	200,000,000	179,976,000	
第186回利付国債(20年)	200,000,000	192,090,000	
第187回利付国債(20年)	170,000,000	157,350,300	
第188回利付国債(20年)	175,000,000	169,851,500	
第189回利付国債(20年)	160,000,000	162,790,400	
第190回利付国債(20年)	50,000,000	49,926,500	
国債証券 合計	50,610,000,000	48,618,222,970	
地方債証券			
第26回東京都公募公債(20年)	100,000,000	106,686,000	
令和3年度第6回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,071,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	101,276,000	
第22回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	96,651,000	
第24回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	95,399,000	
令和2年度第2回大分県公募公債	100,000,000	96,504,000	
第165回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,252,000	
第208回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,888,000	
第253回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,477,000	
第254回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,536,000	

	第255回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,306,000	
	平成28年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	99,156,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	100,039,000	
	平成29年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	98,737,000	
	令和2年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	96,433,000	
	平成27年度第2回熊本県公募公債(10年)	100,000,000	100,083,467	
	第2回名古屋市定時償還公募公債(10年)	10,000,000	10,006,412	
	平成27年度第5回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	100,116,912	
	第18回川崎市公募公債(20年)	100,000,000	104,730,000	
	令和2年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	99,638,091	
	平成26年度第1回福井県公募公債	100,000,000	103,894,000	
	令和6年度第1回福井県公募公債	100,000,000	99,879,000	
	令和3年度第1回山梨県公募公債(10年)	100,000,000	95,603,000	
	令和元年度第1回秋田県公募公債	100,000,000	96,552,000	
地方債証券 合計		2,410,000,000	2,393,913,882	
特殊債券	第5回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	99,089,000	
	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	198,110,000	
	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	98,834,000	
	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	104,046,000	
	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	105,153,000	
	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	100,020,676	
	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	99,324,000	
	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	197,368,000	
	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	98,413,000	
	第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	197,894,000	
	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,959,000	
	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	197,584,000	
	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	98,318,000	
	第395回信金中金債(5年)	100,000,000	98,608,000	
	第405回信金中金債(5年)	100,000,000	98,669,000	
	第37回国際協力機構債券	100,000,000	99,051,000	
特殊債券 合計		2,000,000,000	1,989,440,676	
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	99,628,000	
	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	99,160,000	
	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	98,045,000	
	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	98,320,000	

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	98,655,000	
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	99,466,000	
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	105,390,000	
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	99,742,918	
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	212,296,000	
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	208,952,000	
第510回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,238,000	
第400回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	98,730,000	
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	98,724,000	
第323回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,515,000	
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	99,396,000	
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	104,069,000	
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	103,469,000	
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	96,163,000	
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	97,261,000	
社債券 合計	2,100,000,000	2,118,219,918	
合計	57,120,000,000	55,119,797,446	

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11月 6日現在	2024年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,963,583,952	1,448,185,665
コール・ローン	45,069,283	66,362,680
国債証券	157,183,727,561	164,910,542,863
派生商品評価勘定	690,022	-
未収入金	800,413,612	1,433,949,952
未収利息	1,214,002,062	1,427,466,902
前払費用	68,585,401	87,694,849
流動資産合計	161,276,071,893	169,374,202,911
資産合計	161,276,071,893	169,374,202,911
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	943,122	730,970

	2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
未払金	1,989,822,440	2,023,489,851
未払解約金	112,706,558	192,707,201
未払利息	8	-
流動負債合計	2,103,472,128	2,216,928,022
負債合計	2,103,472,128	2,216,928,022
純資産の部		
元本等		
元本	57,347,654,284	55,030,512,735
剰余金		
剰余金又は欠損金()	101,824,945,481	112,126,762,154
元本等合計	159,172,599,765	167,157,274,889
純資産合計	159,172,599,765	167,157,274,889
負債純資産合計	161,276,071,893	169,374,202,911

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
1. 期首	2022年11月 8日	2023年11月 7日
期首元本額	57,628,255,000円	57,347,654,284円
期首からの追加設定元本額	3,684,113,225円	3,572,494,617円
期首からの一部解約元本額	3,964,713,941円	5,889,636,166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)	19,054,612,382円	20,924,098,348円
DCインデックスバランス(株式20)	425,904,195円	449,934,113円
DCインデックスバランス(株式40)	594,134,856円	636,221,194円
DCインデックスバランス(株式60)	843,157,789円	955,585,847円
DCインデックスバランス(株式80)	756,892,528円	920,260,395円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	15,235,825,730円	12,049,464,135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	2,317,476,763円	2,112,878,640円
日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	12,115,610,099円	11,169,470,831円
財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	891,153,176円	833,588,608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)	316,094,680円	359,199,937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	2,190,700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	36,899,828円
国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	501,546,917円	432,775,864円

	2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	58,964,858円	55,790,118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	86,820,989円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	91,631,913円	95,798,231円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	68,085,097円	73,804,584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	3,510,456,517円	3,344,890,428円
海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	333,831,180円	354,915,962円
計	57,347,654,284円	55,030,512,735円
2. 受益権の総数	57,347,654,284口	55,030,512,735口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額
(金融商品に関する注記)
金融商品の状況に関する事項

	自 2022年11月 8日 至 2023年11月 6日	自 2023年11月 7日 至 2024年11月 6日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、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11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	2,907,841,616
合計	2,907,841,616

(2024年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	637,825,829
合計	637,825,829

(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11月 6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	54,008,946	-	54,402,436	393,490
	英ポンド	54,008,946	-	54,402,436	393,490
	売建	690,098,354	-	690,744,944	646,590
	米ドル	323,442,360	-	323,150,868	291,492
	加ドル	14,668,202	-	14,672,062	3,860
	メキシコペソ	28,940,123	-	29,625,723	685,600
	ユーロ	236,256,090	-	236,303,079	46,989
	英ポンド	29,595,520	-	29,597,920	2,400
	ポーランドズロチ	48,445,238	-	48,643,025	197,787
	豪ドル	8,750,821	-	8,752,267	1,446
合計	744,107,300	-	745,147,380	253,100	

(2024年11月 6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	748,518,390	-	749,249,360	730,970
	米ドル	305,445,895	-	305,620,000	174,105
	加ドル	19,248,250	-	19,267,150	18,900
	ユーロ	271,789,043	-	271,978,747	189,704
	英ポンド	34,651,260	-	34,681,150	29,890
	ポーランドズロチ	34,970,807	-	35,060,904	90,097
中国元	82,413,135	-	82,641,409	228,274	
合計	748,518,390	-	749,249,360	730,970	

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年11月 6日現在		2024年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	2,7756円	1口当たり純資産額	3,0375円
(1万口当たり純資産額)	(27,756円)	(1万口当たり純資産額)	(30,375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%-25/10/31	1,400,000.00	1,382,522.40	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	2,110,000.00	2,027,999.07	
		US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	3,440,000.00	3,368,881.44	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,300,116.84	
		US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	3,420,000.00	3,280,761.54	
		US TREASURY N/B-4.875%-25/11/30	4,000,000.00	4,022,756.00	
		US TREASURY N/B-4.0%-25/12/15	1,510,000.00	1,504,867.51	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	1,962,968.00	
		US TREASURY N/B-3.875%-26/01/15	1,150,000.00	1,144,743.35	
		US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	1,813,649.35	
		US TREASURY N/B-0.375%-26/01/31	2,370,000.00	2,259,460.83	
		US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	1,841,412.60	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,310,000.00	3,202,683.18	
		US TREASURY N/B-4.0%-26/02/15	3,000,000.00	2,990,154.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,749,934.43	
		US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	3,650,000.00	3,474,343.75	
		US TREASURY N/B-4.625%-26/02/28	2,820,000.00	2,831,784.78	
		US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	4,490,000.00	4,368,626.32	
		US TREASURY N/B-0.75%-26/03/31	2,400,000.00	2,286,513.60	
		US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	1,050,000.00	1,022,026.95	
		US TREASURY N/B-0.75%-26/04/30	2,740,000.00	2,603,106.86	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	4,840,000.00	4,655,475.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-26/05/15	6,750,000.00	6,688,298.25	
		US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	2,740,000.00	2,653,517.38	
US TREASURY N/B-0.75%-26/05/31	2,800,000.00	2,652,888.00			
US TREASURY N/B-4.125%-26/06/15	3,000,000.00	2,994,549.00			

US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	1,926,170.00
US TREASURY N/B-4.5%-26/07/15	3,600,000.00	3,615,606.00
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	960,000.00	922,649.28
US TREASURY N/B-0.625%-26/07/31	1,760,000.00	1,655,017.76
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,817,028.00
US TREASURY N/B-0.75%-26/08/31	3,000,000.00	2,819,763.00
US TREASURY N/B-3.75%-26/08/31	3,400,000.00	3,372,041.80
US TREASURY N/B-4.625%-26/09/15	2,600,000.00	2,618,839.60
US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,545,075.00
US TREASURY N/B-0.875%-26/09/30	2,000,000.00	1,879,492.00
US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	250,000.00	237,939.25
US TREASURY N/B-1.125%-26/10/31	3,950,000.00	3,721,330.55
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,040,000.00	2,912,937.12
US TREASURY N/B-4.625%-26/11/15	3,200,000.00	3,226,249.60
US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,400,000.00	2,279,529.60
US TREASURY N/B-1.25%-26/11/30	2,210,000.00	2,082,578.03
US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	1,901,250.00
US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	4,000,000.00	3,773,748.00
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	2,680,000.00	2,568,506.64
US TREASURY N/B-4.125%-27/02/15	1,880,000.00	1,877,723.32
US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,390,000.00	1,297,369.01
US TREASURY N/B-4.25%-27/03/15	2,300,000.00	2,304,491.90
US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	670,000.00	616,373.20
US TREASURY N/B-4.5%-27/04/15	3,190,000.00	3,214,298.23
US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	1,380,000.00	1,261,513.20
US TREASURY N/B-2.75%-27/04/30	1,430,000.00	1,382,631.25
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,379,696.13
US TREASURY N/B-4.5%-27/05/15	4,700,000.00	4,736,533.10
US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	1,600,000.00	1,458,062.40
US TREASURY N/B-2.625%-27/05/31	1,750,000.00	1,684,989.25
US TREASURY N/B-4.625%-27/06/15	8,450,000.00	8,546,380.70
US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	2,600,000.00	2,362,799.40
US TREASURY N/B-3.25%-27/06/30	5,000,000.00	4,887,400.00
US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	4,450,000.00	4,017,339.85
US TREASURY N/B-2.75%-27/07/31	930,000.00	896,141.49
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	2,812,346.32
US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	1,900,000.00	1,716,456.20
US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	4,090,000.00	3,669,895.65
US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	3,640,000.00	3,268,319.60
US TREASURY N/B-4.125%-27/10/31	800,000.00	799,280.80
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	1,400,000.00	1,478,530.20
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	2,856,611.96

US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	220,000.00	197,712.02
US TREASURY N/B-3.875%-27/11/30	2,320,000.00	2,300,695.28
US TREASURY N/B-0.625%-27/12/31	2,410,000.00	2,159,490.14
US TREASURY N/B-0.75%-28/01/31	900,000.00	807,380.10
US TREASURY N/B-3.5%-28/01/31	1,450,000.00	1,420,914.45
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	3,826,952.00
US TREASURY N/B-1.125%-28/02/29	2,030,000.00	1,839,805.24
US TREASURY N/B-4.0%-28/02/29	2,650,000.00	2,636,180.25
US TREASURY N/B-1.25%-28/03/31	960,000.00	871,668.48
US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	3,370,000.00	3,053,337.95
US TREASURY N/B-3.5%-28/04/30	3,000,000.00	2,934,900.00
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	2,440,000.00	2,336,346.36
US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	4,300,000.00	3,886,795.80
US TREASURY N/B-3.625%-28/05/31	1,020,000.00	1,001,552.28
US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	3,300,000.00	2,975,864.10
US TREASURY N/B-4.0%-28/06/30	200,000.00	198,859.20
US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	2,920,000.00	2,601,477.64
US TREASURY N/B-4.125%-28/07/31	5,950,000.00	5,938,260.65
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	4,009,521.60
US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	2,960,000.00	2,643,359.92
US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	3,700,000.00	3,312,221.50
US TREASURY N/B-4.625%-28/09/30	2,400,000.00	2,437,310.40
US TREASURY N/B-1.375%-28/10/31	3,800,000.00	3,411,609.60
US TREASURY N/B-4.875%-28/10/31	2,100,000.00	2,152,539.90
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,112,841.73
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	2,610,000.00	2,508,964.29
US TREASURY N/B-1.5%-28/11/30	4,930,000.00	4,439,021.30
US TREASURY N/B-4.375%-28/11/30	1,050,000.00	1,057,423.50
US TREASURY N/B-1.375%-28/12/31	870,000.00	777,766.08
US TREASURY N/B-4.0%-29/01/31	2,700,000.00	2,680,646.40
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,590,000.00	4,311,997.47
US TREASURY N/B-4.25%-29/02/28	5,000,000.00	5,013,865.00
US TREASURY N/B-2.375%-29/03/31	4,630,000.00	4,295,676.96
US TREASURY N/B-2.875%-29/04/30	2,000,000.00	1,893,710.00
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	4,810,000.00	4,456,479.43
US TREASURY N/B-4.5%-29/05/31	3,370,000.00	3,415,612.95
US TREASURY N/B-3.25%-29/06/30	4,980,000.00	4,783,036.02
US TREASURY N/B-4.25%-29/06/30	3,000,000.00	3,008,787.00
US TREASURY N/B-4.0%-29/07/31	3,500,000.00	3,473,750.00
US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	1,670,000.00	1,489,103.93
US TREASURY N/B-3.875%-29/09/30	325,000.00	320,474.05
US TREASURY N/B-4.0%-29/10/31	2,520,000.00	2,498,587.56
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	6,940,000.00	6,193,672.40

US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	3,789,701.02	
US TREASURY N/B-4.0%-30/02/28	1,650,000.00	1,634,788.65	
US TREASURY N/B-3.625%-30/03/31	2,550,000.00	2,479,974.45	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,166,745.18	
US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	3,870,000.00	3,193,806.51	
US TREASURY N/B-3.75%-30/05/31	710,000.00	694,191.14	
US TREASURY N/B-3.75%-30/06/30	380,000.00	371,375.52	
US TREASURY N/B-4.0%-30/07/31	4,900,000.00	4,849,368.30	
US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	5,090,000.00	4,162,663.08	
US TREASURY N/B-4.625%-30/09/30	800,000.00	817,218.40	
US TREASURY N/B-4.875%-30/10/31	3,000,000.00	3,104,355.00	
US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	5,910,000.00	4,877,593.92	
US TREASURY N/B-4.375%-30/11/30	3,000,000.00	3,025,605.00	
US TREASURY N/B-4.0%-31/01/31	670,000.00	661,899.70	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	560,000.00	596,902.88	
US TREASURY N/B-1.125%-31/02/15	3,300,000.00	2,748,923.10	
US TREASURY N/B-4.25%-31/02/28	1,000,000.00	1,001,445.00	
US TREASURY N/B-4.625%-31/04/30	255,000.00	260,697.46	
US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	6,020,000.00	5,133,458.68	
US TREASURY N/B-4.625%-31/05/31	1,450,000.00	1,482,142.15	
US TREASURY N/B-4.25%-31/06/30	2,420,000.00	2,422,456.30	
US TREASURY N/B-4.125%-31/07/31	3,000,000.00	2,981,013.00	
US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	4,790,000.00	3,955,304.18	
US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	5,480,000.00	4,532,984.76	
US TREASURY N/B-1.875%-32/02/15	5,870,000.00	5,003,711.27	
US TREASURY N/B-2.875%-32/05/15	4,800,000.00	4,376,059.20	
US TREASURY N/B-2.75%-32/08/15	5,100,000.00	4,594,977.60	
US TREASURY N/B-4.125%-32/11/15	6,110,000.00	6,061,902.08	
US TREASURY N/B-3.5%-33/02/15	2,610,000.00	2,471,291.55	
US TREASURY N/B-3.375%-33/05/15	1,680,000.00	1,573,031.04	
US TREASURY N/B-3.875%-33/08/15	3,330,000.00	3,232,048.05	
US TREASURY N/B-4.5%-33/11/15	5,540,000.00	5,630,889.24	
US TREASURY N/B-4.0%-34/02/15	2,000,000.00	1,956,718.00	
US TREASURY N/B-4.375%-34/05/15	4,810,000.00	4,842,688.76	
US TREASURY N/B-3.875%-34/08/15	2,000,000.00	1,934,530.00	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	821,156.00	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	801,621.00	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	673,611.30	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	720,000.00	732,150.00	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	727,156.00	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	1,427,965.80	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	1,434,366.14	

US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	746,806.50
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	695,326.52
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	1,581,304.29
US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	2,315,245.40
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,348,171.20
US TREASURY N/B-1.125%-40/08/15	3,000,000.00	1,860,351.00
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	988,043.61
US TREASURY N/B-1.375%-40/11/15	3,100,000.00	1,994,958.50
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	1,553,964.00
US TREASURY N/B-1.875%-41/02/15	4,200,000.00	2,924,657.40
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	862,658.94
US TREASURY N/B-2.25%-41/05/15	4,900,000.00	3,613,843.10
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	878,699.52
US TREASURY N/B-1.75%-41/08/15	3,190,000.00	2,148,075.82
US TREASURY N/B-2.0%-41/11/15	3,000,000.00	2,095,605.00
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	417,050.50
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	624,718.40
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	1,555,546.00
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	1,765,000.00	1,451,228.89
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	1,614,934.65
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	1,950,000.00	1,717,675.05
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	1,870,466.40
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	1,080,000.00	947,446.20
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,000,000.00	1,688,280.00
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	1,700,000.00	1,375,206.50
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	1,900,000.00	1,503,150.80
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	2,120,000.00	1,534,017.16
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	1,400,000.00	1,103,811.80
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	1,390,000.00	1,070,679.47
US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	1,190,000.00	935,172.21
US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	1,300,000.00	930,464.60
US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	900,000.00	642,268.80
US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	1,650,000.00	1,117,842.00
US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	540,000.00	411,117.12
US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	1,720,000.00	1,336,997.28
US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	1,530,000.00	1,187,033.67
US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	1,700,000.00	1,256,538.00
US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,440,000.00	1,062,393.12
US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	2,122,010.00
US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	1,892,155.20
US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	3,152,674.50
US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	2,425,566.70
US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	2,531,393.70

		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	2,244,666.00
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,250,000.00	1,474,760.25
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	2,086,563.50
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	2,280,990.80
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	2,450,000.00	1,239,210.00
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,920,000.00	1,519,824.96
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	3,000,000.00	1,668,222.00
		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	4,750,000.00	2,817,434.00
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	4,100,000.00	2,741,153.40
		US TREASURY N/B-2.0%-51/08/15	2,000,000.00	1,218,436.00
		US TREASURY N/B-1.875%-51/11/15	1,400,000.00	824,850.60
		US TREASURY N/B-2.25%-52/02/15	2,000,000.00	1,291,992.00
		US TREASURY N/B-2.875%-52/05/15	600,000.00	445,605.00
		US TREASURY N/B-3.0%-52/08/15	1,100,000.00	838,750.00
		US TREASURY N/B-4.0%-52/11/15	1,500,000.00	1,384,921.50
		US TREASURY N/B-3.625%-53/02/15	2,900,000.00	2,501,363.10
		US TREASURY N/B-3.625%-53/05/15	2,150,000.00	1,856,138.00
		US TREASURY N/B-4.125%-53/08/15	1,500,000.00	1,416,738.00
		US TREASURY N/B-4.75%-53/11/15	1,500,000.00	1,571,718.00
		US TREASURY N/B-4.25%-54/02/15	1,000,000.00	966,640.00
		US TREASURY N/B-4.625%-54/05/15	1,500,000.00	1,542,889.50
		US TREASURY N/B-4.25%-54/08/15	500,000.00	483,789.00
米ドル小計			556,335,000.00	501,913,837.29 (76,717,530,029)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-25/11/01	540,000.00	546,204.60
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-26/02/01	620,000.00	629,287.60
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	995,000.00	957,259.65
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-26/04/01	700,000.00	698,047.00
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-26/05/01	870,000.00	879,796.20
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	670,000.00	653,678.80
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-26/08/01	460,000.00	466,260.60
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-26/09/01	990,000.00	953,300.70
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-26/11/01	660,000.00	661,379.40
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	520,000.00	498,763.20
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	650,000.00	618,267.00
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-27/09/01	620,000.00	614,413.80
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-28/03/01	580,000.00	588,021.40
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	697,000.00	673,183.51
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-28/09/01	930,000.00	936,296.10
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-29/03/01	1,000,000.00	1,037,340.00
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	410,000.00	457,580.50
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	364,000.00	352,697.80

		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-29/09/01	1,300,000.00	1,324,245.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/12/01	120,000.00	115,401.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	1,748,000.00	1,581,887.56	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-30/12/01	1,205,000.00	1,030,624.45	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	1,746,000.00	1,573,722.18	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/12/01	1,360,000.00	1,216,302.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-32/06/01	1,070,000.00	984,079.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-32/12/01	890,000.00	845,037.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	710,000.00	841,271.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-33/06/01	500,000.00	482,400.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-33/12/01	800,000.00	800,608.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-34/03/01	145,000.00	147,943.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-34/06/01	650,000.00	636,694.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	290,000.00	340,790.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	460,000.00	502,872.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	520,000.00	536,993.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	610,000.00	555,411.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	2,073,000.00	1,593,660.21	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-53/12/01	1,241,000.00	888,158.88	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-55/12/01	780,000.00	700,510.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	285,000.00	257,081.40	
			30,779,000.00	29,177,473.14	
				(3,213,023,342)	
加ドル小計					
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	23,150,000.00	21,898,453.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.0%-26/09/03	5,200,000.00	4,928,625.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	15,550,000.00	14,155,359.37	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	20,500,000.00	19,410,937.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/03/01	4,900,000.00	4,658,062.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	14,120,000.00	13,414,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	19,900,000.00	17,916,218.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-33/05/26	12,800,000.00	11,000,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	6,000,000.00	5,158,125.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	4,400,000.00	4,406,875.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	11,170,000.00	9,895,921.87	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	14,100,000.00	11,244,750.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	13,570,000.00	10,915,368.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-53/07/31	12,200,000.00	9,695,187.49	
メキシコペソ小計			177,560,000.00	158,697,884.35	
				(1,194,550,715)	

ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	270,000.00	111,996.00
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	505,000.00	518,870.33
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	742,000.00	725,414.07
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	780,000.00	748,088.64
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	375,000.00	348,997.50
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	880,000.00	964,004.80
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	795,000.00	748,640.37
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	840,000.00	778,650.60
		BELGIUM KINGDOM-2.7%-29/10/22	152,000.00	152,561.03
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	730,000.00	633,857.54
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	730,000.00	653,663.90
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-31/10/22	610,000.00	504,255.89
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	475,000.00	511,990.15
		BELGIUM KINGDOM-0.35%-32/06/22	675,000.00	560,808.90
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	525,000.00	463,455.30
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-33/06/22	476,000.00	479,970.79
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	543,000.00	545,315.35
		BELGIUM KINGDOM-2.85%-34/10/22	240,000.00	237,092.40
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	974,000.00	1,142,898.41
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	340,000.00	280,986.88
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	415,000.00	356,921.99
		BELGIUM KINGDOM-2.75%-39/04/22	190,000.00	180,211.58
		BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	345,000.00	225,030.39
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	992,000.00	1,113,055.74
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	435,000.00	458,617.02
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	448,000.00	322,307.77
		BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	461,000.00	325,497.80
		BELGIUM KINGDOM-1.4%-53/06/22	485,000.00	304,640.62
		BELGIUM KINGDOM-3.3%-54/06/22	433,000.00	416,165.39
		BELGIUM KINGDOM-3.5%-55/06/22	235,000.00	233,358.29
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	412,000.00	312,751.26
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	446,000.00	326,739.60
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-71/10/31	345,000.00	174,833.92
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%-25/10/31	1,455,000.00	1,449,196.00
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-26/01/31	955,000.00	925,555.44
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-26/04/30	1,055,000.00	1,047,003.10		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.8%-26/05/31	485,000.00	486,814.87		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	1,285,000.00	1,358,081.80		
	1,640,000.00	1,603,029.48		

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31			
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 27/01/31	755,000.00	713,973.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,275,000.00	1,244,113.12	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.5%- 27/05/31	120,000.00	119,772.96	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%- 27/07/30	860,000.00	820,786.58	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	1,170,000.00	1,133,198.82	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 28/01/31	1,125,000.00	1,035,675.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	1,270,000.00	1,220,591.92	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/07/30	1,275,000.00	1,221,438.52	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,020,000.00	1,116,262.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	1,355,000.00	1,536,713.63	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 29/04/30	1,025,000.00	973,344.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.5%- 29/05/31	430,000.00	444,781.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%- 29/07/30	1,035,000.00	948,800.02	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%- 29/10/31	1,210,000.00	1,093,022.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 30/04/30	1,205,000.00	1,070,118.32	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,180,000.00	1,130,936.78	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%- 30/10/31	1,230,000.00	1,127,802.99	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%- 31/04/30	1,175,000.00	989,297.12	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.1%- 31/07/30	75,000.00	76,148.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 31/10/31	1,090,000.00	930,464.33	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.7%- 32/04/30	1,270,000.00	1,085,904.61	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	1,050,000.00	1,255,459.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.55%- 32/10/31	985,000.00	958,478.87	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%- 33/04/30	1,082,000.00	1,095,315.09	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	1,165,000.00	1,108,101.40	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.55%-33/10/31	1,030,000.00	1,071,083.61
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.25%-34/04/30	738,000.00	748,040.48
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-34/10/31	252,000.00	258,962.76
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%-35/07/30	995,000.00	877,490.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	995,000.00	1,088,499.15
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.85%-37/07/30	670,000.00	499,129.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.9%-39/07/30	340,000.00	357,948.26
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	945,000.00	1,107,453.06
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%-40/10/31	1,000,000.00	722,791.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	1,190,000.00	1,371,156.08
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-42/07/30	390,000.00	262,455.18
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-43/07/30	300,000.00	294,430.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	710,000.00	869,107.45
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	980,000.00	878,967.88
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	785,000.00	671,079.23
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-50/10/31	1,170,000.00	660,695.49
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.9%-52/10/31	743,000.00	515,401.26
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-54/10/31	400,000.00	417,954.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	798,000.00	744,396.74
BUNDESobligation-0.0%-26/04/10	1,600,000.00	1,549,144.00
BUNDESobligation-0.0%-26/10/09	800,000.00	766,761.60
BUNDESobligation-0.0%-27/04/16	1,050,000.00	995,487.15
BUNDESobligation-1.3%-27/10/15	1,130,000.00	1,102,098.04
BUNDESobligation-2.2%-28/04/13	750,000.00	749,892.00
BUNDESobligation-2.4%-28/10/19	685,000.00	689,296.32
BUNDESobligation-2.1%-29/04/12	297,000.00	295,003.56
BUNDESobligation-2.1%-29/04/12	500,000.00	496,791.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	1,820,000.00	1,778,977.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-26/08/15	1,910,000.00	1,836,550.95
	1,315,000.00	1,259,375.50

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15		
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	910,000.00	1,009,099.91
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	1,120,000.00	1,070,847.68
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 27/11/15	1,095,000.00	1,025,672.26
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	650,000.00	717,574.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	1,690,000.00	1,603,299.62
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	970,000.00	1,056,240.76
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 28/08/15	1,090,000.00	1,016,118.71
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 28/11/15	1,180,000.00	1,082,766.82
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 29/02/15	1,705,000.00	1,573,810.48
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 29/08/15	1,760,000.00	1,587,393.28
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.1%- 29/11/15	620,000.00	614,878.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	660,000.00	785,780.16
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/02/15	1,290,000.00	1,149,503.52
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/08/15	1,800,000.00	1,586,923.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/08/15	740,000.00	652,514.24
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.4%- 30/11/15	450,000.00	452,579.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,180,000.00	1,394,996.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/02/15	1,310,000.00	1,140,761.10
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/08/15	1,565,000.00	1,346,364.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/08/15	160,000.00	137,704.16
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 32/02/15	1,323,000.00	1,122,939.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.7%- 32/08/15	1,220,000.00	1,168,086.56
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.3%- 33/02/15	1,770,000.00	1,764,357.24
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.3%- 33/02/15	170,000.00	169,531.82
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.6%- 33/08/15	1,310,000.00	1,333,539.39

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.2%- 34/02/15	1,080,000.00	1,062,779.38
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,300,000.00	1,559,519.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.6%- 34/08/15	465,000.00	472,279.11
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 35/05/15	920,000.00	712,554.72
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 36/05/15	1,000,000.00	752,156.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	1,740,000.00	2,004,697.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 38/05/15	115,000.00	94,415.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,135,000.00	1,360,958.07
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,165,000.00	1,482,400.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.6%- 41/05/15	125,000.00	124,397.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	955,000.00	1,038,547.22
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,560,000.00	1,530,257.04
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,587,000.00	1,556,294.72
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	1,940,000.00	1,481,188.06
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	1,630,000.00	847,241.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	640,000.00	333,413.76
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 52/08/15	900,000.00	445,271.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%- 53/08/15	1,040,000.00	873,486.64
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%- 53/08/15	500,000.00	420,648.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 54/08/15	425,000.00	415,801.30
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-3.1%-25/12/12	420,000.00	422,846.34
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.5%-26/03/19	280,000.00	280,482.44
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.9%-26/06/18	560,000.00	564,810.40
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.7%-26/09/17	235,000.00	236,609.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 72/03/01	220,000.00	138,504.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 25/11/15	1,000,000.00	998,322.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	1,085,000.00	1,077,478.78
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 26/01/15	810,000.00	816,817.77

BUONI POLIENNALI DEL TES-3.2%- 26/01/28	215,000.00	216,084.46	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 26/02/01	850,000.00	827,105.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,130,000.00	1,155,500.71	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 26/04/01	1,020,000.00	982,592.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%- 26/04/15	950,000.00	964,082.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	970,000.00	954,514.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%- 26/07/15	950,000.00	941,336.95	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 26/08/01	375,000.00	358,201.87	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 26/09/15	540,000.00	550,776.24	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	720,000.00	783,691.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,080,000.00	1,049,506.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%- 27/01/15	1,005,000.00	965,843.19	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 27/02/15	90,000.00	90,360.18	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.1%- 27/04/01	410,000.00	394,783.26	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	1,160,000.00	1,145,736.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 27/07/15	385,000.00	391,495.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	995,000.00	977,032.29	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 27/09/15	775,000.00	736,837.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	1,440,000.00	1,593,573.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.65%- 27/12/01	950,000.00	945,886.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	865,000.00	844,016.83	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%- 28/03/15	840,000.00	771,334.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.4%- 28/04/01	150,000.00	152,640.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 28/07/15	1,050,000.00	964,440.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%- 28/08/01	650,000.00	670,421.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,330,000.00	1,419,300.19	

BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 28/12/01	1,030,000.00	1,027,476.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.1%- 29/02/01	735,000.00	767,523.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 29/02/15	605,000.00	545,208.45
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 29/06/15	305,000.00	302,367.85
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 29/07/01	375,000.00	380,072.62
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 29/08/01	1,945,000.00	1,946,458.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	1,750,000.00	1,933,230.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 29/12/15	535,000.00	554,468.11
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,500,000.00	1,533,997.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 30/04/01	955,000.00	873,117.34
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.7%- 30/06/15	540,000.00	554,838.66
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 30/08/01	827,000.00	732,358.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 30/11/15	585,000.00	609,953.17
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 30/12/01	1,287,000.00	1,178,065.74
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 31/02/15	405,000.00	410,662.30
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 31/04/01	1,295,000.00	1,122,131.74
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	1,515,000.00	1,763,937.22
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%- 31/08/01	1,120,000.00	942,519.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 31/10/30	290,000.00	303,793.85
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 31/12/01	1,010,000.00	863,150.04
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,250,000.00	1,119,037.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 32/06/01	990,000.00	834,816.51
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 32/12/01	600,000.00	563,965.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,125,000.00	1,311,750.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.4%- 33/05/01	865,000.00	927,626.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	1,135,000.00	1,051,713.70

BUONI POLIENNALI DEL TES-4.35%- 33/11/01	700,000.00	746,533.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.2%- 34/03/01	755,000.00	795,104.09
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 34/07/01	390,000.00	398,833.10
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	1,460,000.00	1,633,500.56
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 35/02/01	130,000.00	132,363.01
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	780,000.00	764,630.10
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 35/04/30	400,000.00	415,512.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 36/03/01	770,000.00	613,187.96
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	965,000.00	833,827.55
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	1,825,000.00	1,884,569.82
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 37/03/01	400,000.00	291,486.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.05%- 37/10/30	290,000.00	298,470.61
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 38/03/01	200,000.00	188,119.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	785,000.00	712,261.11
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,200,000.00	1,346,110.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.15%- 39/10/01	350,000.00	358,633.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%- 40/03/01	690,000.00	625,618.17
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,070,000.00	1,200,734.74
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%- 41/03/01	730,000.00	543,442.66
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.45%- 43/09/01	610,000.00	642,001.21
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	935,000.00	1,027,161.08
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 45/04/30	440,000.00	290,307.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	820,000.00	728,667.58
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	715,000.00	578,082.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	915,000.00	832,628.95
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 49/09/01	930,000.00	897,337.47

BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-50/09/01	870,000.00	650,717.37
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%-51/09/01	640,000.00	403,092.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-52/09/01	280,000.00	192,202.08
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-53/10/01	735,000.00	776,325.37
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.3%-54/10/01	245,000.00	247,955.43
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	500,000.00	379,681.00
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	245,000.00	238,412.93
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-26/09/15	180,000.00	172,210.50
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-27/04/15	170,000.00	165,883.28
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	315,000.00	298,853.41
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	330,000.00	333,441.57
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	250,307.82
FINNISH GOVERNMENT-2.875%-29/04/15	270,000.00	273,493.80
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	375,000.00	339,568.50
FINNISH GOVERNMENT-2.5%-30/04/15	87,000.00	86,450.59
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-30/09/15	292,000.00	250,474.09
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	365,000.00	323,500.59
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-31/09/15	200,000.00	167,969.40
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-32/09/15	230,000.00	209,264.35
FINNISH GOVERNMENT-3.0%-33/09/15	110,000.00	111,333.31
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	325,000.00	278,383.62
FINNISH GOVERNMENT-3.0%-34/09/15	140,000.00	141,179.50
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	278,000.00	201,559.45
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-38/04/15	210,000.00	203,317.17
FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15	145,000.00	94,185.18
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	252,000.00	236,908.47
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-43/04/15	235,000.00	150,208.71
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	189,500.74
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-52/04/15	230,000.00	108,066.65
FINNISH GOVERNMENT-2.95%-55/04/15	133,000.00	129,271.07
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	515,000.00	185,893.88
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	2,000,000.00	1,968,690.00
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-26/02/25	1,640,000.00	1,589,332.20
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	1,970,000.00	1,999,268.29
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,450,000.00	2,378,599.65
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-26/09/24	1,360,000.00	1,360,225.76
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,520,000.00	2,408,827.68
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-27/02/25	2,005,000.00	1,894,093.42
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	1,775,000.00	1,709,064.07

FRANCE (GOVT OF) -2.5%-27/09/24	180,000.00	179,625.42
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	3,020,000.00	3,035,577.16
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/02/25	1,275,000.00	1,200,598.65
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/05/25	3,450,000.00	3,231,721.95
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/11/25	2,930,000.00	2,715,808.21
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-29/02/25	690,000.00	690,654.12
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	2,105,000.00	2,346,344.56
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-29/05/25	2,980,000.00	2,699,987.28
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-29/11/25	2,510,000.00	2,187,921.82
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	2,935,000.00	2,892,266.40
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-30/11/25	2,549,000.00	2,154,269.50
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-31/05/25	2,940,000.00	2,704,976.40
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-31/11/25	2,605,000.00	2,129,290.53
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-32/05/25	1,833,000.00	1,472,366.41
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	1,655,000.00	1,976,640.97
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-32/11/25	2,075,000.00	1,928,517.45
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-33/05/25	1,490,000.00	1,485,158.98
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-33/11/25	2,013,000.00	2,078,607.69
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-34/05/25	2,385,000.00	2,022,861.60
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	1,425,000.00	1,624,682.40
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-36/05/25	2,395,000.00	1,945,506.40
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-38/05/25	290,000.00	224,723.90
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	1,500,000.00	1,614,259.50
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-39/06/25	1,810,000.00	1,487,124.96
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	2,780,000.00	3,165,994.66
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-43/05/25	165,000.00	143,440.60
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-44/06/25	1,050,000.00	616,938.00
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	1,230,000.00	1,192,204.56
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-48/05/25	1,380,000.00	1,050,133.08
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-49/06/25	348,000.00	319,242.32
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-50/05/25	1,840,000.00	1,216,755.20
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-52/05/25	1,500,000.00	775,056.00
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-53/05/25	1,320,000.00	666,153.84
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-54/05/25	850,000.00	757,445.20
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	1,130,000.00	1,210,136.21
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-55/05/25	400,000.00	372,342.80
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	970,000.00	1,046,614.48
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-66/05/25	945,000.00	592,326.00
IRISH TREASURY -1.0%-26/05/15	505,000.00	495,011.10
IRISH TREASURY -0.2%-27/05/15	327,000.00	310,470.80
IRISH TREASURY -0.9%-28/05/15	355,000.00	337,995.14
IRISH TREASURY -1.1%-29/05/15	413,000.00	389,688.62

IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	424,000.00	422,340.04
IRISH TREASURY-0.2%-30/10/18	282,000.00	246,851.23
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	335,000.00	311,949.32
IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	405,000.00	339,784.87
IRISH TREASURY-0.35%-32/10/18	205,000.00	172,268.47
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	238,000.00	214,190.24
IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	250,000.00	196,192.00
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	325,000.00	285,363.32
IRISH TREASURY-0.55%-41/04/22	185,000.00	128,562.42
IRISH TREASURY-3.0%-43/10/18	170,000.00	172,357.56
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	475,000.00	408,756.50
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	411,000.00	308,998.84
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-26/01/15	455,000.00	442,562.57
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	760,000.00	737,535.16
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	635,000.00	604,525.71
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	760,000.00	729,451.80
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	550,000.00	602,949.60
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	791,000.00	746,546.59
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	590,000.00	534,398.99
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	595,000.00	538,697.53
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-30/01/15	395,000.00	395,833.45
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-30/07/15	670,000.00	583,276.54
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-31/07/15	650,000.00	550,976.40
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-32/07/15	560,000.00	480,517.52
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	697,000.00	692,499.47
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/07/15	465,000.00	460,547.16
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-34/07/15	290,000.00	285,719.60
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	905,000.00	1,019,887.94
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-38/01/15	395,000.00	273,652.84
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	713,000.00	511,604.59
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	902,000.00	1,014,901.53
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-44/01/15	220,000.00	233,934.36
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	874,000.00	868,492.92
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	907,000.00	439,926.74
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-54/01/15	539,000.00	457,204.59
OBRIGACOES DO TESOURO-2.875%-26/07/21	400,000.00	403,952.80
OBRIGACOES DO TESOURO-4.125%-27/04/14	200,000.00	209,011.60
OBRIGACOES DO TESOURO-0.7%-27/10/15	490,000.00	468,865.32
OBRIGACOES DO TESOURO-2.125%-28/10/17	670,000.00	665,476.16
OBRIGACOES DO TESOURO-1.95%-29/06/15	550,000.00	539,363.00
OBRIGACOES DO TESOURO-3.875%-30/02/15	480,000.00	513,683.04
OBRIGACOES DO TESOURO-0.475%-30/10/18	250,000.00	222,754.25
OBRIGACOES DO TESOURO-0.3%-31/10/17	370,000.00	317,680.15

		OBRIGACOES DO TESOURO-1.65%-32/07/16	300,000.00	279,485.10
		OBRIGACOES DO TESOURO-2.25%-34/04/18	570,000.00	543,444.84
		OBRIGACOES DO TESOURO-0.9%-35/10/12	250,000.00	202,756.75
		OBRIGACOES DO TESOURO-4.1%-37/04/15	600,000.00	666,007.20
		OBRIGACOES DO TESOURO-1.15%-42/04/11	310,000.00	224,469.45
		OBRIGACOES DO TESOURO-4.1%-45/02/15	350,000.00	391,518.75
		OBRIGACOES DO TESOURO-1.0%-52/04/12	350,000.00	206,850.00
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.7%-71/04/20	180,000.00	81,978.84
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	173,000.00	104,904.43
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	343,000.00	261,694.93
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.85%-99/99/99	192,000.00	84,667.39
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	471,000.00	485,722.04
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.0%-26/07/15	170,000.00	168,829.04
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	773,000.00	749,258.85
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	654,542.16
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	487,000.00	535,312.83
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	660,000.00	624,581.76
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-28/10/20	382,000.00	346,392.63
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	715,000.00	656,843.33
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-29/05/23	225,000.00	228,279.15
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.5%-29/10/20	27,000.00	26,872.07
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	680,000.00	592,813.80
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.45%-30/10/20	155,000.00	161,542.86
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-31/02/20	745,000.00	629,912.40
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.9%-32/02/20	610,000.00	535,651.37
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-33/02/20	715,000.00	718,716.57
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-34/02/20	30,000.00	30,042.30
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	455,000.00	437,423.35
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-36/10/20	270,000.00	196,107.48
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	650,000.00	726,306.75
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-39/07/15	128,000.00	129,957.75
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	255,000.00	157,617.28
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	394,000.00	397,048.37
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	473,000.00	355,224.41
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.85%-49/05/23	288,000.00	228,727.58
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	455,000.00	266,851.58
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-53/10/20	206,000.00	206,209.50
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	180,000.00	206,977.50
		ユーロ小計	321,223,000.00	302,606,920.00 (50,193,409,820)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	760,000.00	324,330.00
		UK TREASURY-1.125%-73/10/22	513,000.00	175,240.80

UK TREASURY-0.125%-26/01/30	710,000.00	676,559.00
UK TREASURY-1.5%-26/07/22	820,000.00	781,712.56
UK TREASURY-0.375%-26/10/22	1,180,000.00	1,094,349.70
UK TREASURY-4.125%-27/01/29	1,495,000.00	1,482,935.35
UK TREASURY-3.75%-27/03/07	1,323,000.00	1,300,699.51
UK TREASURY-1.25%-27/07/22	755,000.00	697,053.75
UK TREASURY-4.25%-27/12/07	850,000.00	848,016.95
UK TREASURY-0.125%-28/01/31	745,000.00	654,162.15
UK TREASURY-4.5%-28/06/07	1,385,000.00	1,387,312.95
UK TREASURY-1.625%-28/10/22	720,000.00	651,897.36
UK TREASURY-6.0%-28/12/07	710,000.00	754,894.72
UK TREASURY-0.5%-29/01/31	1,180,000.00	1,009,230.40
UK TREASURY-4.125%-29/07/22	850,000.00	839,308.70
UK TREASURY-0.875%-29/10/22	736,000.00	626,703.26
UK TREASURY-0.375%-30/10/22	870,000.00	694,137.33
UK TREASURY-4.75%-30/12/07	945,000.00	966,082.95
UK TREASURY-0.25%-31/07/31	1,045,000.00	800,166.95
UK TREASURY-4.0%-31/10/22	760,000.00	740,344.88
UK TREASURY-1.0%-32/01/31	1,645,000.00	1,303,835.22
UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,030,000.00	1,021,998.96
UK TREASURY-3.25%-33/01/31	1,490,000.00	1,367,328.30
UK TREASURY-0.875%-33/07/31	1,270,000.00	944,378.35
UK TREASURY-4.625%-34/01/31	1,123,000.00	1,132,576.94
UK TREASURY-4.25%-34/07/31	415,000.00	406,126.05
UK TREASURY-4.5%-34/09/07	789,000.00	788,670.19
UK TREASURY-0.625%-35/07/31	967,000.00	649,431.39
UK TREASURY-4.25%-36/03/07	970,000.00	941,764.27
UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,150,000.00	832,281.45
UK TREASURY-3.75%-38/01/29	710,000.00	645,771.98
UK TREASURY-4.75%-38/12/07	985,000.00	989,354.68
UK TREASURY-1.125%-39/01/31	747,000.00	472,831.57
UK TREASURY-4.25%-39/09/07	850,000.00	804,270.00
UK TREASURY-4.375%-40/01/31	90,000.00	85,966.20
UK TREASURY-4.25%-40/12/07	815,000.00	764,307.00
UK TREASURY-1.25%-41/10/22	1,280,000.00	757,888.00
UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,040,000.00	994,032.00
UK TREASURY-4.75%-43/10/22	260,000.00	254,941.18
UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,115,000.00	886,202.00
UK TREASURY-3.5%-45/01/22	980,000.00	802,032.00
UK TREASURY-0.875%-46/01/31	435,000.00	205,842.00
UK TREASURY-4.25%-46/12/07	720,000.00	653,090.40
UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,005,000.00	539,226.72

		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	675,000.00	375,096.82
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	895,000.00	806,216.00
		UK TREASURY-0.625%-50/10/22	770,000.00	293,139.00
		UK TREASURY-1.25%-51/07/31	600,000.00	275,400.00
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	872,000.00	716,211.96
		UK TREASURY-1.5%-53/07/31	580,000.00	277,411.10
		UK TREASURY-3.75%-53/10/22	1,170,000.00	954,720.00
		UK TREASURY-4.375%-54/07/31	270,000.00	245,727.00
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	925,000.00	453,183.40
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	962,000.00	858,760.08
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	532,877.50
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	751,000.00	640,227.50
		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	1,050,000.00	294,525.00
		UK TREASURY-4.0%-63/10/22	440,000.00	372,868.32
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	765,000.00	583,603.20
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	742,000.00	437,705.80
英ポンド小計			52,775,000.00	42,866,958.80 (8,497,517,242)
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	3,616,207.20
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,300,000.00	3,168,709.50
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	3,330,000.00	3,133,596.60
		SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	2,700,000.00	2,382,831.00
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,800,000.00	1,817,906.40
		SWEDISH GOVERNMENT-1.75%-33/11/11	1,730,000.00	1,675,963.45
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-35/05/11	950,000.00	954,335.80
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	2,220,000.00	2,534,496.30
スウェーデンクローナ小計			19,710,000.00	19,284,046.25 (273,640,616)
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,400,000.00	2,321,078.40
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,200,000.00	2,093,599.20
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	1,820,000.00	1,708,772.52
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	1,930,000.00	1,751,642.91
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	2,685,000.00	2,342,767.21
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.25%-31/09/17	2,040,000.00	1,723,569.48
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.125%-32/05/18	2,030,000.00	1,802,976.98
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-33/08/15	2,350,000.00	2,197,137.20
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.625%-34/04/13	1,100,000.00	1,075,629.50
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.5%-42/10/06	990,000.00	950,513.85
ノルウェークローネ小計			19,545,000.00	17,967,687.25 (249,211,822)
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	3,115,237.50
		KINGDOM OF DENMARK-2.25%-26/11/15	950,000.00	955,814.00
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	2,380,000.00	2,279,944.80

		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	2,290,000.00	2,124,907.03	
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-31/11/15	1,350,000.00	1,167,731.10	
		KINGDOM OF DENMARK-2.25%-33/11/15	700,000.00	703,033.10	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	6,495,000.00	8,215,200.75	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	1,750,000.00	999,393.50	
デンマーククローネ小計			19,040,000.00	19,561,261.78	(435,042,461)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-26/04/25	670,000.00	627,622.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	1,870,000.00	1,795,784.37	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,600,000.00	1,462,000.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	1,310,000.00	1,270,700.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	1,790,000.00	1,677,565.62	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	1,860,000.00	1,717,593.75	
		POLAND GOVERNMENT BOND-7.5%-28/07/25	1,720,000.00	1,846,850.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	2,075,000.00	2,104,981.67	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-29/07/25	1,270,000.00	1,234,678.12	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	2,565,000.00	2,276,437.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	2,025,000.00	1,597,851.56	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-32/04/25	2,090,000.00	1,612,565.62	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.0%-33/10/25	2,145,000.00	2,194,603.12	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-34/10/25	880,000.00	833,250.00	
ポーランドズロチ小計			23,870,000.00	22,252,483.83	(847,261,096)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	855,000.00	821,116.35	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	900,000.00	901,917.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,090,000.00	1,020,403.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	980,000.00	995,150.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	830,000.00	798,733.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	795,000.00	747,212.55	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	765,000.00	726,719.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	960,000.00	925,411.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	890,000.00	832,443.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,005,000.00	919,504.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	930,000.00	766,292.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,083,000.00	907,099.14	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,385,000.00	1,103,069.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,250,000.00	997,250.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	1,195,000.00	977,235.15	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,130,000.00	1,131,367.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-33/11/21	1,010,000.00	896,758.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-34/05/21	960,000.00	901,881.60	
AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-34/06/21	200,000.00	195,504.00			

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.5%-34/12/21	855,000.00	782,000.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	700,000.00	592,529.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-35/12/21	260,000.00	252,088.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	550,000.00	503,448.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	522,000.00	440,155.62	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	710,000.00	542,177.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	675,000.00	495,747.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	870,000.00	454,522.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-54/06/21	325,000.00	312,383.50	
豪ドル小計			23,680,000.00	20,940,122.06 (2,112,230,112)	
ニュー ジーラ ンドル	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.5%-26/05/15	335,000.00	318,726.03	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-27/04/15	700,000.00	711,671.10	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.25%-28/05/15	495,000.00	437,140.93	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.0%-29/04/20	680,000.00	653,687.40	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-30/05/15	430,000.00	438,688.15	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.5%-31/05/15	350,000.00	296,367.40	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.0%-32/05/15	325,000.00	277,118.07	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.5%-33/04/14	430,000.00	403,069.96	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.25%-34/05/15	220,000.00	216,354.60	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-35/05/15	325,000.00	323,636.95	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-37/04/15	430,000.00	351,898.67	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.75%-41/05/15	225,000.00	145,860.52	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-51/05/15	500,000.00	336,028.50	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-5.0%-54/05/15	170,000.00	169,492.72	
ニュージーランドドル小計			5,615,000.00	5,079,741.00 (463,678,758)	
シンガ ポール ドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-72/08/01	262,000.00	272,697.71	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-25/11/01	314,000.00	307,155.42	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	420,000.00	416,178.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-26/11/01	365,000.00	354,402.22	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	446,000.00	453,136.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-27/09/01	150,000.00	150,525.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	347,000.00	345,959.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-28/08/01	100,000.00	100,470.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-29/04/01	131,000.00	132,414.80	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	365,000.00	366,773.90	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	440,000.00	442,112.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-31/07/01	300,000.00	278,100.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-32/08/01	170,000.00	167,195.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	335,000.00	348,065.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	391,000.00	366,484.30	

		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	206,000.00	192,867.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	280,000.00	273,840.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	387,000.00	380,081.98	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	342,000.00	283,860.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-51/10/01	222,000.00	182,706.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-54/06/01	97,000.00	105,841.55	
シンガポールドル小計			6,070,000.00	5,920,865.38	(685,221,750)
マレーシア アリン ギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	830,000.00	836,474.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	920,000.00	928,234.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,200,000.00	1,212,060.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.519%-28/04/20	350,000.00	348,880.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.504%-29/04/30	350,000.00	362,425.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,320,000.00	1,332,474.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	985,000.00	917,035.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.582%-32/07/15	100,000.00	97,975.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	737,135.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,000,000.00	994,000.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	760,000.00	778,240.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,320,000.00	1,416,360.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	1,080,000.00	1,176,390.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.054%-39/04/18	120,000.00	120,540.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	1,490,000.00	1,436,360.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.696%-42/10/15	750,000.00	805,800.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	660,000.00	730,930.20	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	620,000.00	669,273.26	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	510,000.00	563,295.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	1,410,000.00	1,376,512.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.457%-53/03/31	760,000.00	788,880.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	650,000.00	659,016.15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	949,525.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,410,000.00	1,414,794.00	
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,150,000.00	1,193,858.70			
MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,057,400.50			
MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	1,010,000.00	1,003,269.36			
マレーシアリングット小計			23,440,000.00	23,907,136.67	(837,677,380)
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-25/11/25	20,000,000.00	20,182,500.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.22%-25/12/06	18,800,000.00	19,174,477.20	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.46%-26/02/15	10,900,000.00	11,039,187.55	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	17,000,000.00	17,375,411.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.3%-26/05/15	16,000,000.00	16,202,416.00	

CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-26/06/06	19,800,000.00	20,368,656.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	16,000,000.00	16,336,976.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-26/08/15	32,000,000.00	32,362,958.40	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.39%-26/11/15	14,500,000.00	14,745,050.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-26/12/05	23,000,000.00	23,767,349.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-27/01/20	10,000,000.00	10,181,020.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.04%-27/02/25	14,000,000.00	14,163,103.50	
CHINA GOVERNMENT BOND-1.85%-27/05/15	11,000,000.00	11,090,623.50	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	24,000,000.00	24,787,464.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	16,000,000.00	16,399,824.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-1.62%-27/08/15	4,100,000.00	4,111,792.42	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.44%-27/10/15	9,100,000.00	9,323,323.10	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.28%-27/12/03	19,500,000.00	20,529,678.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.64%-28/01/15	10,000,000.00	10,306,555.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-28/04/15	11,000,000.00	11,335,748.60	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	13,000,000.00	13,594,126.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.4%-28/07/15	10,900,000.00	11,158,256.97	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.48%-28/09/25	3,000,000.00	3,081,783.30	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	22,000,000.00	22,984,478.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.55%-28/10/15	10,000,000.00	10,301,888.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-28/11/22	10,000,000.00	10,635,610.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-29/01/15	7,500,000.00	7,684,075.87	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-29/03/24	15,000,000.00	15,643,725.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.05%-29/04/15	10,000,000.00	10,116,209.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-29/05/23	14,000,000.00	15,013,754.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-29/06/15	5,200,000.00	5,419,679.20	
CHINA GOVERNMENT BOND-1.91%-29/07/15	9,500,000.00	9,557,921.97	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-29/09/25	20,200,000.00	20,974,709.39	
CHINA GOVERNMENT BOND-1.74%-29/10/15	3,000,000.00	2,996,807.55	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.13%-29/11/21	2,700,000.00	2,882,444.40	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.79%-29/12/15	5,000,000.00	5,237,500.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-30/03/25	15,000,000.00	15,722,584.50	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	17,900,000.00	18,650,493.30	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-30/06/25	9,800,000.00	10,178,326.06	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-30/09/15	21,900,000.00	22,710,858.45	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	11,000,000.00	11,907,984.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.54%-30/12/25	8,400,000.00	8,684,908.68	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-31/03/25	13,000,000.00	13,232,349.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	10,000,000.00	10,671,680.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.12%-31/06/25	16,000,000.00	16,140,705.60	
CHINA GOVERNMENT BOND-1.87%-31/09/15	6,800,000.00	6,752,680.16	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.89%-31/11/18	8,000,000.00	8,470,304.00	

		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	10,000,000.00	10,490,000.00
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.76%-32/05/15	9,000,000.00	9,441,832.50
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-32/08/15	9,000,000.00	9,385,479.45
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-32/09/01	7,400,000.00	7,681,607.00
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-32/11/15	6,000,000.00	6,322,281.00
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-33/02/25	11,000,000.00	11,684,750.00
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/05/25	12,000,000.00	12,521,191.20
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.52%-33/08/25	12,800,000.00	13,198,517.12
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/11/25	19,700,000.00	20,567,312.20
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.35%-34/02/25	15,000,000.00	15,273,722.25
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.27%-34/05/25	13,000,000.00	13,172,268.20
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.11%-34/08/25	11,000,000.00	11,004,703.05
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	19,800,000.00	25,557,345.00
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	10,000,000.00	12,765,910.00
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.53%-51/10/18	10,000,000.00	12,425,950.00
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.32%-52/04/15	10,000,000.00	12,033,150.00
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-52/10/25	8,000,000.00	9,302,360.40
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-53/04/15	9,000,000.00	10,639,115.55
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.0%-53/10/15	9,900,000.00	11,401,770.10
中国元小計			828,100,000.00	869,059,220.69 (18,690,422,129)
イスラエル シケル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-0.5%-26/02/27	1,080,000.00	1,026,316.22
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	950,000.00	980,553.58
		ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,270,000.00	1,196,438.83
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-27/09/30	670,000.00	653,850.03
		ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,160,000.00	1,062,247.75
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-29/02/28	1,110,000.00	1,069,497.98
		ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	1,645,000.00	1,358,990.85
		ISRAEL FIXED BOND-1.3%-32/04/30	1,360,000.00	1,067,986.52
		ISRAEL FIXED BOND-4.0%-35/03/30	380,000.00	354,169.73
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	1,150,000.00	788,488.24
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,160,000.00	1,222,839.81
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,300,000.00	1,069,212.83
		ISRAEL FIXED BOND-2.8%-52/11/29	640,000.00	415,866.10
イスラエルシケル小計			13,875,000.00	12,266,458.47 (500,125,591)
合計				164,910,542,863 (164,910,542,863)

(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	218銘柄	100.0%	46.5%
加ドル	国債証券	39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	387銘柄	100.0%	30.4%
英ポンド	国債証券	60銘柄	100.0%	5.2%
スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券	10銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券	14銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券	28銘柄	100.0%	1.3%
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%
マレーシアリングgit	国債証券	27銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券	66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。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2024年11月29日現在です。

【DCインデックスバランス（株式20）】

【純資産額計算書】

資産総額	13,719,744,733円
負債総額	18,233,097円
純資産総額（ - ）	13,701,511,636円
発行済口数	7,653,794,879口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7902円

（参考）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	62,274,887,811円
負債総額	357,066,943円
純資産総額（ - ）	61,917,820,868円
発行済口数	22,041,113,597口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8092円

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	452,497,377,547円
負債総額	317,014,407円
純資産総額（ - ）	452,180,363,140円
発行済口数	64,574,533,489口
1口当たり純資産額（ / ）	7.0025円

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	55,634,560,907円
負債総額	5,501,530円
純資産総額（ - ）	55,629,059,377円
発行済口数	42,487,668,758口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3093円

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	163,878,392,412円
------	------------------

負債総額	359,084,467円
純資産総額（ - ）	163,519,307,945円
発行済口数	54,689,219,161口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9900円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

- (1) 名義書換
該当事項はありません。
- (2) 受益者に対する特典
該当事項はありません。
- (3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。
受益権の譲渡
- ・ 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとし、
 - ・ 前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとし、
 - ・ ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとし、
 - ・ 前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
- 受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。
- (4) 受益証券の再発行
受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。
- (5) 受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。
- (6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2024年11月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2024年11月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

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

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

・監査等委員会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（2024年11月末現在）

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

2【事業の内容及び営業の概況】

- 「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- 委託会社の運用する、2024年11月末現在の投資信託などは次の通りです。

種類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	772	302,674
株式投資信託	727	264,599
単位型	266	7,141
追加型	461	257,458
公社債投資信託	45	38,074
単位型	32	996
追加型	13	37,078

3【委託会社等の経理状況】

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

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

また、当社の中間財務諸表は、「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				
ソフトウェア		390		438
無形固定資産合計		390		438
投資その他の資産				
投資有価証券		23,274		28,465
関係会社株式		22,366		37,647
長期差入保証金		375		285
繰延税金資産		448		-
投資その他の資産合計		46,465		66,398
固定資産合計		47,224		67,205
資産合計		119,099		128,640

(単位：百万円)

	第64期 (2023年3月31日)		第65期 (2024年3月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金		433		451
未払金		7,557		9,211

未払収益分配金		7		7
未払償還金		71		71
未払手数料		6,586		8,330
その他未払金		892		803
未払費用	3	4,227	3	4,082
未払法人税等		-		1,644
未払消費税等		-	4	620
賞与引当金		2,563		2,619
役員賞与引当金		218		232
その他		647		683
流動負債合計		15,648		19,547
固定負債				
退職給付引当金		1,424		1,448
賞与引当金		437		565
役員賞与引当金		16		56
繰延税金負債		-		295
その他		181		251
固定負債合計		2,059		2,617
負債合計		17,708		22,165
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		79,307		82,591
利益剰余金合計		79,307		82,591
自己株式		2,067		2,067
株主資本合計		99,823		103,107
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		2,056		4,523
繰延ヘッジ損益		488		1,155
評価・換算差額等合計		1,567		3,367
純資産合計		101,391		106,475
負債純資産合計		119,099		128,640

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

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

特別利益			
投資有価証券売却益		427	815
訴訟損失引当金戻入額	4	4,481	-
特別利益合計		4,909	815
特別損失			
投資有価証券売却損		347	174
固定資産処分損		0	52
損害賠償損失		-	167
特別損失合計		347	394
税引前当期純利益		22,420	10,740
法人税、住民税及び事業税		1,340	2,415
法人税等調整額		3,252	51
法人税等合計		4,593	2,364
当期純利益		17,826	8,376

(3) 【株主資本等変動計算書】

第64期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

第65期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本	
	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	利益剰余金 合計	自己株式	株主資本 合計
				繰越利益 剰余金			
当期首残高	17,363	5,220	5,220	79,307	79,307	2,067	99,823
当期変動額							
剰余金の配当				5,092	5,092		5,092
当期純利益				8,376	8,376		8,376
自己株式の取得							
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)							
当期変動額合計	-	-	-	3,284	3,284	-	3,284
当期末残高	17,363	5,220	5,220	82,591	82,591	2,067	103,107

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	2,056	488	1,567	101,391
当期変動額				
剰余金の配当				5,092
当期純利益				8,376
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	2,467	666	1,800	1,800
当期変動額合計	2,467	666	1,800	5,084
当期末残高	4,523	1,155	3,367	106,475

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 市場価格のない株式等 総平均法による原価法 (2) 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、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。
3 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。

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

（重要な会計上の見積り）

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
該当事項はありません。

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

（貸借対照表関係）

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

<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>未収収益 263百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払費用 1,778百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未収入金」に含めて表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド(旧社名「日興AMエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」)が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大448百万円(5百万豪ドル)を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。</p>	<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>未収収益 248百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払費用 1,873百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務</p> <p>ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド(旧社名「日興AMエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」)が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大493百万円(5百万豪ドル)を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。</p>
--	---

(損益計算書関係)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	2,860,000	-	-	2,860,000

3 新株予約権等に関する事項

	新株予約権の目的となる株式の数(株)

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	当事業年度末残高(百万円)
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	88,000	-	88,000	-	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	816,000	-	599,000	217,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,536,000	-	784,000	752,000	-
合計		2,440,000	-	1,471,000	969,000	-

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

2 2016年度ストックオプション(2)217,000株及び2017年度ストックオプション(1)752,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年5月27日 取締役会	普通株式	7,420	38.22	2022年3月31日	2022年6月27日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	2,860,000	-	-	2,860,000

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	217,000	-	96,000	121,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	752,000	-	406,000	346,000	-
合計		969,000	-	502,000	467,000	-

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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

(リース取引関係)

第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料
1年内 899百万円	1年内 891百万円
1年超 3,425百万円	1年超 2,613百万円
合計 4,324百万円	合計 3,505百万円

(金融商品関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針」5「ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、預金の預入れやデリバティブ取引を行う金融機関の選定に関しては、相手方の財政状態及び経営成績、又は必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益（ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益）を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュエーション・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。さらに、外貨建ての貸付金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

のない株式等は、次表には含めておりません。

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券 その他有価証券 投資信託	6,238	18,045	-	24,283
資産計	6,238	18,045	-	24,283
デリバティブ取引(*1) 株式関連(*2) 通貨関連(*3)	246	-	-	246
	-	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、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については金銭の信託及び短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「5 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、預金の預入れやデリバティブ取引を行う金融機関の選定に関しては、相手方の財政状態及び経営成績、又は必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関して、定期的継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益（ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益）を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュエーション・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。さらに、外貨建ての貸付金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

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

(1) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、で示しております。

(2) 株式関連のデリバティブ取引の 309百万円は、貸借対照表上流動資産及び流動負債のその他に含まれております。

(3) 通貨関連のデリバティブ取引の 367百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

資産

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買取請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限が無い場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

有価証券

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

デリバティブ取引

株式関連

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

通貨関連

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額
非上場株式	2,540
子会社株式	19,011
関連会社株式	18,635

3 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,198			
未収委託者報酬	21,592			
未収収益	647			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	1	169	2,483	-
合計	53,440	169	2,483	-

(有価証券関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

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

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	19,011
関連会社株式	18,635

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

2 非上場株式等(貸借対照表計上額2,540百万円)については、市場価格のない株式等であることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	8,145	1,057	167
合計	8,145	1,057	167

4 保有目的を変更した有価証券

注記事項「（損益計算書関係） 3 有価証券評価益」をご参照ください。

（金銭の信託関係）

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

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

（デリバティブ取引関係）

第64期(2023年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第65期(2024年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引 株価指数先物取引 売建	15,077	-	309	309
合計	15,077	-	309	309

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

該当事項はありません。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		6,465	-	268
	豪ドル		84	-	2
	香港ドル		542	-	17
	人民元		2,979	-	17
	ユーロ		2,172	-	60
	合計		12,243	-	367

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第64期 (自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日)	第65期 (自 2023年 4月 1日 至 2024年 3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 5,326	(1) 関連会社に対する投資の金額 5,342
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 16,722	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 17,691
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,185	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,474

(退職給付関係)

第64期(自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

退職給付引当金	1,424
貸借対照表に計上された負債の額	1,424

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	133
利息費用	4
数理計算上の差異の費用処理額	1

確定給付制度に係る退職給付費用	136
-----------------	-----

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

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

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

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

- 2 確定給付制度

- (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,366
勤務費用	134
利息費用	8
数理計算上の差異の発生額	9
退職給付の支払額	110
退職給付債務の期末残高	1,407

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

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

退職給付引当金	1,448
貸借対照表に計上された負債の額	1,448

- (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

- (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項
 当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎
 割引率 0.7%

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

(ストックオプション等関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

- 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

- (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

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

	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2018年4月27日

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

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

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定前(株)		
期首	217,000	752,000
付与	0	0
失効	96,000	406,000
権利確定	0	0
権利未確定残	121,000	346,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

(税効果会計関係)

第64期 (2023年3月31日)	第65期 (2024年3月31日)

1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳
(単位：百万円)	(単位：百万円)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 918	賞与引当金 975
投資有価証券評価損 97	投資有価証券評価損 8
関係会社株式評価損 52	関係会社株式評価損 52
退職給付引当金 436	退職給付引当金 443
固定資産減価償却費 83	固定資産減価償却費 80
繰延ヘッジ損益 215	繰延ヘッジ損益 510
その他 672	その他 679
繰延税金資産小計 2,478	繰延税金資産小計 2,750
評価性引当金 52	評価性引当金 52
繰延税金資産合計 2,425	繰延税金資産合計 2,697
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金 1,028	その他有価証券評価差額金 2,044
その他 948	その他 948
繰延税金負債合計 1,977	繰延税金負債合計 2,992
繰延税金資産の純額 448	繰延税金負債の純額 295
2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳
法定実効税率 30.6%	法定実効税率 30.6%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 1.0%	交際費等永久に損金に算入されない項目 1.2%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 12.0%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 10.9%
その他 0.8%	その他 1.1%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 20.5%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 22.0%

(関連当事者情報)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	232,369 (SGD千)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	-	関係会社短期貸付金	3,318 (SGD 33,000千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	103 (SGD 1,043千)	未収収益	55 (SGD 551千)
							資金の返済(米国ドル貸建)(注2)	2,019 (USD 16,500千)	関係会社短期貸付金	-
							貸付金利息(米国ドル貸建)(注2)	3 (USD 26千)	未収収益	-

子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注3)	アセット マネジメン ト業	直接100.00	-	配当の受取	7,795 (USD 58,000千)	-	-
-----	-------------------------------------	----	---------------------------	---------------------	----------	---	-------	---------------------------	---	---

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2022年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

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

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	232,369 (SGD千)	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	資金の返済 (シンガポールドル貸建) (注1)	3,318 (SGD 33,000千)	関係会社 短期 貸付金	-
							貸付金利息 (シンガポールドル貸建) (注1)	22 (SGD 223千)	未収収益	-
							関係会社 株式の取得 (注2)	13,412	-	-
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注3)	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	配当の受取	2,950 (USD 20,000千)	-	-
子会社	Nikko AM Global Holdings Limited	英国	3,378	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	増資の引受 (注4)	1,828	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

1. 融資枠55百万シンガポールドル、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
2. Nikko Asset Management International Limitedが保有する関連会社AHAM Asset Management Berhadの20%の株式を、2023年4月19日に13,412百万円で取得しました。
3. Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。
4. Nikko AM Global Holdings Limitedの行った1,828,000,000株の新株発行増資を、1株につき1円で当社が引受けたものであります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2023年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

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

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

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

関連情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
該当事項はありません。

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

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
該当事項はありません。

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

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
該当事項はありません。

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

(収益認識関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益(百万円)	17,826	8,376
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-

普通株式に係る当期純利益（百万円）	17,826	8,376
普通株式の期中平均株式数（千株）	194,152	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2016年度ストックオプション（2）217,000株、2017年度ストックオプション（1）752,000株	2016年度ストックオプション（2）121,000株、2017年度ストックオプション（1）346,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第64期 (2023年3月31日)	第65期 (2024年3月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	101,391	106,475
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	-	-
普通株式に係る期末の純資産額（百万円）	101,391	106,475
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数（千株）	194,152	194,152

（重要な後発事象）
該当事項はありません。

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						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本 準備金	資本 剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	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 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法

	<p>その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 市場価格のない株式等 総平均法による原価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p> <p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 収益の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行业務の内容及び当該履行业務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。</p> <p>(1) 投資信託委託業務 当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高(以下「AUM」)に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドのAUMに固定料率を乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問業務 当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドのAUMに投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。</p>

<p>5 ヘッジ会計の方法</p>	<p>(3) 成功報酬 当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。</p> <p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引細則等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
<p>6 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>(1) 資産に係る控除対象外消費税等の会計処理 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は当中間会計期間の費用として処理しております。</p> <p>(2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。</p>

（中間貸借対照表関係）

<p>第66期中間会計期間 (2024年9月30日)</p>	
1	<p>有形固定資産の減価償却累計額 2,372百万円</p>
2	<p>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。</p>
3	<p>消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p>
4	<p>保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド（旧社名「日興AMエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」）が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大493百万円（5百万豪ドル）を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。</p>

（中間損益計算書関係）

<p>第66期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)</p>	
--	--

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 有価証券 その他有価証券 投資信託	-	13,876	-	13,876
資産計	6,989	10,736	-	17,725
デリバティブ取引(1、2)	6,989	24,613	-	31,602
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	投資有価証券			
	米ドル		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。
以下の変更について、2024年9月26日の臨時株主総会で決議されており、2025年9月1日付で定款の変更を行いません。
・商号の変更（アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社に変更）
- (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
S M B C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。
株式会社S B I証券	54,323百万円	
損保ジャパンD C証券株式会社	3,000百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
住友生命保険相互会社	689,000百万円 (基金及び基金償却積立金の合計額)	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
ソニー生命保険株式会社	70,000百万円	
日本生命保険相互会社	1,450,000百万円 (基金及び基金償却積立金の合計額)	
富国生命保険相互会社	128,000百万円 (基金及び基金償却積立金の合計額)	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	
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 2月 6日	有価証券届出書
2024年 2月 6日	有価証券報告書
2024年 8月 6日	有価証券届出書
2024年 8月 6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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年1月29日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中PwC Japan有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCインデックスバランス（株式20）の2023年11月7日から2024年11月6日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCインデックスバランス（株式20）の2024年11月6日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1.上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2.XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付け

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。