

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2025年3月14日提出
【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
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	5兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

**第一部【証券情報】****(1)【ファンドの名称】**

世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型（以下「ファンド」といいます。）  
・愛称として「世界の財産3分法ファンド」、「世界の財産3分法」という名称を用いることがあります。

**(2)【内国投資信託受益証券の形態等】**

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

**(3)【発行（売出）価額の総額】**

5兆円を上限とします。

**(4)【発行（売出）価格】**

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

**(5)【申込手数料】**

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

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

**(6)【申込単位】**

販売会社の照会先にお問い合わせください。

**(7)【申込期間】**

2025年3月15日から2025年9月16日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

**(8)【申込取扱場所】**

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

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/](http://www.nikkoam.com/)

2025年9月1日より[www.amova-am.com](http://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。

**(9)【払込期日】**

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

**(10)【払込取扱場所】**

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

( 1 1 ) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

( 1 2 ) 【その他】

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

国内外の不動産、債券、株式に分散投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

##### 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来から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	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資産 複合 資産配分 固定型(株式、債 券、不動産投 信)))		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、不動産投信)))  
 当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式、債券および不動産投信に投資を行いません。  
 よって、商品分類の「投資対象資産(収益の源泉)」においては、「資産複合」に分類されます。  
 「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12回(毎月)  
 目論見書または投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいいます。  
 グローバル(含む日本)  
 目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする  
 旨の記載があるものをいいます。  
 ファミリーファンド  
 目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるもの  
 を除きます。)を投資対象として投資するものをいいます。  
 為替ヘッジなし  
 目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替の  
 ヘッジを行なう旨の記載がないものをいいます。  
 属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載して  
 おります。

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

## ファンドの特色



## 主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行ないます。

- 国内外の不動産、債券および株式の3つの異なる資産へ投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。



## 国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

- 投資信託証券(マザーファンド)への投資を通じて、原則として国内外の各3資産へそれぞれ純資産総額の6分の1を基本に国際分散投資を行ないます。



## 原則として、毎月、安定した収益分配を行なうことをめざします。

- インカム収益に加え、キャピタル収益を原資として、毎月の安定的な分配をめざします。
- 毎月15日(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

※毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として安定した分配を継続的に行なうことをめざします。

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



### 「財産3分法」とは？

財産を「不動産・現金(預金)・株式」の3つの資産に分けて保管・運用することを「財産3分法」といいます。

先達の知恵として、財産を3つの資産に分散することで、安定性・流動性・収益性を保ちながら資産形成が行なわれてきました。

※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。



主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行います。

[世界の財産3分法ファンド]  
基本組入比率

国内の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

東証REIT指数(配当込み)

国内の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

TOPIX(東証株価指数)配当込み

海外の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

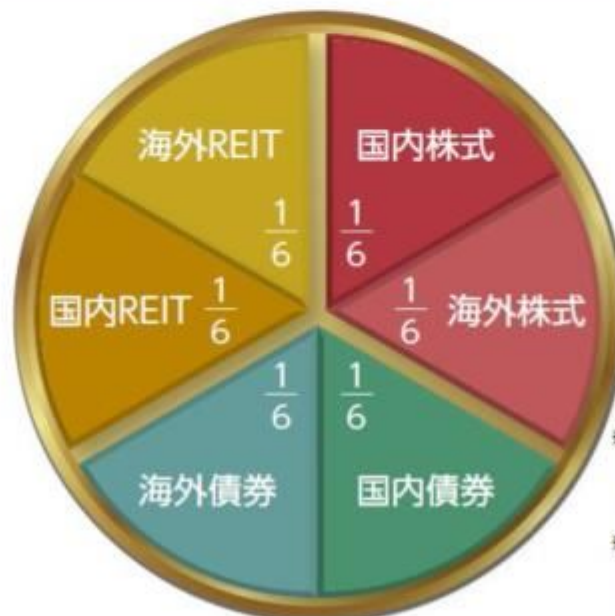
連動をめざす指数(インデックス)

S&P先進国REIT指数  
(除く日本、税引後配当込み、  
ヘッジなし・円ベース)

海外の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

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)



※「基本組入比率」および「連動をめざす指数(インデックス)」は、2024年12月末現在のものであり、将来変更となる場合があります。  
※市況動向および資金動向などにより左記のような運用ができない場合があります。

海外の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

FTSE世界国債インデックス  
(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

国内の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

NOMURA-BPI総合





## 国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

それぞれの資産は、異なる値動きをする傾向があります。

### 各資産の値動きの特徴

	REIT(不動産投資)	債券	株式
景気が良くなると	空室率や賃料水準が改善傾向 価格が上がる傾向	金利が上がる傾向 債券価格は下がる傾向	企業業績が改善する傾向 株価は上がる傾向
景気が悪くなると	空室率や賃料水準が悪化の傾向 価格は下がる傾向	金利が下がる傾向 債券価格は上がる傾向	企業業績が悪化する傾向 株価は下がる傾向

※価格変動などに関する説明は一般論であり、実際はこれと異なる動きをする場合があります。

### ご参考: 設定来のファンドと各資産の推移 (マザーファンドベース)

(2005年9月(設定月)～2024年12月、月末値)



※基準価額は信託報酬(後述の「手続・手数料等」参照)控除後の値です。

※分配金再投資基準価額とは、税引前分配金を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

※各資産の値動きは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの値動きを示しています。

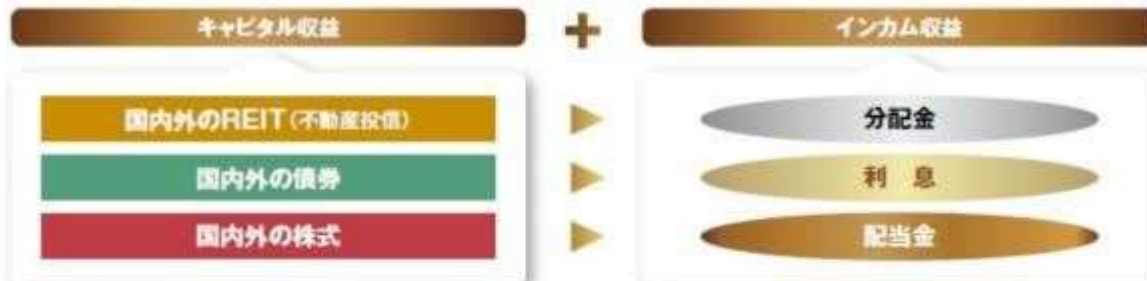
※上記グラフは過去のものであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。





**3 インカム収益（投資した資産から生じる利息、配当金、分配金収入など）に加え、キャピタル収益（投資した資産自体の値上がり益）を原資として、毎月の安定的な分配をめざします。**

- 毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
- 分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や、分配を行なわない場合があります。



### ご参考:各指数の利回り

(2024年12月末現在)



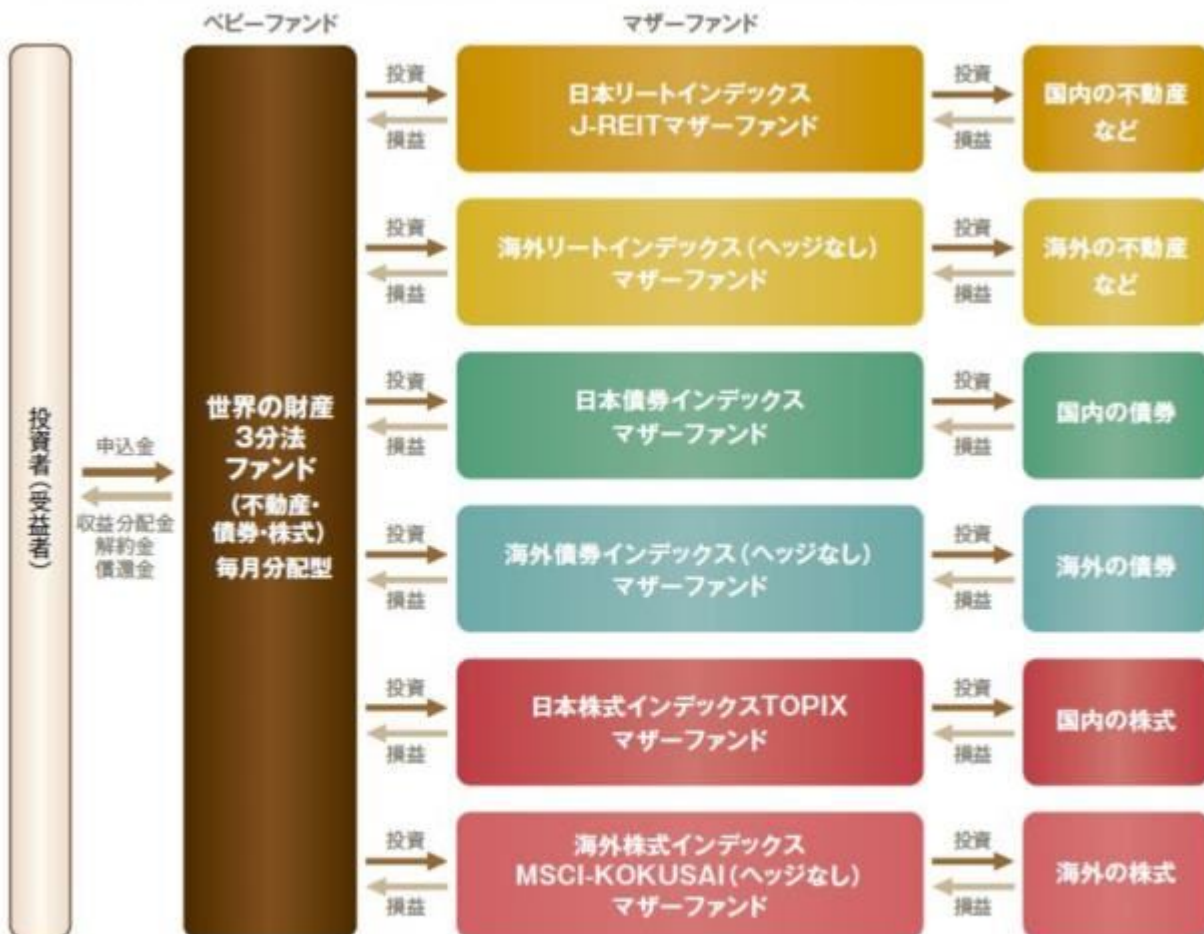
※各資産のリスク特性はそれぞれ異なるため、利回りだけで比較できるものではありません。  
※上記は過去の各指数の利回りであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

### 各指数(インデックス)の著作権などの権利について

- **東証REIT指数** 同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)に帰属します。また、JPXは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- **S&P先進国REIT指数** 同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービス エル エル シー(S&P)社に帰属します。また、S&P社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- **NOMURA-BPI総合** 同指数は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下「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** 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。
- **TOPIX(東証株価指数)** 同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)に帰属します。また、JPXは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- **MSCI-KOKUSAI インデックス** 同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

## ■ファンドの仕組み

- 当ファンドは、主にマザーファンドに投資するファミリーファンド方式で運用を行いません。



### (主な投資制限)

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

### (分配方針)

- ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
- ※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。



## 収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

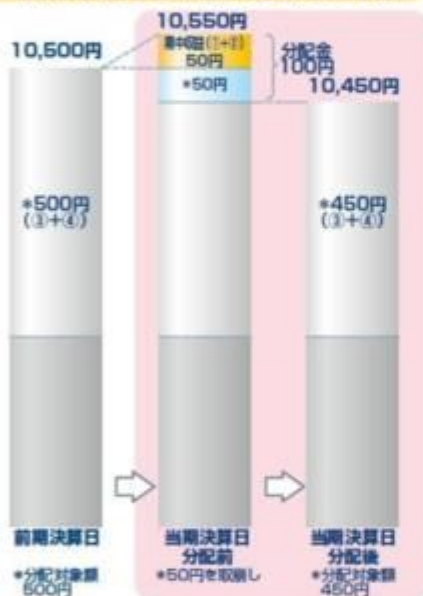
### 投資信託で分配金が支払われるイメージ



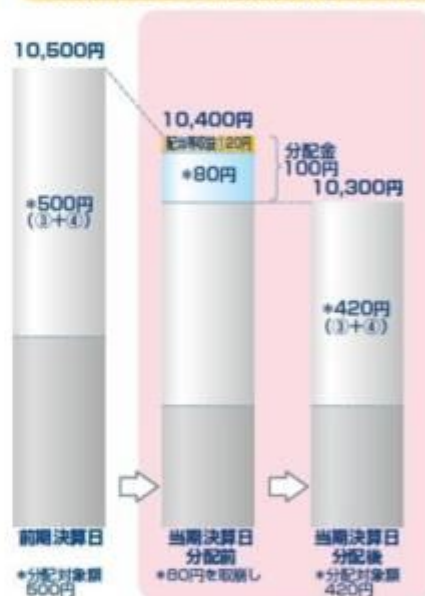
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

### 計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

#### 前期決算から基準価額が上昇した場合



#### 前期決算から基準価額が下落した場合



(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。  
※上記はイメージであり、将来の分配金の支払いおよび金額ならびに基準価額について示唆、保証するものではありません。

- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

#### 分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



#### 分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



※ 元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

- ・ 普通分配金：個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。
- ・ 元本払戻金：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、(特別分配金) 元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

### 信託金限度額

- ・ 30兆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】

2005年 9月29日

- ・ ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2006年 3月9日

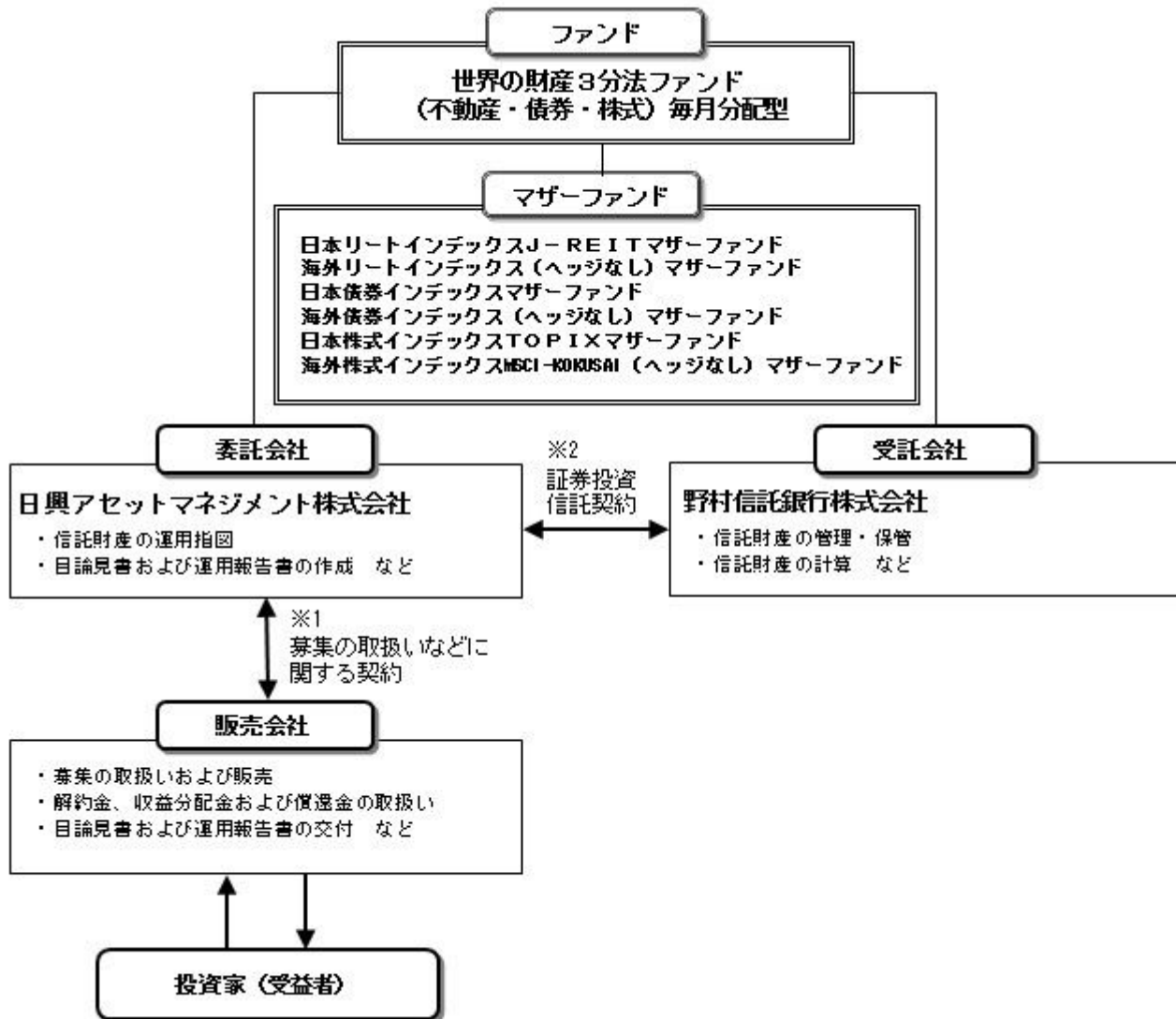
- ・ ファンド名称変更

新名称：世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型

旧名称：世界の財産3分法ファンド（バランス重視）毎月分配型

## (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12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

**amova**  
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、以下に掲げる各投資信託証券に投資を行ない、安定した収益の確保と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。
- ・各マザーファンドへの投資比率は、原則として、信託財産の純資産総額の6分の1を基本としますが、資金動向やその見通しなどによっては5%から25%の範囲内で組入比率を変更する場合があります。
  - 証券投資信託「日本リートインデックス」- REITマザーファンド」
  - 証券投資信託「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
  - 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
  - 証券投資信託「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
  - 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」
- ・特に「日本リートインデックス」- REITマザーファンド」や「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」においては、投資対象としている資産の流動性が他のマザーファンドと比べて相対的に低い場合、資金の流出入に備える場合や純資産規模が大きくなった場合などには両マザーファンドの組入比率をそれぞれ5%を下限として引き下げる場合があります。両マザーファンドの組入比率を引き下げた場合には、現金の比率を高くする場合や他のマザーファンドの組入比率をそれぞれ25%を上限に引き上げる場合があります。また、組入比率はファンド全体として国内資産の実質組入比率と海外資産の実質組入比率が概ね50%程度ずつになるように決定します。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき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】

- <世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型>  
 投資信託証券(投資信託または外国投資信託の受益証券(振替投資信託受益権を含みます。))および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。)を主要投資対象とします。  
 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
  - 2) 金銭債権
  - 3) 約束手形
  - 4) 為替手形
- 主として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「日本リートインデックス」- REITマザーファンド」
  - 2) 証券投資信託「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」
  - 3) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
  - 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」
  - 5) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
  - 6) 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」
  - 7) 短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)およびコマーシャル・ペーパー
  - 8) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)の証券の性質を有するもの
  - 9) 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。)
  - 10) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)のうち投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)に類する証券以外のもの
  - 11) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
- 1) 預金
  - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
  - 3) コール・ローン
  - 4) 手形割引市場において売買される手形
- 次の取引ができます。
- 1) 外国為替予約取引
  - 2) 資金の借入
- <日本リートインデックス」- REITマザーファンド>  
 わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。  
 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
  - 2) 金銭債権
  - 3) 約束手形
  - 4) 為替手形
- 主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。
- 1) 短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)およびコマーシャル・ペーパー
  - 2) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)

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



- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの  
次の取引ができます。
- 1) 先物取引等
  - 2) スワップ取引
  - 3) 金利先渡取引
  - 4) 有価証券の貸付
  - 5) 公社債の空売
  - 6) 公社債の借入
- < 海外債券インデックス（ヘッジなし）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。）
  - 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。）
  - 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。）
  - 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
- < 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。）
  - 3) 金銭債権
  - 4) 約束手形
  - 5) 為替手形
- 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
- 1) 株券または新株引受権証書
  - 2) 国債証券
  - 3) 地方債証券

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

- 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの  
次の取引ができます。
- 1) 信用取引
- 2) 先物取引等
- 3) スワップ取引
- 4) 金利先渡取引
- 5) 為替先渡取引
- 6) 有価証券の貸付
- 7) 公社債の空売
- 8) 公社債の借入
- 9) 外国為替予約取引

### 投資対象とする投資信託証券の概要

#### <日本リートインデックスJ-REITマザーファンド>

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

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

東証REIT指数の指数値および東証REIT指数に係る標章または商標は、株式会社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、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数に係る標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、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 J P X は責任を負いません。

### < 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

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

### ファンドに係る費用

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

### その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社 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（2005年6月30日設定）
決算日	毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

### < 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 <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。

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

### ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）
その他の費用など	組入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） <sup>*</sup> の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</li> <li>投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</li> <li>外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。</li> <li>ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</li> </ul>

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

**ファンドに係る費用**

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入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。

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

**ファンドに係る費用**

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



その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<b>その他</b>	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社 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、遅延または中絶に対し、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 >

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

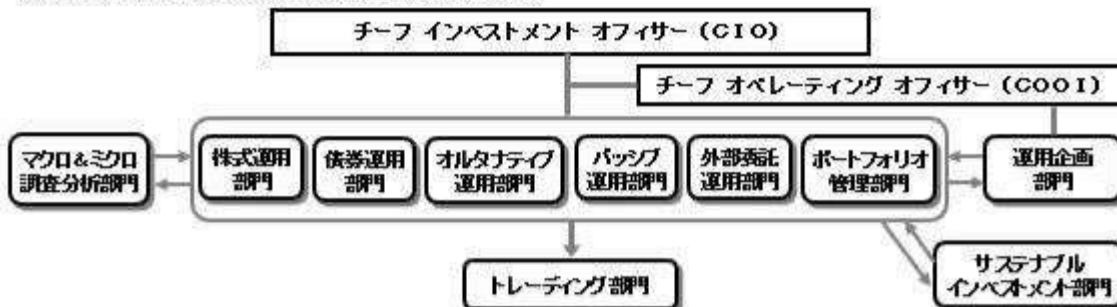
\* MSCI-KOKUSAIインデックスは、MSCI Inc. が発表している、日本を除く世界の主要国の株式市場の合

成パフォーマンスを表す指数です。

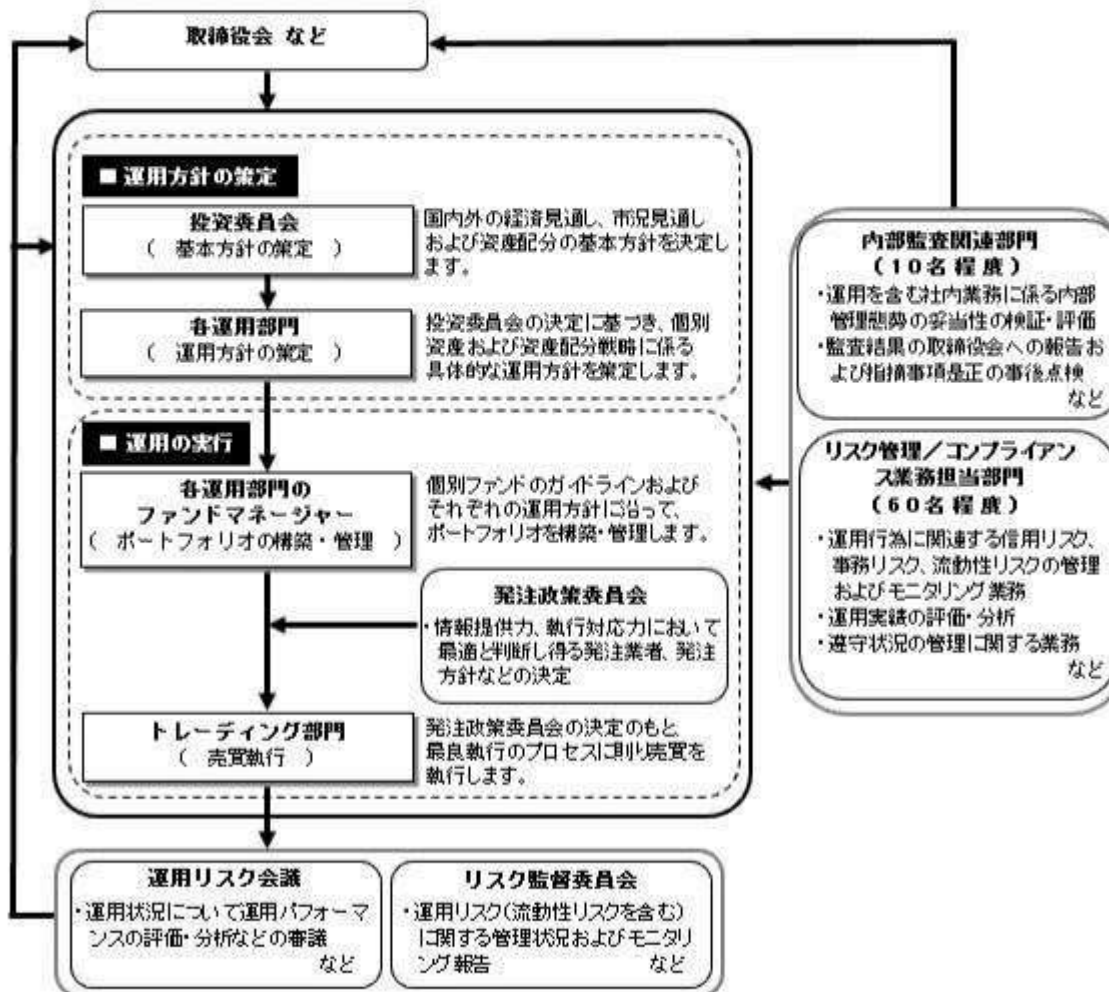
同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

### （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、日々の純資産割合、月次の勤定残高割合などを行なっております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行っており、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12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、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
  - 3) 留保益の運用方針  
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
- 収益分配金の支払い
- < 分配金再投資コース >  
原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。
  - < 分配金受取りコース >  
毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）から収益分配金を支払います。支払いは販売会社において行なわれます。

## (5) 【投資制限】

## 約款に定める投資制限

< 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) 投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- 2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
- 3) 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産に属する外貨建資産の時価総額と投資信託証券の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- 6) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
  - イ) 解約に伴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
- 二) 解約に伴なう支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。

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

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

#### <日本リートインデックスJ-REITマザーファンド>

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

#### <海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

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

#### <日本債券インデックスマザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 3) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとし、
- 4) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとし、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、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、
- 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の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。

#### < 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。



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

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

- 1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡し取引および為替先渡し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



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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

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

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

#### 価格変動リスク

- ・一般に不動産投信は、不動産や不動産証券化商品に投資して得られる収入や売却益などを収益源としており、不動産を取り巻く環境や規制、賃料水準、稼働率、不動産市況や長短の金利動向、マクロ経済の変化など様々な要因により価格が変動します。また、不動産の老朽化や立地条件の変化、火災、自然災害などに伴う不動産の滅失・毀損などにより、その価格が影響を受ける可能性もあります。不動産投信の財務状況、業績や市況環境が悪化する場合、不動産投信の分配金や価格は下がり、ファンドに損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。
- ・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。

#### 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

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

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

#### <その他の留意事項>

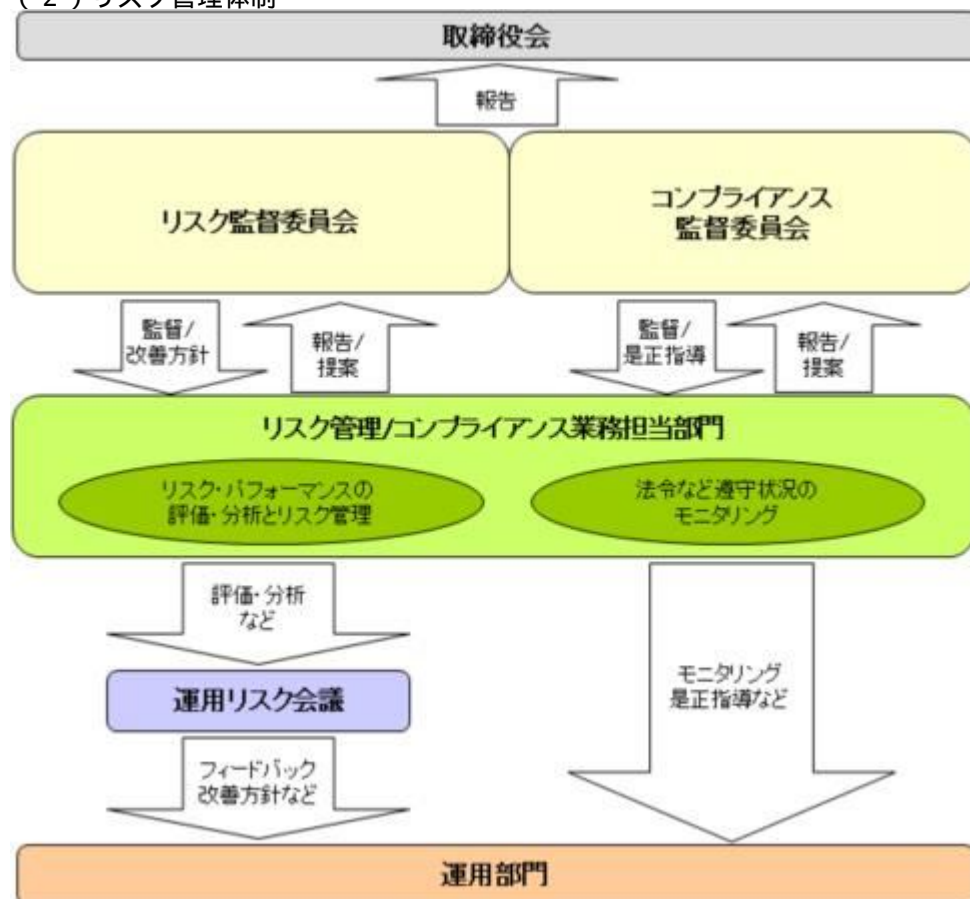
##### ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

換金の取り扱いを停止することもあります。

- ・投資対象とする投資信託証券に関する事項  
諸事情により、投資対象とする投資信託証券（マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。）にかかる投資や換金ができない場合があります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができなくなる場合があります。また、一時的にファンドの取得・換金ができなくなることもあります。  
ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流出入などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項  
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項  
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項  
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。
- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項  
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

## （２）リスク管理体制



### 全社的リスク管理

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

### 運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

い、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

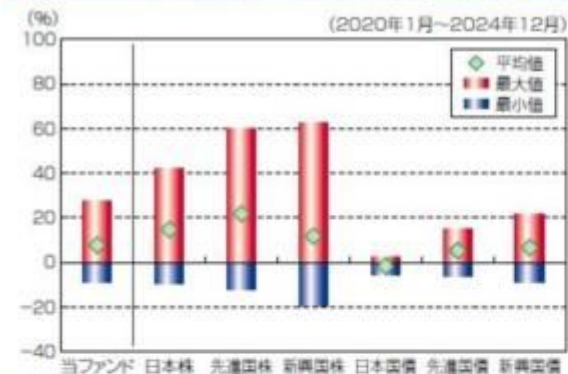
### 法令など遵守状況のモニタリング

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

上記体制は2024年12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	7.8%	14.7%	21.7%	11.7%	-1.7%	5.3%	6.6%
最大値	27.4%	42.1%	59.8%	62.7%	2.3%	15.3%	21.5%
最小値	-8.7%	-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2020年1月から2024年12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)

※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。

### 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、2020年1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。

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)

## 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

### TOPIX(東証株価指数)配当込み

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

### MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

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

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

### NOMURA-BPI国債

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

### FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

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



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

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

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

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

##### (2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.2%の率を乗じて得た額（1口当たり）が差し引かれます。

「信託財産留保額」とは、投資信託を解約される受益者の解約代金から差し引いて、信託財産に繰り入れる金額のことであります。

##### (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1.045%（税抜0.95%）の率を乗じて得た額とします。

この他に、投資対象とする「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」および「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」の主要投資対象である不動産投信には運用などに係る費用がかかりますが、投資する不動産投信の銘柄は固定されていないため、事前に料率、上限額などを表示することができません。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

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
0.95%	0.40%	0.50%	0.05%

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

##### (4)【その他の手数料等】

以下の諸費用およびそれに付随する消費税等相当額について、委託会社は、その支払いをファンドのために行ない、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。（以下「実費方式」といいます。）また、実際に支払う金額の支弁を受ける代わりに、その金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、見積額に基づいて見積率を算出し、かかる見積率を信託財産の純資産総額に乘じて得た額をかかる諸費用の合計額とみなして、信託財産から支弁を受けることができます。（以下「見積方式」といいます。）ただし、委託会社は、信託財産の規模などを考慮して、信託の設定時または期中に、かかる諸費用の見積率を見直し、年率0.1%を上限として、これを変更することができます。委託会社は、実費方式または見積方式のいずれを用いるかについて、信託期間を通じて随時、見直すことができます。これら諸費用は、委託会社が定めた時期に、信託財産から支払います。

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

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

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

信託約款の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含まず。）  
 運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含まず。）  
 ファンドの受益者に対して行なう公告に係る費用ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用。  
 格付の取得に要する費用。  
 ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。  
 ファンドの主要投資対象の1つである「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」の運用の基本方針に規定する「東証REIT指数（配当込み）」その他これに類する標章の使用料。  
 ファンドの主要投資対象の1つである「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」の運用の基本方針に規定する「S&P先進国REIT指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）」その他これに類する標章の使用料。  
 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。  
 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。

< 投資対象とする投資信託証券に係る費用 >

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

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

個人受益者の場合

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

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

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

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

法人受益者の場合

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

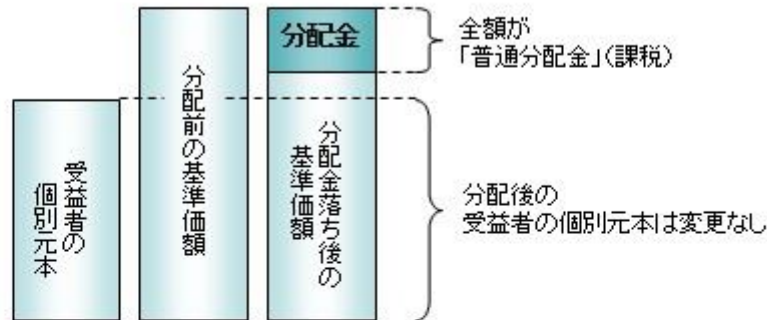
普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際  
 イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

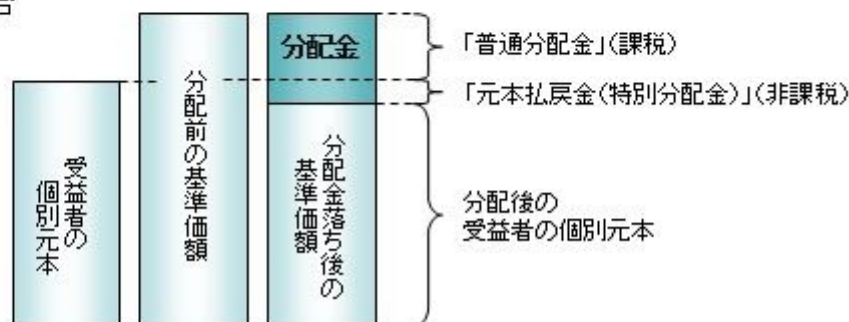
- ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。上記は2025年3月14日現在のもので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

(参考情報) ファンドの総経費率

対象期間: 2024年6月18日~2024年12月16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
1.08%	1.04%	0.04%

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

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

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

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

5【運用状況】

【世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型】

以下の運用状況は2024年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	37,938,323,959	98.80
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		461,278,740	1.20
合計(純資産総額)		38,399,602,699	100.00

(2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI (ヘッジなし) マザーファンド	914,432,887	7.2089	6,592,055,240	7.2833	6,660,089,045	17.34
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	2,217,695,011	2.8697	6,364,119,374	2.9224	6,480,991,900	16.88
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	2,084,712,893	3.0368	6,330,856,114	3.0837	6,428,629,148	16.74
日本	親投資信託受益証券	海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド	1,720,557,065	3.7152	6,392,213,608	3.6808	6,333,026,444	16.49
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	4,627,294,198	1.3091	6,057,590,834	1.3079	6,052,038,081	15.76
日本	親投資信託受益証券	日本リートインデックスJ - REITマザーファンド	2,484,553,146	2.3583	5,859,321,684	2.4083	5,983,549,341	15.58

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	98.80
合計	98.80

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第20特定期間末 (2015年 6月15日)	48,576	48,632	0.8576	0.8586
第21特定期間末 (2015年12月15日)	42,709	42,762	0.8131	0.8141
第22特定期間末 (2016年 6月15日)	39,155	39,206	0.7769	0.7779
第23特定期間末 (2016年12月15日)	39,745	39,793	0.8277	0.8287
第24特定期間末 (2017年 6月15日)	36,443	36,487	0.8278	0.8288
第25特定期間末 (2017年12月15日)	34,568	34,608	0.8629	0.8639
第26特定期間末 (2018年 6月15日)	32,895	32,934	0.8573	0.8583
第27特定期間末 (2018年12月17日)	31,635	31,672	0.8421	0.8431
第28特定期間末 (2019年 6月17日)	31,844	31,881	0.8638	0.8648
第29特定期間末 (2019年12月16日)	32,740	32,776	0.9108	0.9118
第30特定期間末 (2020年 6月15日)	29,571	29,607	0.8310	0.8320
第31特定期間末 (2020年12月15日)	31,006	31,041	0.8907	0.8917
第32特定期間末 (2021年 6月15日)	34,941	34,975	1.0217	1.0227
第33特定期間末 (2021年12月15日)	36,248	36,283	1.0365	1.0375
第34特定期間末 (2022年 6月15日)	35,426	35,462	0.9906	0.9916



第35特定期間末	(2022年12月15日)	37,443	37,480	1.0208	1.0218
第36特定期間末	(2023年 6月15日)	39,363	39,400	1.0678	1.0688
第37特定期間末	(2023年12月15日)	38,974	39,009	1.0988	1.0998
第38特定期間末	(2024年 6月17日)	39,212	39,245	1.1834	1.1844
第39特定期間末	(2024年12月16日)	38,305	38,337	1.2012	1.2022
	2023年12月末日	38,850		1.1069	
	2024年 1月末日	39,045		1.1302	
	2月末日	39,063		1.1442	
	3月末日	39,824		1.1786	
	4月末日	39,468		1.1772	
	5月末日	39,115		1.1771	
	6月末日	39,887		1.2058	
	7月末日	38,985		1.1870	
	8月末日	38,469		1.1773	
	9月末日	38,321		1.1774	
	10月末日	38,980		1.2078	
	11月末日	38,395		1.1986	
	12月末日	38,399		1.2115	

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間末の分配金を加算した金額です。

#### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	0.0060
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	0.0060
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	0.0060
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	0.0060
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	0.0060
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	0.0060
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	0.0060
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	0.0060
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	0.0060
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	0.0060
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	0.0060
第31特定期間	2020年 6月16日～2020年12月15日	0.0060
第32特定期間	2020年12月16日～2021年 6月15日	0.0060
第33特定期間	2021年 6月16日～2021年12月15日	0.0060
第34特定期間	2021年12月16日～2022年 6月15日	0.0060
第35特定期間	2022年 6月16日～2022年12月15日	0.0060
第36特定期間	2022年12月16日～2023年 6月15日	0.0060
第37特定期間	2023年 6月16日～2023年12月15日	0.0060
第38特定期間	2023年12月16日～2024年 6月17日	0.0060
第39特定期間	2024年 6月18日～2024年12月16日	0.0060

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	4.84
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	4.49
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	3.71
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	7.31
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	0.74
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	4.96
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	0.05
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	1.07
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	3.29
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	6.14
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	8.10
第31特定期間	2020年 6月16日～2020年12月15日	7.91
第32特定期間	2020年12月16日～2021年 6月15日	15.38
第33特定期間	2021年 6月16日～2021年12月15日	2.04
第34特定期間	2021年12月16日～2022年 6月15日	3.85
第35特定期間	2022年 6月16日～2022年12月15日	3.65
第36特定期間	2022年12月16日～2023年 6月15日	5.19
第37特定期間	2023年 6月16日～2023年12月15日	3.47
第38特定期間	2023年12月16日～2024年 6月17日	8.25
第39特定期間	2024年 6月18日～2024年12月16日	2.01

(注)各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落ち）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（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20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	1,077,889,968	7,702,577,651
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	822,766,387	4,936,873,357
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	559,222,913	2,691,021,175
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	788,561,373	3,167,580,874
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	535,316,706	4,530,717,126
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	675,282,245	4,636,099,733
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	900,474,282	2,591,559,940
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	1,657,593,437	2,463,297,514
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	1,553,018,779	2,252,941,131
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	1,375,802,750	2,295,826,563
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	1,727,094,985	2,087,383,750
第31特定期間	2020年 6月16日～2020年12月15日	1,154,110,398	1,927,320,256
第32特定期間	2020年12月16日～2021年 6月15日	2,277,192,099	2,890,774,812
第33特定期間	2021年 6月16日～2021年12月15日	2,642,144,579	1,866,998,446
第34特定期間	2021年12月16日～2022年 6月15日	2,197,942,225	1,407,308,080

第35特定期間	2022年 6月16日～2022年12月15日	2,127,865,577	1,212,529,506
第36特定期間	2022年12月16日～2023年 6月15日	1,533,696,702	1,347,087,591
第37特定期間	2023年 6月16日～2023年12月15日	1,301,936,668	2,696,216,303
第38特定期間	2023年12月16日～2024年 6月17日	403,069,289	2,740,137,738
第39特定期間	2024年 6月18日～2024年12月16日	247,696,397	1,493,900,488

(参考)

## 日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド

以下の運用状況は2024年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	54,818,319,000	95.23
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		2,744,492,230	4.77
合計（純資産総額）		57,562,811,230	100.00

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	33,373	116,117.55	3,875,190,996	122,400	4,084,855,200	7.10
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	29,386	101,691.07	2,988,293,783	107,900	3,170,749,400	5.51
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	29,668	90,132.82	2,674,060,503	90,200	2,676,053,600	4.65
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	18,315	140,405.61	2,571,528,747	137,700	2,521,975,500	4.38
日本	投資証券	KDX不動産投資法人 投資証券	16,007	152,429.31	2,439,935,965	149,500	2,393,046,500	4.16
日本	投資証券	GLP投資法人 投資証券	19,219	129,905.69	2,496,657,456	123,400	2,371,624,600	4.12
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	9,967	250,001.33	2,491,763,256	222,900	2,221,644,300	3.86
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	31,524	67,635.84	2,132,152,220	66,200	2,086,888,800	3.63
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	8,532	244,398.7	2,085,209,708	231,800	1,977,717,600	3.44
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	11,400	157,667.73	1,797,412,122	164,100	1,870,740,000	3.25
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	12,706	142,118.54	1,805,758,169	140,800	1,789,004,800	3.11
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,623	319,680.8	1,797,565,138	292,400	1,644,165,200	2.86
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	21,020	78,691.39	1,654,093,017	70,600	1,484,012,000	2.58
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	17,193	77,344.71	1,329,787,599	77,300	1,329,018,900	2.31
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	12,472	106,266.51	1,325,355,912	101,500	1,265,908,000	2.20
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	3,913	327,184.55	1,280,273,144	315,500	1,234,551,500	2.14
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	10,476	121,967.36	1,277,730,063	114,900	1,203,692,400	2.09

日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,976	639,026.48	1,262,716,324	587,000	1,159,912,000	2.02
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	7,325	146,731.23	1,074,806,259	142,100	1,040,882,500	1.81
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	3,844	264,992.39	1,018,630,747	263,200	1,011,740,800	1.76
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,781	365,507.44	1,016,476,190	328,500	913,558,500	1.59
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	7,018	131,618.34	923,697,510	126,700	889,180,600	1.54
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	6,728	129,805.43	873,330,933	123,900	833,599,200	1.45
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	10,614	88,798.29	942,505,050	77,700	824,707,800	1.43
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,897	314,022.35	909,722,747	277,900	805,076,300	1.40
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	8,450	102,655.4	867,438,130	89,100	752,895,000	1.31
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人 投資証券	5,816	115,734.83	673,113,771	119,600	695,593,600	1.21
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,056	143,460.72	725,337,400	137,300	694,188,800	1.21
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,975	375,038.36	740,700,761	346,500	684,337,500	1.19
日本	投資証券	森トラストリート投資法人 投資証券	11,029	68,545.7	755,990,525	61,600	679,386,400	1.18

#### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	95.23
合計	95.23

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2024年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	アメリカ	39,793,483,660	78.13
	カナダ	621,768,884	1.22
	ドイツ	15,940,422	0.03
	イタリア	5,627,862	0.01
	フランス	859,386,517	1.69
	オランダ	65,257,887	0.13
	スペイン	207,188,279	0.41
	ベルギー	423,458,140	0.83
	アイルランド	17,621,201	0.03
	イギリス	2,031,223,205	3.99
	オーストラリア	3,649,680,440	7.17

	ニュージーランド	41,856,045	0.08
	香港	437,027,652	0.86
	シンガポール	1,505,912,003	2.96
	韓国	81,315,519	0.16
	イスラエル	70,014,983	0.14
	ガーンジー	77,726,478	0.15
	小計	49,904,489,177	97.98
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,027,177,134	2.02
合計（純資産総額）		50,931,666,311	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		659,407,500	1.29

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	203,539	17,766.77	3,616,232,146	16,646.86	3,388,285,889	6.65
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	21,203	121,659.40	2,579,544,292	149,109.95	3,161,578,456	6.21
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	129,985	16,518.73	2,147,188,081	19,772.50	2,570,128,413	5.05
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	68,522	23,788.69	1,630,048,630	28,178.18	1,930,825,606	3.79
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	67,399	23,586.21	1,589,687,629	27,208.54	1,833,828,509	3.60
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	34,635	44,877.24	1,554,323,478	47,153.45	1,633,160,018	3.21
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	192,297	8,443.64	1,623,688,256	8,329.75	1,601,787,628	3.14
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	420,289	3,534.17	1,485,376,978	3,633.66	1,527,189,429	3.00
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	31,221	31,971.34	998,177,256	34,986.25	1,092,305,786	2.14
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	46,591	24,777.31	1,154,399,892	23,424.87	1,091,388,407	2.14
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	64,492	13,967.29	900,778,724	16,564.60	1,068,284,802	2.10
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	231,641	4,478.07	1,037,305,957	4,577.72	1,060,389,770	2.08
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	92,173	7,975.43	735,119,825	9,315.22	858,611,791	1.69
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	75,038	10,561.67	792,527,239	11,322.52	849,619,586	1.67
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	125,216	5,612.22	702,740,541	5,077.57	635,794,007	1.25
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	14,128	44,083.18	622,807,226	44,991.13	635,634,789	1.25
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	25,690	22,067.69	566,919,003	24,320.17	624,785,296	1.23
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	148,210	2,973.78	440,744,527	3,696.66	547,882,957	1.08
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	34,205	18,386.84	628,921,972	15,557.00	532,127,288	1.04
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	26,312	18,475.42	486,125,356	19,560.53	514,676,897	1.01
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	153,795	3,109.81	478,274,582	3,176.25	488,492,045	0.96
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	60,282	6,876.08	414,504,131	7,568.91	456,269,213	0.90
アメリカ	投資証券	UDR INC	66,019	6,377.81	421,057,140	6,866.59	453,325,656	0.89
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	41,971	9,938.44	417,126,660	10,534.78	442,155,587	0.87
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	153,705	2,818.76	433,258,674	2,843.28	437,027,197	0.86
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	23,458	17,108.74	401,337,029	18,227.08	427,570,875	0.84

アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	35,899	9,788.17	351,385,816	11,697.41	419,925,357	0.82
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	48,098	8,870.73	426,664,583	8,622.39	414,719,801	0.81
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	297,348	1,805.11	536,746,265	1,379.20	410,104,919	0.81
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	69,721	5,607.48	390,959,183	5,868.47	409,156,155	0.80

#### ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.98
合計	97.98

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	2,850,000.00	450,214,500	450,357,000	0.88
	加ドル	売建	170,000.00	18,643,050	18,647,742	0.04
	ユーロ	売建	240,000.00	39,532,800	39,554,160	0.08
	英ポンド	売建	250,000.00	49,666,525	49,700,800	0.10
	豪ドル	売建	640,000.00	62,956,800	62,975,616	0.12
	ニュージーランドドル	売建	30,000.00	2,672,400	2,672,622	0.01
	香港ドル	売建	600,000.00	12,204,600	12,214,080	0.02
	シンガポールドル	売建	200,000.00	23,272,000	23,285,480	0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

#### 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12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	48,907,584,240	87.50
地方債証券	日本	2,774,282,962	4.96
特殊債券	日本	1,984,917,760	3.55
社債券	日本	2,114,374,566	3.78
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		111,171,459	0.20
合計(純資産総額)		55,892,330,987	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344回利付国債(10年)	700,000,000	99.36	695,527,000	99.21	694,505,000	0.100	2026/9/20	1.24



日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	680,000,000	99.08	673,784,800	98.83	672,105,200	0.100	2027/6/20	1.20
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	660,000,000	99.26	655,162,200	99.09	654,007,200	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	99.37	640,955,850	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	99.55	627,177,600	0.100	2026/3/20	1.12
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	590,000,000	98.85	583,238,600	98.53	581,350,600	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	96.36	558,917,000	0.100	2030/9/20	1.00
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	560,000,000	97.55	546,302,400	96.94	542,869,600	0.100	2029/12/20	0.97
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	540,000,000	98.71	533,066,400	98.36	531,187,200	0.100	2028/3/20	0.95
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	500,000,000	98.97	494,860,000	98.69	493,475,000	0.100	2027/9/20	0.88
日本	国債証券	第372回利付国債(10年)	500,000,000	99.62	498,135,000	98.55	492,780,000	0.800	2033/9/20	0.88
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	500,000,000	96.46	482,335,000	95.61	478,085,000	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	95.36	476,815,000	0.100	2031/9/20	0.85
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	490,000,000	97.93	479,861,900	96.85	474,569,900	0.500	2032/12/20	0.85
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	480,000,000	96.57	463,540,800	95.54	458,625,600	0.400	2033/6/20	0.82
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	480,000,000	96.41	462,811,200	95.46	458,208,000	0.200	2032/3/20	0.82
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	460,000,000	99.18	456,246,400	98.97	455,298,800	0.100	2027/3/20	0.81
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	460,000,000	96.89	445,712,400	96.15	442,326,800	0.100	2030/12/20	0.79
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	435,000,000	98.56	428,775,150	98.17	427,065,600	0.100	2028/6/20	0.76
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	450,000,000	95.86	431,392,500	94.85	426,843,000	0.200	2032/9/20	0.76
日本	国債証券	第373回利付国債(10年)	440,000,000	97.58	429,391,600	96.59	425,009,200	0.600	2033/12/20	0.76
日本	国債証券	第375回利付国債(10年)	410,000,000	101.24	415,087,800	100.38	411,582,600	1.100	2034/6/20	0.74
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	420,000,000	98.39	413,267,400	97.97	411,495,000	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	96.61	405,774,600	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	96.57	405,594,000	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	98.02	401,902,500	0.800	2034/3/20	0.72
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	420,000,000	96.12	403,741,800	95.14	399,604,800	0.200	2032/6/20	0.71
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	400,000,000	98.23	392,948,000	97.76	391,068,000	0.100	2028/12/20	0.70
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	410,000,000	95.95	393,399,100	95.07	389,807,500	0.100	2031/12/20	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	95.89	383,572,000	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	87.50
地方債証券	4.96

特殊債券	3.55
社債券	3.78
合 計	99.80

## 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12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	77,579,594,228	46.47
	カナダ	3,149,925,824	1.89
	メキシコ	1,244,395,527	0.75
	ドイツ	9,587,224,262	5.74
	イタリア	11,379,303,483	6.82
	フランス	12,025,118,444	7.20
	オランダ	2,171,388,184	1.30
	スペイン	7,196,197,649	4.31
	ベルギー	2,565,368,482	1.54
	オーストリア	1,810,845,800	1.08
	フィンランド	812,238,992	0.49
	アイルランド	774,916,220	0.46
	ポルトガル	973,917,974	0.58
	イギリス	8,471,540,985	5.07
	スウェーデン	274,883,180	0.16
	ノルウェー	251,982,765	0.15
	デンマーク	372,708,731	0.22
	ポーランド	885,962,394	0.53
	オーストラリア	1,999,515,193	1.20
	ニュージーランド	454,801,251	0.27
シンガポール	650,961,537	0.39	
マレーシア	848,538,360	0.51	
中国	18,973,401,735	11.36	
イスラエル	553,156,669	0.33	
	小計	165,007,887,869	98.84
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		1,938,722,223	1.16
合計（純資産総額）		166,946,610,092	100.00

## その他の資産の投資状況

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

為替予約取引	買建		332,546,458	0.20
	売建		79,682,312	0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,450,000	16,044.13	1,355,729,334	15,921.48	1,345,365,175	4.625	2027/6/15	0.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,750,000	15,693.79	1,059,331,302	15,673.09	1,057,933,663	3.625	2026/5/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,940,000	14,181.20	984,175,337	13,984.40	970,517,990	1.750	2029/11/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	15,766.40	963,327,143	15,377.73	939,579,768	4.125	2032/11/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,950,000	15,847.02	942,898,049	15,666.92	932,181,876	4.125	2028/7/31	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,540,000	16,147.01	894,544,598	15,694.41	869,470,534	4.500	2033/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,020,000	13,555.28	816,028,009	13,296.68	800,460,731	1.625	2031/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	15,931.36	796,568,381	15,702.75	785,137,503	4.250	2029/2/28	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	15,502.25	775,112,845	15,414.51	770,725,723	3.250	2027/6/30	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,910,000	13,118.42	775,298,683	12,898.45	762,298,745	0.875	2030/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,900,000	15,733.95	770,963,989	15,443.85	756,748,985	4.000	2030/7/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,980,000	15,262.50	760,072,673	15,049.95	749,487,859	3.250	2029/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	15,991.00	769,167,170	15,525.11	746,757,979	4.375	2034/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	15,983.58	751,228,393	15,871.43	745,957,361	4.500	2027/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,750,000	15,844.80	752,628,367	15,590.61	740,554,272	4.125	2029/10/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	15,224.82	736,881,530	15,256.33	738,406,588	1.625	2026/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	14,322.07	730,425,872	13,982.54	713,109,670	2.750	2032/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,480,000	13,146.33	720,419,421	12,881.46	705,904,413	1.375	2031/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	14,716.90	707,883,324	14,536.48	699,205,117	2.375	2029/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,930,000	14,295.81	704,783,829	14,163.59	698,265,252	1.500	2028/11/30	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,490,000	15,397.82	691,362,409	15,423.78	692,527,893	2.250	2026/3/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	14,492.92	695,660,454	14,160.49	679,703,762	2.875	2032/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,590,000	14,921.73	684,907,696	14,746.26	676,853,666	2.625	2029/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,630,000	14,737.29	682,336,916	14,556.56	673,968,818	2.375	2029/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,090,000	12,996.08	661,500,707	12,804.54	651,751,313	0.625	2030/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	15,917.47	636,699,177	15,904.06	636,162,630	4.875	2025/11/30	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,450,000	14,312.80	636,919,893	14,290.25	635,916,130	0.375	2027/7/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	15,158.08	636,639,732	15,004.54	630,190,828	2.875	2028/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,670,000	13,548.11	632,697,064	13,259.92	619,238,678	1.875	2032/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,790,000	13,119.67	628,432,224	12,865.09	616,238,087	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	98.84
合計	98.84

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	1,600,000.00	252,720,000	252,864,000	0.15
	ユーロ	買建	399,000.00	65,823,612	65,764,337	0.04
	英ポンド	買建	70,000.00	13,929,286	13,918,121	0.01
	米ドル	売建	504,190.79	79,752,898	79,682,312	0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 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12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	63,775,191,630	99.45
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		350,907,846	0.55
合計(純資産総額)		64,126,099,476	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	334,380,000	0.52

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

### 投資資産

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	851,400	2,705.76	2,303,684,064	3,146.00	2,678,504,400	4.18
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	560,900	2,702.56	1,515,865,904	3,369.00	1,889,672,100	2.95
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,012,000	1,568.67	1,587,494,040	1,846.00	1,868,152,000	2.91
日本	株式	日立製作所	電気機器	416,600	4,027.31	1,677,777,346	3,937.00	1,640,154,200	2.56
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	128,500	9,248.48	1,188,429,680	11,145.00	1,432,132,500	2.23
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	329,100	3,166.85	1,042,210,335	3,764.00	1,238,732,400	1.93
日本	株式	キーエンス	電気機器	16,000	66,368.25	1,061,892,000	64,630.00	1,034,080,000	1.61
日本	株式	任天堂	その他製品	101,100	8,165.90	825,572,490	9,264.00	936,590,400	1.46
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	113,900	7,539.96	858,801,444	7,832.00	892,064,800	1.39
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	154,000	5,523.22	850,575,880	5,728.00	882,112,000	1.38
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	212,900	3,123.66	665,027,214	3,873.00	824,561,700	1.29
日本	株式	三井物産	卸売業	249,000	3,152.97	785,089,530	3,311.00	824,439,000	1.29
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	33,900	23,852.36	808,595,205	24,185.00	819,871,500	1.28
日本	株式	三菱商事	卸売業	313,200	2,803.50	878,056,200	2,604.00	815,572,800	1.27
日本	株式	信越化学工業	化学	143,900	5,593.13	804,851,407	5,296.00	762,094,400	1.19
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4,778,200	146.89	701,869,798	158.00	754,955,600	1.18

日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	79,200	9,009.72	713,569,824	9,185.00	727,452,000	1.13
日本	株式	第一三共	医薬品	151,600	4,893.52	741,857,632	4,352.00	659,763,200	1.03
日本	株式	三菱重工業	機械	282,900	2,083.86	589,523,994	2,223.00	628,886,700	0.98
日本	株式	HOYA	精密機器	31,300	20,102.09	629,195,572	19,815.00	620,209,500	0.97
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	142,900	4,133.56	590,685,724	4,181.00	597,464,900	0.93
日本	株式	KDDI	情報・通信業	118,200	4,766.39	563,387,298	5,042.00	595,964,400	0.93
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	379,500	1,578.58	599,071,110	1,535.00	582,532,500	0.91
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	53,820.00	511,290,000	0.80
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,570,500	188.28	483,973,740	198.90	511,272,450	0.80
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	187,200	2,278.92	426,613,824	2,487.00	465,566,400	0.73
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	50,500	8,218.74	415,046,370	9,198.00	464,499,000	0.72
日本	株式	三菱電機	電気機器	164,600	2,344.53	385,909,638	2,687.00	442,280,200	0.69
日本	株式	富士通	電気機器	148,900	2,968.32	441,982,848	2,799.50	416,845,550	0.65
日本	株式	キヤノン	電気機器	79,900	5,044.86	403,084,314	5,161.00	412,363,900	0.64

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.25
		建設業	2.13
		食料品	3.04
		繊維製品	0.41
		パルプ・紙	0.14
		化学	5.11
		医薬品	4.31
		石油・石炭製品	0.54
		ゴム製品	0.57
		ガラス・土石製品	0.65
		鉄鋼	0.81
		非鉄金属	0.83
		金属製品	0.49
		機械	5.51
		電気機器	17.50
		輸送用機器	7.84
		精密機器	2.39
		その他製品	2.64
		電気・ガス業	1.24
		陸運業	2.23
		海運業	0.68
		空運業	0.34
倉庫・運輸関連業	0.14		
情報・通信業	7.50		
卸売業	6.77		



	小売業	4.57
	銀行業	8.50
	証券、商品先物取引業	0.88
	保険業	3.27
	その他金融業	1.19
	不動産業	1.78
	サービス業	5.11
合 計		99.45

## 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 2025年03月	買建	12	日本円	332,944,600	334,380,000	0.52

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

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

以下の運用状況は2024年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	346,100,770,420	73.43
	カナダ	14,815,847,027	3.14
	ドイツ	10,423,719,589	2.21
	イタリア	2,458,275,662	0.52
	フランス	11,342,490,760	2.41
	オランダ	7,413,589,823	1.57
	スペイン	2,936,093,784	0.62
	ベルギー	845,767,066	0.18
	オーストリア	214,720,160	0.05
	ルクセンブルク	667,310,599	0.14
	フィンランド	1,076,936,744	0.23
	アイルランド	8,728,383,002	1.85
	ポルトガル	148,953,206	0.03
	イギリス	16,000,896,140	3.40
	スイス	11,938,553,000	2.53
	スウェーデン	3,516,543,763	0.75
	ノルウェー	646,032,525	0.14
	デンマーク	3,316,404,122	0.70
	ケイマン	657,678,236	0.14
オーストラリア	7,646,939,229	1.62	

	パミューダ	415,122,799	0.09
	ニュージーランド	338,197,706	0.07
	香港	1,828,651,690	0.39
	シンガポール	1,410,732,044	0.30
	イスラエル	1,051,028,958	0.22
	ジャージー	635,256,033	0.13
	アラブ首長国連邦	0	0.00
	マン島	33,495,504	0.01
	小計	456,608,389,591	96.88
新株予約権証券	カナダ	0	0.00
投資証券	アメリカ	7,290,528,648	1.55
	カナダ	13,016,526	0.00
	フランス	142,680,145	0.03
	ベルギー	24,272,794	0.01
	イギリス	121,498,002	0.03
	オーストラリア	500,661,751	0.11
	香港	69,839,488	0.01
	シンガポール	91,412,470	0.02
	小計	8,253,909,824	1.75
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		6,445,217,552	1.37
合計（純資産総額）		471,307,516,967	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,528,416,585	0.96
	買建	ドイツ	675,578,288	0.14

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		4,456,065,860	0.95

(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	667,364	36,624.11	24,441,616,822	40,429.22	26,981,010,114	5.72
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,076,510	22,387.86	24,100,756,159	21,672.24	23,330,385,020	4.95
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	310,054	67,724.11	20,998,133,948	68,101.23	21,115,060,441	4.48
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	414,810	29,757.38	12,343,662,480	35,392.77	14,681,276,998	3.12

アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	95,990	90,719.98	8,708,211,323	94,877.94	9,107,334,017	1.93
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	126,275	42,721.61	5,394,672,210	68,279.97	8,622,054,323	1.83
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	257,380	26,149.57	6,730,378,700	30,490.77	7,847,716,133	1.67
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	194,960	27,354.80	5,333,092,827	38,240.01	7,455,273,324	1.58
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	221,030	26,418.97	5,839,385,234	30,693.24	6,784,128,429	1.44
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	124,950	35,164.99	4,393,866,225	38,148.27	4,766,626,411	1.01
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	35,499	141,080.01	5,008,199,589	123,881.83	4,397,681,104	0.93
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	57,975	71,833.42	4,164,542,676	72,210.75	4,186,418,336	0.89
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	73,362	44,896.92	3,293,728,097	50,405.63	3,697,858,474	0.78
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	195,039	18,900.92	3,686,418,135	16,843.00	3,285,043,125	0.70
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	40,590	89,390.90	3,628,376,998	80,670.21	3,274,404,157	0.69
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	36,260	80,271.46	2,910,643,324	84,183.39	3,052,489,939	0.65
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	19,484	141,135.65	2,749,887,126	148,641.74	2,896,135,779	0.61
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	194,396	13,071.57	2,541,062,423	14,498.77	2,818,504,604	0.60
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	102,649	26,609.03	2,731,391,306	26,816.25	2,752,661,801	0.58
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	18,870	119,511.31	2,255,178,503	143,556.25	2,708,906,607	0.57
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	43,555	63,149.35	2,750,470,344	62,142.59	2,706,620,716	0.57
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	105,361	25,436.11	2,679,974,101	22,944.00	2,417,403,732	0.51
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	42,146	45,944.96	1,936,396,402	53,536.02	2,256,329,141	0.48
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	77,706	29,702.88	2,308,091,999	28,157.62	2,188,016,160	0.46
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	306,329	6,626.16	2,029,785,028	7,013.70	2,148,500,075	0.46
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	141,660	17,340.37	2,456,437,989	14,059.74	1,991,704,043	0.42
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	17,537	109,545.47	1,921,099,037	112,953.70	1,980,869,177	0.42
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	73,153	27,471.52	2,009,624,317	26,726.09	1,955,093,867	0.41
ドイツ	株式	SAP SE	ソフトウェア・サービス	45,962	36,481.20	1,676,749,175	39,498.33	1,815,422,703	0.39

アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	179,172	10,581.83	1,895,968,774	9,878.34	1,769,922,114	0.38
------	----	------------------	-----------	---------	-----------	---------------	----------	---------------	------

### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	3.77
		素材	3.10
		資本財	6.80
		商業・専門サービス	1.50
		運輸	1.43
		自動車・自動車部品	2.37
		耐久消費財・アパレル	1.17
		消費者サービス	1.96
		メディア・娯楽	6.97
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.18
		生活必需品流通・小売り	1.83
		食品・飲料・タバコ	2.72
		家庭用品・パーソナル用品	1.44
		ヘルスケア機器・サービス	3.70
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.62
		銀行	5.60
		金融サービス	7.17
		保険	2.95
		ソフトウェア・サービス	10.16
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.27
電気通信サービス	1.10		
公益事業	2.49		
半導体・半導体製造装置	9.29		
不動産管理・開発	0.27		
新株予約権証券			
投資証券			1.75
合計			98.63

### 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 EMINI2503	買建	95	米ドル	29,027,555	4,591,578,650	28,628,250	4,528,416,585	0.96
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2503	買建	95	ユーロ	4,151,810	684,716,505	4,096,400	675,578,288	0.14

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	24,800,000.00	3,758,487,360	3,897,591,850	0.83
	ユーロ	買建	3,400,000.00	547,449,310	558,474,010	0.12

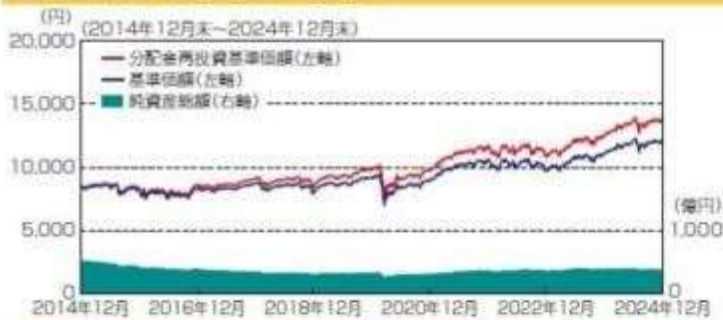
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

#### 参考情報

## 運用実績

2024年12月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 12,115円

純資産総額…………… 383.99億円

※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12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)

2024年8月	2024年9月	2024年10月	2024年11月	2024年12月	直近1年間累計	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	120円	5,540円

## 主要な資産の状況

組入資産	投資対象	比率*1	組入上位の銘柄名	国名	比率*2
日本リートインデックス J-REITマザーファンド	日本リート	15.6%	日本ビルファンド投資法人 投資証券	日本	7.1%
			ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	日本	5.5%
			日本都市ファンド投資法人 投資証券	日本	4.6%
			野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	日本	4.4%
			KOX不動産投資法人 投資証券	日本	4.2%
海外リートインデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外リート	16.5%	PROLOGIS INC	アメリカ	6.7%
			EQUINIX INC	アメリカ	6.2%
			WELLTOWER INC	アメリカ	5.0%
			DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.8%
			SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.6%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	15.8%	第344回利付国債(10年)	日本	1.2%
			第347回利付国債(10年)	日本	1.2%
			第345回利付国債(10年)	日本	1.2%
			第343回利付国債(10年)	日本	1.2%
			第342回利付国債(10年)	日本	1.1%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外債券	16.7%	US TREASURY N/B(4.625%)	アメリカ	0.8%
			US TREASURY N/B(3.625%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(1.75%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(4.125%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(4.125%)	アメリカ	0.6%
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	16.9%	トヨタ自動車	日本	4.2%
			ソニーグループ	日本	2.9%
			三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	2.9%
			日立製作所	日本	2.6%
			リクルートホールディングス	日本	2.2%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	海外株式	17.3%	APPLE INC	アメリカ	5.7%
			NVIDIA CORP	アメリカ	5.0%
			MICROSOFT CORP	アメリカ	4.5%
			AMAZON.COM INC	アメリカ	3.1%
			META PLATFORMS INC-CLASS A	アメリカ	1.9%
現金その他		1.2%			

\*1:当ファンドの対純資産総額比です。また、合計の比率が四捨五入の関係で100%にならない場合があります。

\*2: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。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

## (1) 申込方法



販売会社所定の方法でお申し込みください。

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

## 2【換金（解約）手続等】

### <解約請求による換金>

- (1) 解約の受付  
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間  
原則として、午後3時30分までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (3) 解約請求不可日  
販売会社の営業日であっても、解約請求日が下記のいずれかに該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。  
ニューヨーク証券取引所の休業日  
ニューヨークの銀行休業日
- (4) 解約制限  
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (5) 解約価額  
解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た額）を控除した価額とします。  
・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

## &lt; 委託会社の照会先 &gt;

日興アセットマネジメント株式会社

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。

## (6) 手取額

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

## (7) 解約単位

1 口単位

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

## (8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

## (9) 受付の中止および取消

- 委託会社は、投資対象とする投資信託証券（マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。）からの換金ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
- 解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けられない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

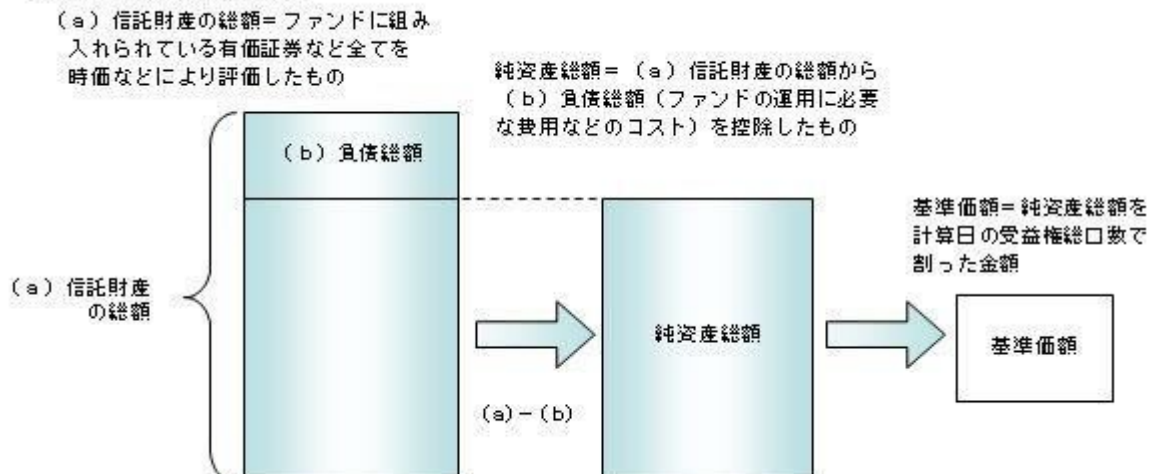
## 3【資産管理等の概要】

## (1)【資産の評価】

## 基準価額の算出

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

## &lt; 基準価額算出の流れ &gt;



## 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。

## &lt; 主な資産の評価方法 &gt;

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<sup>\*</sup>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。
- 国内上場不動産投信  
原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。
- 海外上場不動産投信  
原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。
- ・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/](http://www.nikkoam.com/)

2025年9月1日より[www.amova-am.com](http://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（2005年9月29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】

毎月16日から翌月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
  - イ) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回るようになった場合
  - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
  - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、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

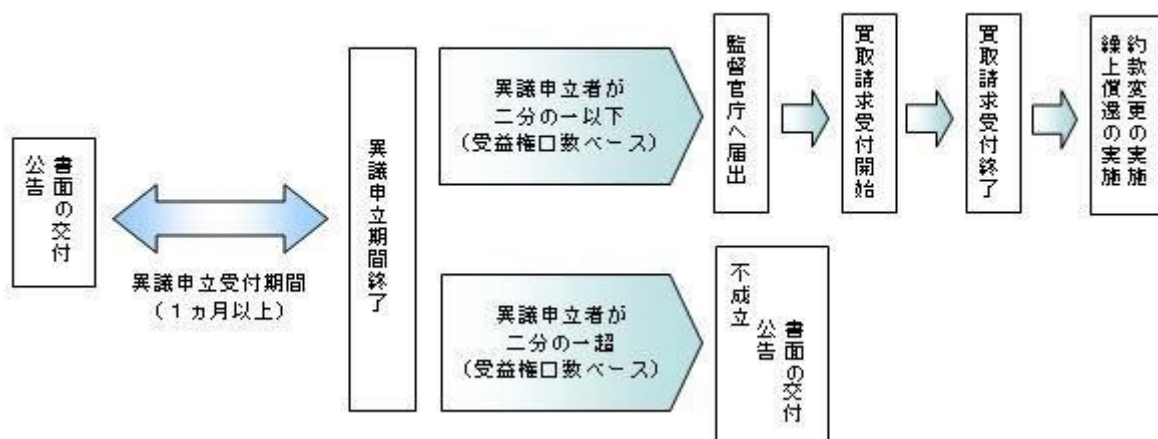
  - ・ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日まで）から受益者に支払います。
  - ・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

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、年2回(6月、12月)および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の交付請求があった場合には、交付します。

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

2025年9月1日より[www.amova-am.com](http://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) 当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2024年6月18日から2024年12月16日までの特定期間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】

## 【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）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2024年 6月17日現在	当期 2024年12月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	782,559,668	507,326,171
親投資信託受益証券	38,509,622,380	37,869,346,354
未収入金	23,153,468	45,543,199
未収利息	1,766	3,260
流動資産合計	39,315,337,282	38,422,218,984
資産合計	39,315,337,282	38,422,218,984
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	33,134,354	31,888,150
未払解約金	25,582,685	47,773,453
未払受託者報酬	1,952,701	1,794,547
未払委託者報酬	35,148,838	32,302,054
その他未払費用	6,702,617	3,347,118
流動負債合計	102,521,195	117,105,322
負債合計	102,521,195	117,105,322
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	33,134,354,286	31,888,150,195
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,078,461,801	6,416,963,467
（分配準備積立金）	9,573,348,931	10,448,865,925
元本等合計	39,212,816,087	38,305,113,662
純資産合計	39,212,816,087	38,305,113,662
負債純資産合計	39,315,337,282	38,422,218,984



## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期		当期	
	自	2023年12月16日	自	2024年 6月18日
	至	2024年 6月17日	至	2024年12月16日
<b>営業収益</b>				
受取利息		140,432		613,982
有価証券売買等損益		3,311,373,599		974,786,202
営業収益合計		3,311,514,031		975,400,184
<b>営業費用</b>				
支払利息		9,362		-
受託者報酬		10,895,596		10,601,610
委託者報酬		196,121,741		190,830,043
その他費用		3,889,256		4,051,638
営業費用合計		210,915,955		205,483,291
営業利益又は営業損失（ ）		3,100,598,076		769,916,893
経常利益又は経常損失（ ）		3,100,598,076		769,916,893
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,100,598,076		769,916,893
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（ ）		15,648,123		2,952,506
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,503,097,538		6,078,461,801
剰余金増加額又は欠損金減少額		56,805,420		47,637,701
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		56,805,420		47,637,701
剰余金減少額又は欠損金増加額		362,968,238		287,239,479
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		362,968,238		287,239,479
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		203,422,872		194,765,955
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,078,461,801		6,416,963,467

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎月16日から翌月15日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものいたしますので、当特定期間は2024年6月18日から2024年12月16日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	前期 2024年6月17日現在	当期 2024年12月16日現在
1. 期首元本額	35,471,422,735円	33,134,354,286円
期中追加設定元本額	403,069,289円	247,696,397円
期中一部解約元本額	2,740,137,738円	1,493,900,488円
2. 受益権の総数	33,134,354,286口	31,888,150,195口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2023年12月16日 至 2024年6月17日		当期 自 2024年6月18日 至 2024年12月16日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
自 2023年12月16日 至 2024年1月15日		自 2024年6月18日 至 2024年7月16日	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	86,195,842円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	89,773,271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	888,629,111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	1,165,485,723円
C 信託約款に定める収益調整金	2,757,803,840円	C 信託約款に定める収益調整金	2,699,867,213円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	7,166,538,292円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	9,495,415,870円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	10,899,167,085円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)	13,450,542,077円
F 分配対象収益(1万口当たり)	3,124円	F 分配対象収益(1万口当たり)	4,084円
G 分配金額	34,885,091円	G 分配金額	32,929,302円
H 分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	10円
自 2024年1月16日 至 2024年2月15日		自 2024年7月17日 至 2024年8月15日	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	47,324,379円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	24,079,515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	142,168,213円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整金	2,737,051,246円	C 信託約款に定める収益調整金	2,702,222,998円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	7,956,563,875円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	10,637,279,331円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	10,883,107,713円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)	13,363,581,844円
F 分配対象収益(1万口当たり)	3,169円	F 分配対象収益(1万口当たり)	4,082円
G 分配金額	34,332,377円	G 分配金額	32,736,129円
H 分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	10円
自 2024年2月16日 至 2024年3月15日		自 2024年8月16日 至 2024年9月17日	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	92,765,380円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	66,742,508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	279,468,818円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整金	2,717,861,715円	C 信託約款に定める収益調整金	2,701,720,608円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	8,007,674,400円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	10,574,474,360円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	11,097,770,313円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)	13,342,937,476円
F 分配対象収益(1万口当たり)	3,269円	F 分配対象収益(1万口当たり)	4,092円
G 分配金額	33,939,265円	G 分配金額	32,600,932円
H 分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	10円
自 2024年3月16日 至 2024年4月15日		自 2024年9月18日 至 2024年10月15日	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	122,441,811円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	109,493,066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	566,592,473円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整金	2,712,436,152円	C 信託約款に定める収益調整金	2,696,551,205円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	8,273,528,134円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	10,547,882,169円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	11,674,998,570円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)	13,353,926,440円
F 分配対象収益(1万口当たり)	3,464円	F 分配対象収益(1万口当たり)	4,116円
G 分配金額	33,698,280円	G 分配金額	32,438,427円

H 分配金額(1万口当たり) 自 2024年 4月16日 至 2024年 5月15日	10円	H 分配金額(1万口当たり) 自 2024年10月16日 至 2024年11月15日	10円
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	65,076,549円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	52,646,981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	795,483,499円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整金	2,704,301,280円	C 信託約款に定める収益調整金	2,686,202,631円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	8,846,271,268円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	10,527,003,179円
E 分配対象収益 ( A+B+C+D )	12,411,132,596円	E 分配対象収益 ( A+B+C+D )	13,265,852,791円
F 分配対象収益(1万口当たり)	3,712円	F 分配対象収益(1万口当たり)	4,123円
G 分配金額	33,433,505円	G 分配金額	32,173,015円
H 分配金額(1万口当たり) 自 2024年 5月16日 至 2024年 6月17日	10円	H 分配金額(1万口当たり) 自 2024年11月16日 至 2024年12月16日	10円
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	35,887,036円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	35,774,908円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整金	2,697,214,132円	C 信託約款に定める収益調整金	2,672,286,722円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	9,570,596,249円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	10,444,979,167円
E 分配対象収益 ( A+B+C+D )	12,303,697,417円	E 分配対象収益 ( A+B+C+D )	13,153,040,797円
F 分配対象収益(1万口当たり)	3,713円	F 分配対象収益(1万口当たり)	4,124円
G 分配金額	33,134,354円	G 分配金額	31,888,150円
H 分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	10円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	前期 自 2023年12月16日 至 2024年 6月17日	当期 自 2024年 6月18日 至 2024年12月16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

	前期 2024年 6月17日現在	当期 2024年12月16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)

前期 (2024年 6月17日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	最終の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	38,321,440
合計	38,321,440

当期(2024年12月16日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	最終の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	258,910,371
合計	258,910,371

(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)

前期 2024年6月17日現在		当期 2024年12月16日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1834円 (11,834円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2012円 (12,012円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSA I (ヘッジなし)マザーファンド	933,682,758	6,730,825,634	
	日本債券インデックスマザーファンド	4,627,294,198	6,057,590,834	
	海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	2,102,014,908	6,383,398,872	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	2,235,224,002	6,414,422,318	
	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	2,484,553,146	5,859,321,684	
	海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド	1,729,055,505	6,423,787,012	
合計		14,111,824,517	37,869,346,354	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

当ファンドは、「日本リートインデックスJ-REITマザーファンド」「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」「日本債券インデックスマザーファンド」「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」「海外株式インデックスMSCI-KOKUSA I(ヘッジなし)マザーファンド」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)

日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

	2024年 6月17日現在	2024年12月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	214,999,838	196,203,727
投資証券	59,683,122,100	56,233,006,650
未収配当金	335,386,878	375,853,875
未収利息	485	1,260
流動資産合計	60,233,509,301	56,805,065,512
資産合計	60,233,509,301	56,805,065,512
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	179,233,450	-
未払解約金	1,431,980	-
流動負債合計	180,665,430	-
負債合計	180,665,430	-
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	24,754,972,956	24,087,011,789
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	35,297,870,915	32,718,053,723
元本等合計	60,052,843,871	56,805,065,512
純資産合計	60,052,843,871	56,805,065,512
負債純資産合計	60,233,509,301	56,805,065,512

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等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>
-----------------	---

## （貸借対照表に関する注記）

	2024年 6月17日現在	2024年12月16日現在
1. 期首	2023年12月16日	2024年 6月18日
期首元本額	24,331,712,371円	24,754,972,956円
期首からの追加設定元本額	1,191,646,126円	345,003,623円
期首からの一部解約元本額	768,385,541円	1,012,964,790円
元本の内訳		
世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,486,965,212円	2,484,553,146円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	1,696,418,639円	1,684,525,460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）	159,795,689円	161,332,604円
グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	19,637,886,849円	18,898,493,635円
財産3分法（適格機関投資家専用）	722,843,641円	765,658,353円
Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	1,885,915円	3,008,247円
Ni つみインデック斯拉ップ世界10指数（均等型）	1,160,932円	1,743,729円
Ni つみインデック斯拉ップ世界10指数（安定成長型）	523,009円	745,772円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）奇数月分配型	47,493,070円	86,950,843円

	計	24,754,972,956円	24,087,011,789円
2.	受益権の総数	24,754,972,956口	24,087,011,789口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

	自 2023年12月16日 至 2024年 6月17日	自 2024年 6月18日 至 2024年12月16日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。当該有価証券の性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2024年 6月17日現在	2024年12月16日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2024年 6月17日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	4,844,672,098
合計	4,844,672,098

（2024年12月16日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	3,001,271,414
合計	3,001,271,414

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2024年 6月17日現在		2024年12月16日現在	
1口当たり純資産額	2.4259円	1口当たり純資産額	2.3583円
(1万口当たり純資産額)	(24,259円)	(1万口当たり純資産額)	(23,583円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式



該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	1,318	144,452,800	
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,908	140,047,200	
	S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	2,971	306,904,300	
	東海道リート投資法人 投資証券	1,017	105,259,500	
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	2,056	1,176,032,000	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	7,003	858,567,800	
	産業ファンド投資法人 投資証券	10,904	1,216,886,400	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,853	1,683,908,100	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,895	916,267,500	
	G L P 投資法人 投資証券	20,005	2,448,612,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	3,016	829,098,400	
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	10,375	2,312,587,500	
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	2,519	573,324,400	
	O n e リート投資法人 投資証券	1,039	232,839,900	
	イオンリート投資法人 投資証券	7,305	906,550,500	
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,263	684,716,300	
	日本リート投資法人 投資証券	1,934	591,804,000	
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	17,896	1,308,197,600	
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	1,295	157,083,500	
	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	1,468	152,378,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,623	144,771,600	
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	19,064	2,602,236,000	
	いちごホテルリート投資法人 投資証券	986	147,604,200	
	ラサールロジポート投資法人 投資証券	7,625	1,053,775,000	
	スターアジア不動産投資法人 投資証券	10,975	549,847,500	
	マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	1,081	115,234,600	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	12,982	1,281,323,400	
	日本ホテル&レジデンシャル投資法人 投資証券	1,256	80,384,000	
	投資法人みらい 投資証券	8,201	318,608,850	
	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	2,056	696,984,000	
	C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,564	354,088,400	
	ザイマックス・リート投資法人 投資証券	1,020	112,200,000	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	3,889	325,120,400		
日本ビルファンド投資法人 投資証券	34,738	4,304,038,200		
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	6,118	3,334,310,000		
日本都市ファンド投資法人 投資証券	30,882	2,680,557,600		
オリックス不動産投資法人 投資証券	11,867	1,937,881,100		
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	4,073	1,307,433,000		

N T T 都市開発リート投資法人 投資証券	6,053	673,698,900	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	3,993	622,109,400	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	4,313	409,735,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	13,322	1,803,798,800	
森トラストリート投資法人 投資証券	11,480	684,208,000	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	32,813	2,168,939,300	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,210	857,480,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	4,367	505,698,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	4,002	1,042,120,800	
福岡リート投資法人 投資証券	3,360	472,752,000	
K D X 不動産投資法人 投資証券	16,662	2,402,660,400	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	4,345	334,130,500	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	2,468	715,473,200	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	2,840	335,688,000	
スターツプロシード投資法人 投資証券	1,032	168,732,000	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	8,932	2,024,884,400	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	21,879	1,557,784,800	
大和証券リビング投資法人 投資証券	8,796	770,529,600	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	5,114	590,667,000	
合計	427,021	56,233,006,650	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

	2024年 6月17日現在	2024年12月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	342,192,595	279,693,714
コール・ローン	21,161,575	28,440,329
投資証券	55,931,087,801	51,424,761,328
未収入金	1,339,882	33,117,475
未収配当金	146,414,243	111,029,988
未収利息	47	182
流動資産合計	56,442,196,143	51,877,043,016
資産合計	56,442,196,143	51,877,043,016
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	6,033,914	6,831,424
流動負債合計	6,033,914	6,831,424
負債合計	6,033,914	6,831,424
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	16,493,547,462	13,961,582,179
剰余金		

	2024年 6月17日現在	2024年12月16日現在
剰余金又は欠損金( )	39,942,614,767	37,908,629,413
元本等合計	56,436,162,229	51,870,211,592
純資産合計	56,436,162,229	51,870,211,592
負債純資産合計	56,442,196,143	51,877,043,016

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

		2024年 6月17日現在	2024年12月16日現在
1.	期首	2023年12月16日	2024年 6月18日
	期首元本額	18,594,523,388円	16,493,547,462円
	期首からの追加設定元本額	13,921,194円	147,899,800円
	期首からの一部解約元本額	2,114,897,120円	2,679,865,083円
	元本の内訳		
	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	1,941,127,001円	1,729,055,505円
	グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	14,316,410,946円	11,997,819,533円
	Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	20,686,523円	33,241,456円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数(均等型)	841,098円	1,116,962円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数(安定成長型)	749,943円	958,821円
	海外先進国REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)	213,731,951円	199,389,902円
	計	16,493,547,462円	13,961,582,179円
2.	受益権の総数	16,493,547,462口	13,961,582,179口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

	自 2023年12月16日 至 2024年 6月17日	自 2024年 6月18日 至 2024年12月16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、為替予約取引があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができません。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

	2024年 6月17日現在	2024年12月16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)

(2024年 6月17日現在)

## 売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1,597,469,886
合計	1,597,469,886

(2024年12月16日現在)

## 売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	4,319,878,755
合計	4,319,878,755

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2024年 6月17日現在		2024年12月16日現在	
1口当たり純資産額	3.4217円	1口当たり純資産額	3.7152円
(1万口当たり純資産額)	(34,217円)	(1万口当たり純資産額)	(37,152円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	23,834	604,191.90	
		AGREE REALTY CORPORATION	22,668	1,692,392.88	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	16,331	308,002.66	
		ALEXANDER'S INC	459	97,661.43	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	35,136	3,607,061.76	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	3,159	54,018.90	

AMERICAN ASSETS TRUST INC	10,750	299,065.00	
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	33,689	959,125.83	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	71,057	2,655,400.09	
AMERICOLD REALTY TRUST INC	58,972	1,344,561.60	
APARTMENT INVT&MGMT CO -A	29,230	251,962.60	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	50,803	815,388.15	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	14,789	161,495.88	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	32,079	7,263,327.18	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	12,905	43,877.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	39,715	227,169.80	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	68,063	1,965,659.44	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	42,247	713,974.30	
BRT APARTMENTS CORP	2,648	49,676.48	
BXP INC	32,789	2,620,824.77	
CAMDEN PROPERTY TRUST	24,079	2,893,573.43	
CARETRUST REIT INC	37,975	1,094,059.75	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,369	105,921.36	
CENTERSPACE	3,502	243,213.90	
CHATHAM LODGING TRUST	10,816	104,590.72	
CITY OFFICE REIT INC	9,099	53,229.15	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	6,024	108,974.16	
COPT DEFENSE PROPERTIES	25,514	829,205.00	
COUSINS PROPERTIES INC	34,370	1,053,096.80	
CTO REALTY GROWTH INC	4,333	87,266.62	
CUBESMART	50,842	2,352,459.34	
CURBLINE PROPERTIES CORP	21,142	501,065.40	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	46,688	450,539.20	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	198,724	116,253.54	
DIGITAL REALTY TRUST INC	69,497	12,859,724.88	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	47,365	115,570.60	
DOUGLAS EMMETT INC	37,433	747,537.01	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	68,595.90	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	22,378	262,717.72	
EASTGROUP PROPERTIES INC	10,990	1,882,037.50	
ELME COMMUNITIES	19,727	322,339.18	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	30,061	337,585.03	
EPR PROPERTIES	17,193	775,748.16	
EQUINIX INC	21,440	20,689,600.00	
EQUITY COMMONWEALTH	24,317	41,095.73	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	42,118	2,860,654.56	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	77,054	5,646,517.12	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	39,588	1,302,445.20	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	14,500	4,346,955.00	

EXTRA SPACE STORAGE INC	47,853	7,570,344.60	
FARMLAND PARTNERS INC	9,308	117,653.12	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	16,991	1,941,221.75	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	29,891	1,578,244.80	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	21,013	603,703.49	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	15,733	31,623.33	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	61,991	3,105,129.19	
GETTY REALTY CORPORATION	11,201	359,104.06	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	9,586	161,524.10	
GLADSTONE LAND CORP	6,985	78,301.85	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	14,729	124,607.34	
GLOBAL NET LEASE INC	44,195	319,087.90	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	81,807	1,408,716.54	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	158,858	3,297,892.08	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	24,026	746,487.82	
HOST HOTELS & RESORTS INC	158,660	2,947,902.80	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	31,261	102,848.69	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	50,733	1,085,686.20	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	15,324	57,311.76	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	6,434	673,768.48	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	17,023	526,861.85	
INVITATION HOMES INC	128,654	4,254,587.78	
IRON MOUNTAIN INC	66,235	7,411,696.50	
JBG SMITH PROPERTIES	19,351	315,614.81	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	219,100	48,202.00	
KILROY REALTY CORPORATION	23,882	997,073.50	
KIMCO REALTY CORP	152,214	3,745,986.54	
KITE REALTY GROUP TRUST	49,586	1,303,120.08	
LAMAR ADVERTISING CO-A	19,852	2,560,908.00	
LINEAGE INC	13,456	834,541.12	
LTC PROPERTIES INC	9,776	363,178.40	
LXP INDUSTRIAL TRUST	66,567	601,765.68	
MACERICH CO/THE	53,308	1,146,122.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	432,047	42,772.65	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	135,606	539,711.88	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	26,393	4,149,507.46	
MODIV INDUSTRIAL INC	2,026	32,132.36	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	15,851	657,340.97	
NATL HEALTH INVESTORS INC	9,874	718,432.24	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	3,531	113,451.03	
NETSTREIT CORP	17,824	267,360.00	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	6,752	38,959.04	
NEXPOINT RESIDENTIAL	5,099	228,843.12	



NNN REIT INC	41,457	1,765,239.06
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	15,503	20,618.99
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	58,224	2,282,963.04
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,638	105,029.06
ORION OFFICE REIT INC	12,343	49,248.57
OUTFRONT MEDIA INC	30,816	579,957.12
PARAMOUNT GROUP INC	41,575	203,717.50
PARK HOTELS & RESORTS INC	46,745	714,263.60
PEAKSTONE REALTY TRUST	7,859	96,822.88
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	27,364	396,504.36
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	27,713	1,086,349.60
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	28,138	263,371.68
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	9,038	171,089.34
POSTAL REALTY TRUST INC- A	4,546	62,780.26
PRIME US REIT	202,620	35,661.12
PROLOGIS INC	209,080	23,235,060.40
PUBLIC STORAGE	35,570	11,297,743.40
REALTY INCOME CORP	196,642	10,882,168.28
REGENCY CENTERS CORP	36,900	2,781,153.00
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	28,972	505,271.68
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	49,416	2,019,631.92
RLJ LODGING TRUST	34,364	356,011.04
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	13,528	1,531,910.72
SABRA HEALTH CARE REIT INC	53,005	927,587.50
SAFEHOLD INC	10,541	215,352.63
SAUL CENTERS INC	2,675	107,989.75
SERVICE PROPERTIES TRUST	37,345	93,735.95
SIMON PROPERTY GROUP INC	69,213	12,430,654.80
SITE CENTERS CORP	10,505	163,983.05
SL GREEN REALTY CORP	15,778	1,177,512.14
STAG INDUSTRIAL INC	41,131	1,477,836.83
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	23,901	160,136.70
SUN COMMUNITIES INC	26,452	3,232,434.40
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	45,479	555,298.59
TANGER INC	24,786	880,646.58
TERRENO REALTY CORP	21,869	1,361,345.25
UDR INC	67,762	3,013,376.14
UMH PROPERTIES INC	15,611	302,385.07
UNITI GROUP INC	54,531	331,003.17
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	2,740	109,846.60
URBAN EDGE PROPERTIES	27,524	614,610.92
VENTAS INC	93,288	5,588,884.08
VERIS RESIDENTIAL INC	17,929	313,757.50

		VICI PROPERTIES INC	236,535	7,363,334.55
		VORNADO REALTY TRUST	37,393	1,669,971.38
		WELLTOWER INC	130,681	16,873,530.72
		WHITESTONE REIT	9,885	144,716.40
		WP CAREY INC	49,403	2,816,959.06
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	23,009	364,692.65
米ドル小計			6,673,769	267,930,887.55 (41,239,922,211)
加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	14,413	258,425.09
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,260	90,111.00
		BOARDWALK EQUITIES INC	5,455	371,540.05
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	18,491	811,569.99
		CHOICE PROPERTIES REIT	36,360	500,313.60
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,714	162,707.46
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11,893	174,708.17
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	30,245	366,266.95
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,395	43,589.00
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	23,300	403,556.00
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,964	506,422.08
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	29,428	284,568.76
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	15,407	158,846.17
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	13,239	232,609.23
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,611	62,064.06
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,661	65,531.90
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	7,802	61,479.76
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	26,116	121,700.56
		PRIMARIS REIT	10,186	162,976.00
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	32,940	603,460.80
		SLATE GROCERY REIT	6,982	102,146.66
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	16,030	404,436.90
加ドル小計			339,892	5,949,030.19 (643,863,537)
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	10,669	597,997.45
		ALTAREA	1,166	108,438.00
		CARE PROPERTY INVEST	8,125	94,250.00
		CARMILA	11,986	191,296.56
		COFINIMMO	8,486	462,911.30
		COVIVIO	12,005	592,326.70
		CROMWELL REIT EUR	77,660	124,256.00
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	10,159	229,593.40
		GECINA SA	11,790	1,056,384.00
		HAMBORNER REIT AG	15,391	98,040.67
		ICADE	7,123	155,993.70

		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	13,760	36,188.80
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	76,621	397,662.99
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	129,693	120,614.49
		KLEPIERRE	49,905	1,397,340.00
		MERCIALYS	20,269	206,743.80
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	88,515	906,393.60
		MONTEA	4,710	301,440.00
		NSI NV	3,768	74,154.24
		RETAIL ESTATES	2,859	166,393.80
		SHURGARD SELF STORAGE LTD	6,779	246,755.60
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	22,646	1,674,445.24
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	40,128	784,101.12
		WERELDHAVE NV	8,030	110,653.40
		XIOR STUDENT HOUSING NV	7,770	229,992.00
ユーロ小計			650,013	10,364,366.86 (1,678,094,638)
英債券	投資証券	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	95,935	58,040.67
		AEW UK REIT PLC	36,154	36,515.54
		ASSURA PLC	674,891	264,017.35
		BIG YELLOW GROUP PLC	44,041	434,244.26
		BRITISH LAND COMPANY PLC	225,385	820,852.17
		CARE REIT PLC	88,245	73,331.59
		CLS HOLDINGS PLC	40,564	32,897.40
		CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	105,991	81,295.09
		DERWENT LONDON PLC	25,163	508,795.86
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	133,006	112,656.08
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	93,314	280,408.57
		HAMMERSON PLC	101,604	292,619.52
		HELICAL PLC	25,383	47,973.87
		HOME REIT PLC	256,438	97,574.65
		INTU PROPERTIES PLC	758,746	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	168,122	974,266.99
		LIFE SCIENCE REIT PLC	75,173	28,941.60
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	461,552	845,101.71
		NEWRIVER REIT PLC	77,992	62,471.59
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	119,327	79,233.12
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	302,384	283,031.42
		PRS REIT PLC/THE	114,639	121,517.34
		REGIONAL REIT LTD	39,562	47,157.90
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	48,972	336,437.64
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	112,528	57,164.22
		SEGRO PLC	305,210	2,179,199.40
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	437,722	565,536.82

		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	290,532	203,662.93
		TARGET HEALTHCARE REIT PLC	135,797	116,785.42
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	81,369	49,065.50
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	561,315	748,232.89
		UNITE GROUP PLC/THE	94,074	778,462.35
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	103,040	110,252.80
		WAREHOUSE REIT PLC	84,803	68,436.02
		WORKSPACE GROUP PLC	31,337	161,698.92
英ポンド小計			6,350,310	10,957,879.20 (2,130,759,610)
豪ドル	投資証券	ABACUS GROUP	95,115	108,431.10
		ABACUS STORAGE KING	117,206	134,200.87
		ARENA REIT	89,202	338,075.58
		BWP TRUST	124,173	413,496.09
		CENTURIA CAPITAL GROUP	189,802	353,980.73
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	122,841	351,325.26
		CENTURIA OFFICE REIT	88,068	98,636.16
		CHARTER HALL GROUP	106,932	1,576,177.68
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	150,972	561,615.84
		CHARTER HALL RETAIL REIT	114,851	370,968.73
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	73,048	187,733.36
		CROMWELL PROPERTY GROUP	296,626	108,268.49
		DEXUS INDUSTRIA REIT	46,012	119,171.08
		DEXUS/AU	243,245	1,651,633.55
		GOODMAN GROUP	428,866	15,773,691.48
		GPT GROUP	432,775	1,938,832.00
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	60,352	147,862.40
		HEALTHCO REIT	98,054	100,995.62
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	411,775	481,776.75
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	84,227	387,444.20
		MIRVAC GROUP	891,407	1,778,356.96
		NATIONAL STORAGE REIT	308,200	730,434.00
		REGION RE LTD	263,321	558,240.52
		RURAL FUNDS GROUP	83,611	145,065.08
		SCENTRE GROUP	1,173,519	4,072,110.93
		STOCKLAND	539,200	2,685,216.00
		VICINITY CENTRES	875,535	1,777,336.05
		WAYPOINT REIT	153,667	362,654.12
豪ドル小計			7,662,602	37,313,730.63 (3,657,865,013)
ニュー ジーラン ドドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	238,724	479,835.24
ニュージーランドドル小計			238,724	479,835.24 (42,614,167)

香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	417,000	725,580.00	
		FORTUNE REIT	346,900	1,380,662.00	
		LINK REIT	581,680	19,573,532.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	165,000	301,950.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	539,610	523,421.70	
香港ドル小計			2,050,190	22,505,145.70 (445,376,833)	
シンガポールドル	投資証券	AIMS APAC REIT	148,317	183,913.08	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	793,232	2,022,741.60	
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	574,692	505,728.96	
		CAPITALAND CHINA TRUST	266,085	188,920.35	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERC	1,218,785	2,352,255.05	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	142,200	123,003.00	
		EC WORLD REIT	70,300	19,684.00	
		ESR-REIT	1,366,319	348,411.34	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	235,000	144,525.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	265,805	560,848.55	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERC	663,560	590,568.40	
		KEPPEL DC REIT	374,177	826,931.17	
		KEPPEL DC REIT(N)	25,789	56,993.69	
		KEPPEL REIT	527,300	450,841.50	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	374,352	207,765.36	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	468,208	1,034,739.68	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	761,487	967,088.49	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	524,331	634,440.51	
		QUE REAL ESTATE INVESTMENT T	545,300	152,684.00	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	86,500	314,860.00	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	127,100	87,699.00			
STARHILL GLOBAL REIT	322,900	159,835.50			
SUNTEC REIT	493,800	602,436.00			
シンガポールドル小計			10,375,539	12,536,914.23 (1,431,464,866)	
韓国ウォン	投資証券	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	34,588	157,548,340.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	12,128	52,756,800.00	
		JR REIT XXVII	45,388	136,164,000.00	
		KORAMCO LIFE INFRA REIT	12,676	51,591,320.00	
		LOTTE REIT CO LTD	30,139	97,198,275.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	24,193	138,142,030.00	
		SK REITS CO LTD	34,097	158,551,050.00	
韓国ウォン小計			193,209	791,951,815.00 (85,055,624)	
イスラエルシェケル	投資証券	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	165,396	322,522.20	
		REIT 1 LTD	44,961	862,801.59	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	47,950	446,894.00	

イスラエルシェケル小計	258,307	1,632,217.79 (69,744,829)	
合計		51,424,761,328 (51,424,761,328)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 141銘柄	100.0%	80.1%
加ドル	投資証券 22銘柄	100.0%	1.3%
ユーロ	投資証券 25銘柄	100.0%	3.3%
英ポンド	投資証券 35銘柄	100.0%	4.1%
豪ドル	投資証券 28銘柄	100.0%	7.1%
ニュージーランドドル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%
香港ドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.9%
シンガポールドル	投資証券 23銘柄	100.0%	2.8%
韓国ウォン	投資証券 7銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 3銘柄	100.0%	0.1%

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### 日本債券インデックスマザーファンド

#### 貸借対照表

(単位:円)

	2024年 6月17日現在	2024年12月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	239,990,104	189,267,756
国債証券	48,934,876,410	48,537,585,010
地方債証券	1,921,804,621	2,678,886,838
特殊債券	2,096,553,711	1,985,422,516
社債券	1,504,194,000	2,116,631,000
未収利息	150,392,527	157,647,484
前払費用	7,044,677	7,938,321
流動資産合計	54,854,856,050	55,673,378,925
資産合計	54,854,856,050	55,673,378,925
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	11,062,299	8,121,241
流動負債合計	11,062,299	8,121,241
負債合計	11,062,299	8,121,241
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	41,634,998,227	42,521,937,100
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	13,208,795,524	13,143,320,584
元本等合計	54,843,793,751	55,665,257,684
純資産合計	54,843,793,751	55,665,257,684
負債純資産合計	54,854,856,050	55,673,378,925



## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

		2024年 6月17日現在	2024年12月16日現在
1.	期首	2023年12月16日	2024年 6月18日
	期首元本額	38,876,887,677円	41,634,998,227円
	期首からの追加設定元本額	3,466,012,517円	3,230,395,057円
	期首からの一部解約元本額	707,901,967円	2,343,456,184円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	6,395,584,919円	6,809,727,468円
	DCインデックスバランス（株式40）	6,335,058,393円	6,605,193,570円
	DCインデックスバランス（株式60）	5,298,425,593円	5,558,561,313円
	DCインデックスバランス（株式80）	1,028,653,945円	1,075,402,655円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	2,175,942,211円	2,190,336,834円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	4,636,888,576円	4,627,294,198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）	1,839,701,160円	1,823,476,877円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	29,393,855円	49,869,586円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	2,159,550円	3,173,809円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	1,939,689円	2,695,193円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	3,067,373,592円	2,957,890,403円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,678,073,242円	1,684,447,641円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,763,683,474円	1,786,862,782円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,075,654,373円	1,106,336,887円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	170,963,633円	172,989,873円
	インデックスファンド日本債券（1年決算型）	5,720,716,710円	5,638,664,152円
	日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	414,785,312円	429,013,859円
	計	41,634,998,227円	42,521,937,100円
2.	受益権の総数	41,634,998,227口	42,521,937,100口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

	自 2023年12月16日 至 2024年 6月17日	自 2024年 6月18日 至 2024年12月16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

	2024年 6月17日現在	2024年12月16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)

(2024年 6月17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	438,058,350
地方債証券	5,538,879
特殊債券	5,097,289
社債券	4,634,000
合計	453,328,518

(2024年12月16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	316,020,100
地方債証券	11,538,906
特殊債券	5,065,484
社債券	9,602,000
合計	342,226,490

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2024年 6月17日現在		2024年12月16日現在	
1口当たり純資産額	1.3173円	1口当たり純資産額	1.3091円
(1万口当たり純資産額)	(13,173円)	(1万口当たり純資産額)	(13,091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456回利付国債(2年)	100,000,000	99,652,000	
	第457回利付国債(2年)	150,000,000	149,403,000	
	第458回利付国債(2年)	130,000,000	129,572,300	
	第460回利付国債(2年)	100,000,000	99,714,000	
	第461回利付国債(2年)	150,000,000	149,728,500	
	第463回利付国債(2年)	150,000,000	149,637,000	
	第465回利付国債(2年)	140,000,000	139,589,800	
	第149回利付国債(5年)	100,000,000	99,041,000	
	第150回利付国債(5年)	50,000,000	49,453,500	
	第151回利付国債(5年)	290,000,000	286,415,600	
	第152回利付国債(5年)	100,000,000	98,975,000	
	第153回利付国債(5年)	300,000,000	295,809,000	
	第155回利付国債(5年)	100,000,000	99,142,000	
	第156回利付国債(5年)	200,000,000	197,694,000	
	第157回利付国債(5年)	150,000,000	148,060,500	
	第158回利付国債(5年)	230,000,000	226,292,400	
	第159回利付国債(5年)	150,000,000	147,322,500	
	第160回利付国債(5年)	120,000,000	118,269,600	
	第161回利付国債(5年)	120,000,000	118,681,200	
	第162回利付国債(5年)	130,000,000	128,376,300	
	第163回利付国債(5年)	270,000,000	267,621,300	
	第164回利付国債(5年)	130,000,000	127,663,900	
	第165回利付国債(5年)	130,000,000	128,172,200	
	第166回利付国債(5年)	140,000,000	138,577,600	
	第167回利付国債(5年)	120,000,000	118,634,400	
	第168回利付国債(5年)	150,000,000	149,533,500	
	第170回利付国債(5年)	150,000,000	149,376,000	
	第171回利付国債(5年)	100,000,000	98,710,000	
	第172回利付国債(5年)	200,000,000	198,294,000	
	第173回利付国債(5年)	120,000,000	119,364,000	
	第174回利付国債(5年)	120,000,000	119,916,000	
	第1回利付国債(40年)	70,000,000	75,039,300	
	第2回利付国債(40年)	125,000,000	128,662,500	
	第3回利付国債(40年)	85,000,000	86,832,600	
	第4回利付国債(40年)	115,000,000	116,452,450	
	第5回利付国債(40年)	95,000,000	91,528,700	
	第6回利付国債(40年)	110,000,000	102,905,000	
	第7回利付国債(40年)	130,000,000	115,250,200	
	第8回利付国債(40年)	115,000,000	93,612,300	
	第9回利付国債(40年)	210,000,000	122,421,600	
	第10回利付国債(40年)	175,000,000	119,763,000	
	第11回利付国債(40年)	140,000,000	91,154,000	

第12回利付国債(40年)	175,000,000	99,657,250	
第13回利付国債(40年)	210,000,000	116,552,100	
第14回利付国債(40年)	210,000,000	123,335,100	
第15回利付国債(40年)	230,000,000	148,421,300	
第16回利付国債(40年)	220,000,000	155,038,400	
第17回利付国債(40年)	110,000,000	100,571,900	
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	59,121,600	
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	68,292,700	
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	49,894,000	
第342回利付国債(10年)	630,000,000	626,931,900	
第343回利付国債(10年)	645,000,000	640,801,050	
第344回利付国債(10年)	700,000,000	694,449,000	
第345回利付国債(10年)	660,000,000	654,033,600	
第346回利付国債(10年)	460,000,000	455,285,000	
第347回利付国債(10年)	680,000,000	672,098,400	
第348回利付国債(10年)	500,000,000	493,480,000	
第349回利付国債(10年)	590,000,000	581,450,900	
第350回利付国債(10年)	540,000,000	531,295,200	
第351回利付国債(10年)	435,000,000	427,235,250	
第352回利付国債(10年)	420,000,000	411,671,400	
第353回利付国債(10年)	400,000,000	391,252,000	
第354回利付国債(10年)	325,000,000	317,203,250	
第355回利付国債(10年)	350,000,000	340,973,500	
第356回利付国債(10年)	350,000,000	340,168,500	
第357回利付国債(10年)	560,000,000	543,211,200	
第358回利付国債(10年)	390,000,000	377,660,400	
第359回利付国債(10年)	420,000,000	405,988,800	
第360回利付国債(10年)	580,000,000	559,647,800	
第361回利付国債(10年)	460,000,000	442,934,000	
第362回利付国債(10年)	400,000,000	384,348,000	
第363回利付国債(10年)	500,000,000	479,240,000	
第364回利付国債(10年)	500,000,000	478,015,000	
第365回利付国債(10年)	410,000,000	390,824,300	
第366回利付国債(10年)	480,000,000	459,619,200	
第367回利付国債(10年)	420,000,000	400,873,200	
第368回利付国債(10年)	450,000,000	428,085,000	
第369回利付国債(10年)	490,000,000	476,069,300	
第370回利付国債(10年)	420,000,000	407,089,200	
第371回利付国債(10年)	480,000,000	459,940,800	
第372回利付国債(10年)	500,000,000	494,335,000	

第373回利付国債(10年)	440,000,000	426,157,600	
第374回利付国債(10年)	410,000,000	402,882,400	
第375回利付国債(10年)	410,000,000	412,660,900	
第376回利付国債(10年)	350,000,000	344,893,500	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	54,873,500	
第3回利付国債(30年)	70,000,000	75,889,800	
第5回利付国債(30年)	80,000,000	87,267,200	
第6回利付国債(30年)	50,000,000	55,431,500	
第7回利付国債(30年)	50,000,000	55,312,500	
第8回利付国債(30年)	170,000,000	182,202,600	
第9回利付国債(30年)	70,000,000	72,858,800	
第10回利付国債(30年)	50,000,000	50,846,500	
第11回利付国債(30年)	70,000,000	74,512,900	
第12回利付国債(30年)	50,000,000	54,893,500	
第13回利付国債(30年)	180,000,000	196,007,400	
第14回利付国債(30年)	108,000,000	121,372,560	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	166,503,960	
第16回利付国債(30年)	65,000,000	73,668,400	
第17回利付国債(30年)	50,000,000	56,214,500	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	122,672,000	
第19回利付国債(30年)	40,000,000	44,604,800	
第20回利付国債(30年)	60,000,000	68,113,800	
第21回利付国債(30年)	70,000,000	78,056,300	
第22回利付国債(30年)	70,000,000	79,535,400	
第23回利付国債(30年)	75,000,000	85,202,250	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	77,228,280	
第25回利付国債(30年)	60,000,000	66,822,000	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	191,080,000	
第27回利付国債(30年)	89,000,000	101,019,450	
第28回利付国債(30年)	144,000,000	163,352,160	
第29回利付国債(30年)	176,000,000	197,098,880	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	162,527,610	
第31回利付国債(30年)	160,000,000	174,376,000	
第32回利付国債(30年)	160,000,000	176,107,200	
第33回利付国債(30年)	195,000,000	205,851,750	
第34回利付国債(30年)	180,000,000	194,306,400	
第35回利付国債(30年)	193,000,000	202,132,760	
第36回利付国債(30年)	195,000,000	203,346,000	
第37回利付国債(30年)	211,000,000	216,019,690	
第38回利付国債(30年)	135,000,000	135,557,550	
第39回利付国債(30年)	135,000,000	137,350,350	
第40回利付国債(30年)	100,000,000	99,929,000	

第4 1 回利付国債(30年)	130,000,000	127,615,800	
第4 2 回利付国債(30年)	135,000,000	132,030,000	
第4 3 回利付国債(30年)	125,000,000	121,962,500	
第4 4 回利付国債(30年)	130,000,000	126,536,800	
第4 5 回利付国債(30年)	140,000,000	131,215,000	
第4 6 回利付国債(30年)	160,000,000	149,545,600	
第4 7 回利付国債(30年)	155,000,000	147,051,600	
第4 8 回利付国債(30年)	135,000,000	123,117,300	
第4 9 回利付国債(30年)	140,000,000	127,290,800	
第5 0 回利付国債(30年)	165,000,000	132,503,250	
第5 1 回利付国債(30年)	160,000,000	113,953,600	
第5 2 回利付国債(30年)	190,000,000	141,223,200	
第5 3 回利付国債(30年)	135,000,000	102,211,200	
第5 4 回利付国債(30年)	160,000,000	126,344,000	
第5 5 回利付国債(30年)	140,000,000	110,080,600	
第5 6 回利付国債(30年)	140,000,000	109,610,200	
第5 7 回利付国債(30年)	190,000,000	148,120,200	
第5 8 回利付国債(30年)	180,000,000	139,726,800	
第5 9 回利付国債(30年)	170,000,000	128,205,500	
第6 0 回利付国債(30年)	120,000,000	94,551,600	
第6 1 回利付国債(30年)	130,000,000	97,151,600	
第6 2 回利付国債(30年)	120,000,000	84,721,200	
第6 3 回利付国債(30年)	120,000,000	81,954,000	
第6 4 回利付国債(30年)	130,000,000	88,249,200	
第6 5 回利付国債(30年)	140,000,000	94,469,200	
第6 6 回利付国債(30年)	180,000,000	120,641,400	
第6 7 回利付国債(30年)	165,000,000	116,353,050	
第6 8 回利付国債(30年)	140,000,000	98,089,600	
第6 9 回利付国債(30年)	145,000,000	103,946,150	
第7 0 回利付国債(30年)	140,000,000	99,738,800	
第7 1 回利付国債(30年)	160,000,000	113,361,600	
第7 2 回利付国債(30年)	160,000,000	112,739,200	
第7 3 回利付国債(30年)	150,000,000	105,196,500	
第7 4 回利付国債(30年)	150,000,000	113,896,500	
第7 5 回利付国債(30年)	150,000,000	122,661,000	
第7 6 回利付国債(30年)	150,000,000	125,322,000	
第7 7 回利付国債(30年)	130,000,000	113,722,700	
第7 8 回利付国債(30年)	150,000,000	124,638,000	
第7 9 回利付国債(30年)	140,000,000	110,164,600	
第8 0 回利付国債(30年)	130,000,000	118,440,400	
第8 1 回利付国債(30年)	150,000,000	130,033,500	
第8 2 回利付国債(30年)	150,000,000	136,168,500	



第83回利付国債(30年)	150,000,000	148,669,500	
第84回利付国債(30年)	100,000,000	96,808,000	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	132,779,400	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	307,935,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	16,461,280	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	257,642,500	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	61,852,800	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	61,937,400	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	51,726,000	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	85,526,820	
第96回利付国債(20年)	248,000,000	257,441,360	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	46,998,450	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	97,918,860	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	122,275,530	
第100回利付国債(20年)	80,000,000	84,112,800	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	69,814,800	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	86,007,420	
第103回利付国債(20年)	71,000,000	75,144,980	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	34,693,890	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	81,185,720	
第106回利付国債(20年)	62,000,000	65,597,860	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	137,416,500	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	140,598,160	
第109回利付国債(20年)	107,000,000	112,490,170	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	103,861,380	
第111回利付国債(20年)	95,000,000	101,336,500	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	84,985,600	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	308,768,800	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	55,549,000	
第115回利付国債(20年)	125,000,000	134,136,250	
第116回利付国債(20年)	135,000,000	145,336,950	
第117回利付国債(20年)	243,000,000	260,374,500	
第118回利付国債(20年)	70,000,000	74,844,700	
第119回利付国債(20年)	60,000,000	63,499,200	
第120回利付国債(20年)	170,000,000	178,064,800	
第121回利付国債(20年)	142,000,000	151,390,460	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	18,030,030	
第123回利付国債(20年)	195,000,000	210,617,550	
第124回利付国債(20年)	90,000,000	96,689,700	
第125回利付国債(20年)	90,000,000	98,001,000	
第126回利付国債(20年)	105,000,000	113,044,050	
第127回利付国債(20年)	50,000,000	53,531,000	

第128回利付国債(20年)	135,000,000	144,765,900	
第129回利付国債(20年)	85,000,000	90,621,050	
第130回利付国債(20年)	150,000,000	160,182,000	
第131回利付国債(20年)	92,000,000	97,653,400	
第132回利付国債(20年)	135,000,000	143,395,650	
第133回利付国債(20年)	130,000,000	138,949,200	
第134回利付国債(20年)	120,000,000	128,403,600	
第135回利付国債(20年)	70,000,000	74,421,200	
第136回利付国債(20年)	70,000,000	73,915,800	
第137回利付国債(20年)	100,000,000	106,335,000	
第138回利付国債(20年)	120,000,000	125,858,400	
第139回利付国債(20年)	100,000,000	105,627,000	
第140回利付国債(20年)	318,000,000	338,288,400	
第141回利付国債(20年)	235,000,000	250,070,550	
第142回利付国債(20年)	165,000,000	176,884,950	
第143回利付国債(20年)	154,000,000	162,719,480	
第144回利付国債(20年)	130,000,000	136,307,600	
第145回利付国債(20年)	215,000,000	228,861,050	
第146回利付国債(20年)	195,000,000	207,495,600	
第147回利付国債(20年)	208,000,000	219,308,960	
第148回利付国債(20年)	220,000,000	229,803,200	
第149回利付国債(20年)	225,000,000	234,562,500	
第150回利付国債(20年)	250,000,000	257,857,500	
第151回利付国債(20年)	240,000,000	242,599,200	
第152回利付国債(20年)	250,000,000	252,187,500	
第153回利付国債(20年)	270,000,000	274,438,800	
第154回利付国債(20年)	230,000,000	230,989,000	
第155回利付国債(20年)	270,000,000	265,005,000	
第156回利付国債(20年)	200,000,000	183,136,000	
第157回利付国債(20年)	220,000,000	195,775,800	
第158回利付国債(20年)	230,000,000	211,123,900	
第159回利付国債(20年)	210,000,000	194,226,900	
第160回利付国債(20年)	210,000,000	195,749,400	
第161回利付国債(20年)	180,000,000	165,024,000	
第162回利付国債(20年)	210,000,000	191,709,000	
第163回利付国債(20年)	195,000,000	177,247,200	
第164回利付国債(20年)	255,000,000	227,686,950	
第165回利付国債(20年)	200,000,000	177,636,000	
第166回利付国債(20年)	180,000,000	163,575,000	
第167回利付国債(20年)	200,000,000	175,830,000	
第168回利付国債(20年)	180,000,000	155,197,800	
第169回利付国債(20年)	190,000,000	160,445,500	

第170回利付国債(20年)	160,000,000	134,363,200	
第171回利付国債(20年)	170,000,000	141,965,300	
第172回利付国債(20年)	230,000,000	194,014,200	
第173回利付国債(20年)	190,000,000	159,296,000	
第174回利付国債(20年)	200,000,000	166,750,000	
第175回利付国債(20年)	200,000,000	168,526,000	
第176回利付国債(20年)	190,000,000	159,239,000	
第177回利付国債(20年)	200,000,000	163,846,000	
第178回利付国債(20年)	220,000,000	182,353,600	
第179回利付国債(20年)	220,000,000	181,339,400	
第180回利付国債(20年)	190,000,000	164,226,500	
第181回利付国債(20年)	210,000,000	183,861,300	
第182回利付国債(20年)	200,000,000	180,430,000	
第183回利付国債(20年)	190,000,000	179,540,500	
第184回利付国債(20年)	200,000,000	179,162,000	
第185回利付国債(20年)	200,000,000	178,458,000	
第186回利付国債(20年)	200,000,000	190,384,000	
第187回利付国債(20年)	170,000,000	155,973,300	
第188回利付国債(20年)	175,000,000	168,309,750	
第189回利付国債(20年)	160,000,000	161,260,800	
第190回利付国債(20年)	120,000,000	118,616,400	
国債証券 合計	50,820,000,000	48,537,585,010	
地方債証券			
第26回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,881,000	
令和3年度第6回北海道公募公債(5年)	100,000,000	98,966,000	
平成26年度第5回京都府公募公債(20年)	100,000,000	102,788,000	
平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	101,032,675	
第22回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	96,208,000	
第24回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	94,897,000	
令和2年度第2回大分県公募公債	100,000,000	96,028,000	
第165回共同発行市場公募地方債	200,000,000	197,940,000	
第204回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,085,000	
第205回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,461,000	
第208回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,412,000	
第253回共同発行市場公募地方債	100,000,000	97,722,000	
第254回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,770,000	
第255回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,532,000	
平成28年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	99,018,000	
平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	99,914,428	
平成29年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	98,550,000	
令和2年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	95,979,000	
令和6年度第2回栃木県公募公債	100,000,000	99,418,000	
第2回名古屋市定時償還公募公債(10年)	10,000,000	10,005,452	

	平成27年度第5回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,102,672
	第18回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	103,888,000
	令和2年度第1回鹿児島県公募公債（5年）	100,000,000	99,678,611
	平成26年度第1回福井県公募公債	100,000,000	103,092,000
	令和6年度第1回福井県公募公債	100,000,000	99,385,000
	令和3年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	95,048,000
	令和元年度第1回秋田県公募公債	100,000,000	96,085,000
地方債証券 合計		2,710,000,000	2,678,886,838
特殊債券	第5回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	98,918,000
	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	197,892,000
	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	98,704,000
	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	103,653,000
	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	104,705,000
	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	100,018,516
	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	99,245,000
	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	196,984,000
	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	98,134,000
	第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	197,536,000
	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,772,000
	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	197,116,000
	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	98,037,000
	第395回信金中金債（5年）	100,000,000	98,416,000
	第405回信金中金債（5年）	100,000,000	98,351,000
第37回国際協力機構債券	100,000,000	98,941,000	
特殊債券 合計		2,000,000,000	1,985,422,516
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	99,545,000
	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	98,993,000
	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	97,777,000
	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	98,177,000
	第17回富士フィ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	98,536,000
	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	99,453,000
	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	104,898,000
	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	211,054,000

第3 2 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	208,108,000	
第5 1 0 回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,033,000	
第4 0 0 回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	98,537,000	
第4 4 7 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	98,450,000	
第3 2 3 回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,158,000	
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	99,244,000	
第2 8 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	103,659,000	
第3 5 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	105,219,000	
第3 2 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	102,666,000	
第4 7 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	95,538,000	
第5 1 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	96,586,000	
社債券 合計	2,100,000,000	2,116,631,000	
合計	57,630,000,000	55,318,525,364	

## 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）

	2024年 6月17日現在	2024年12月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	115,540,209	104,685,855
コール・ローン	86,680,360	11,735,092
国債証券	168,779,266,015	163,745,219,879
派生商品評価勘定	57,938	-
未収入金	80,078,161	562,465,469
未収利息	1,228,981,169	1,215,072,797
前払費用	75,582,557	79,169,302
流動資産合計	170,366,186,409	165,718,348,394
資産合計		
	170,366,186,409	165,718,348,394
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	76,617	1,890,163
未払解約金	162,365,840	249,380,267
流動負債合計	162,442,457	251,270,430
負債合計		
	162,442,457	251,270,430
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	55,620,468,481	54,486,500,585
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	114,583,275,471	110,980,577,379
元本等合計	170,203,743,952	165,467,077,964

	2024年 6月17日現在	2024年12月16日現在
純資産合計	170,203,743,952	165,467,077,964
負債純資産合計	170,366,186,409	165,718,348,394

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

		2024年 6月17日現在	2024年12月16日現在
1.	期首	2023年12月16日	2024年 6月18日
	期首元本額	56,559,461,172円	55,620,468,481円
	期首からの追加設定元本額	1,930,213,398円	1,542,707,899円
	期首からの一部解約元本額	2,869,206,089円	2,676,675,795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)	20,519,066,453円	20,952,873,628円
	DCインデックスバランス(株式20)	425,726,925円	454,138,575円
	DCインデックスバランス(株式40)	612,613,905円	637,270,464円
	DCインデックスバランス(株式60)	919,335,691円	967,017,289円
	DCインデックスバランス(株式80)	891,421,308円	934,701,880円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	12,777,355,300円	11,561,192,382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	2,150,070,500円	2,102,014,908円
	日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	11,490,037,749円	11,110,024,257円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)資産成長型	832,913,390円	804,629,065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)	133,320,300円	134,624,416円
	財産3分法(適格機関投資家専用)	347,202,276円	359,870,724円
	Niつみインデックスラップ世界10指数(均等型)	935,868円	1,385,675円
	Niつみインデックスラップ世界10指数(安定成長型)	1,681,178円	2,363,593円
	財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)奇数月分配型	22,670,600円	41,143,460円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	454,153,367円	427,903,533円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	55,820,759円	56,220,655円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	85,849,638円	86,791,912円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	94,391,712円	96,163,002円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	73,921,509円	75,052,783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	3,385,962,218円	3,327,171,536円
	海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	346,017,835円	353,946,848円
	計	55,620,468,481円	54,486,500,585円
2.	受益権の総数	55,620,468,481口	54,486,500,585口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）  
金融商品の状況に関する事項

	自 2023年12月16日 至 2024年 6月17日	自 2024年 6月18日 至 2024年12月16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

	2024年 6月17日現在	2024年12月16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）

（2024年 6月17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	7,678,581,991
合計	7,678,581,991

（2024年12月16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	97,465,819
合計	97,465,819

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 取引の時価等に関する事項

## （通貨関連）

（2024年 6月17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	115,732,300	-	115,750,979	18,679
	米ドル	45,602,500	-	45,676,653	74,153
	メキシコペソ	40,461,480	-	40,403,542	57,938
	ユーロ	29,668,320	-	29,670,784	2,464
合計		115,732,300	-	115,750,979	18,679

（2024年12月16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	343,609,107	-	345,499,270	1,890,163
	米ドル	122,598,940	-	123,581,459	982,519
	ユーロ	166,007,193	-	166,896,131	888,938
	英ポンド	55,002,974	-	55,021,680	18,706
合計		343,609,107	-	345,499,270	1,890,163

（注）1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2024年 6月17日現在		2024年12月16日現在	
1口当たり純資産額	3.0601円	1口当たり純資産額	3.0368円
(1万口当たり純資産額)	(30,601円)	(1万口当たり純資産額)	(30,368円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,302,640.68	

US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	3,420,000.00	3,295,395.72
US TREASURY N/B-4.875%-25/11/30	4,000,000.00	4,021,588.00
US TREASURY N/B-4.0%-25/12/15	1,510,000.00	1,506,110.24
US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	1,966,604.00
US TREASURY N/B-3.875%-26/01/15	1,150,000.00	1,145,282.70
US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	1,816,613.05
US TREASURY N/B-0.375%-26/01/31	2,370,000.00	2,269,275.00
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	1,838,390.40
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,310,000.00	3,210,504.71
US TREASURY N/B-4.0%-26/02/15	3,000,000.00	2,989,803.00
US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,752,870.03
US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	3,650,000.00	3,488,954.70
US TREASURY N/B-4.625%-26/02/28	2,820,000.00	2,830,848.54
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	4,490,000.00	4,376,519.74
US TREASURY N/B-0.75%-26/03/31	2,400,000.00	2,294,764.80
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	1,050,000.00	1,023,626.10
US TREASURY N/B-0.75%-26/04/30	2,740,000.00	2,612,524.24
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	4,840,000.00	4,665,116.28
US TREASURY N/B-3.625%-26/05/15	6,750,000.00	6,692,253.75
US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	2,740,000.00	2,657,906.86
US TREASURY N/B-0.75%-26/05/31	2,800,000.00	2,662,186.80
US TREASURY N/B-4.125%-26/06/15	3,000,000.00	2,994,783.00
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	1,930,116.00
US TREASURY N/B-4.5%-26/07/15	3,600,000.00	3,613,500.00
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	960,000.00	924,637.44
US TREASURY N/B-0.625%-26/07/31	1,760,000.00	1,660,449.12
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,823,984.00
US TREASURY N/B-0.75%-26/08/31	3,000,000.00	2,828,670.00
US TREASURY N/B-3.75%-26/08/31	3,400,000.00	3,371,644.00
US TREASURY N/B-4.625%-26/09/15	2,600,000.00	2,615,488.20
US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,547,668.62
US TREASURY N/B-0.875%-26/09/30	2,000,000.00	1,884,570.00
US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	250,000.00	238,339.75
US TREASURY N/B-1.125%-26/10/31	3,950,000.00	3,729,353.00
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,040,000.00	2,915,429.92
US TREASURY N/B-4.625%-26/11/15	3,200,000.00	3,221,622.40
US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,400,000.00	2,283,280.80
US TREASURY N/B-1.25%-26/11/30	2,210,000.00	2,086,635.59
US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	1,904,218.00
US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	4,000,000.00	3,779,216.00
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	2,680,000.00	2,571,017.80
US TREASURY N/B-4.125%-27/02/15	1,880,000.00	1,875,666.60
US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,390,000.00	1,299,758.42

US TREASURY N/B-4.25%-27/03/15	2,300,000.00	2,300,897.00	
US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	670,000.00	617,891.42	
US TREASURY N/B-4.5%-27/04/15	3,190,000.00	3,208,192.57	
US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	1,380,000.00	1,264,747.92	
US TREASURY N/B-2.75%-27/04/30	1,430,000.00	1,382,742.79	
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,380,801.02	
US TREASURY N/B-4.5%-27/05/15	4,700,000.00	4,728,087.20	
US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	1,600,000.00	1,461,561.60	
US TREASURY N/B-2.625%-27/05/31	1,750,000.00	1,684,716.25	
US TREASURY N/B-4.625%-27/06/15	8,450,000.00	8,529,548.30	
US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	2,600,000.00	2,368,841.80	
US TREASURY N/B-3.25%-27/06/30	5,000,000.00	4,884,570.00	
US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	4,450,000.00	4,027,250.00	
US TREASURY N/B-2.75%-27/07/31	930,000.00	896,032.68	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	2,814,888.96	
US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	1,900,000.00	1,720,463.30	
US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	4,090,000.00	3,679,560.32	
US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	3,640,000.00	3,276,000.00	
US TREASURY N/B-4.125%-27/10/31	800,000.00	798,031.20	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	1,400,000.00	1,473,663.80	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	2,857,554.20	
US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	220,000.00	198,171.82	
US TREASURY N/B-3.875%-27/11/30	2,320,000.00	2,297,523.84	
US TREASURY N/B-0.625%-27/12/31	1,780,000.00	1,598,801.34	
US TREASURY N/B-0.75%-28/01/31	900,000.00	808,892.10	
US TREASURY N/B-3.5%-28/01/31	1,450,000.00	1,419,187.50	
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	3,825,156.00	
US TREASURY N/B-1.125%-28/02/29	2,030,000.00	1,841,906.29	
US TREASURY N/B-4.0%-28/02/29	2,650,000.00	2,631,158.50	
US TREASURY N/B-1.25%-28/03/31	960,000.00	872,549.76	
US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	3,370,000.00	3,055,639.66	
US TREASURY N/B-3.5%-28/04/30	3,000,000.00	2,930,625.00	
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	2,440,000.00	2,335,250.80	
US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	3,530,000.00	3,193,474.51	
US TREASURY N/B-3.625%-28/05/31	1,020,000.00	1,000,018.20	
US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	3,300,000.00	2,977,989.30	
US TREASURY N/B-4.0%-28/06/30	200,000.00	198,480.40	
US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	1,900,000.00	1,694,562.50	
US TREASURY N/B-4.125%-28/07/31	5,950,000.00	5,926,057.20	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	4,006,157.40	
US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	2,960,000.00	2,645,209.92	
US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	3,700,000.00	3,314,460.00	
US TREASURY N/B-4.625%-28/09/30	2,400,000.00	2,430,748.80	

US TREASURY N/B-1.375%-28/10/31	3,800,000.00	3,412,574.80
US TREASURY N/B-4.875%-28/10/31	2,100,000.00	2,145,649.80
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,109,163.07
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	2,610,000.00	2,505,038.85
US TREASURY N/B-1.5%-28/11/30	4,930,000.00	4,439,499.51
US TREASURY N/B-4.375%-28/11/30	1,050,000.00	1,054,449.90
US TREASURY N/B-1.375%-28/12/31	870,000.00	777,935.73
US TREASURY N/B-4.0%-29/01/31	2,700,000.00	2,673,526.50
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,590,000.00	4,306,976.01
US TREASURY N/B-4.25%-29/02/28	5,000,000.00	4,998,730.00
US TREASURY N/B-2.375%-29/03/31	4,630,000.00	4,289,167.18
US TREASURY N/B-2.875%-29/04/30	2,000,000.00	1,890,468.00
US TREASURY N/B-4.625%-29/04/30	300,000.00	304,335.90
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	4,810,000.00	4,450,466.93
US TREASURY N/B-4.5%-29/05/31	3,370,000.00	3,403,170.91
US TREASURY N/B-3.25%-29/06/30	4,980,000.00	4,773,310.08
US TREASURY N/B-4.25%-29/06/30	3,000,000.00	2,998,476.00
US TREASURY N/B-4.0%-29/07/31	3,500,000.00	3,462,536.00
US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	1,670,000.00	1,487,929.92
US TREASURY N/B-3.875%-29/09/30	325,000.00	319,553.65
US TREASURY N/B-4.0%-29/10/31	2,520,000.00	2,491,352.64
US TREASURY N/B-4.125%-29/10/31	4,750,000.00	4,722,535.50
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	6,940,000.00	6,187,301.48
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	3,789,019.64
US TREASURY N/B-4.0%-30/02/28	1,650,000.00	1,629,663.75
US TREASURY N/B-3.625%-30/03/31	2,550,000.00	2,472,602.40
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,159,953.76
US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	2,870,000.00	2,367,299.41
US TREASURY N/B-3.75%-30/05/31	710,000.00	691,917.01
US TREASURY N/B-3.75%-30/06/30	380,000.00	370,084.28
US TREASURY N/B-4.0%-30/07/31	4,900,000.00	4,831,091.30
US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	5,090,000.00	4,159,680.34
US TREASURY N/B-4.625%-30/09/30	800,000.00	813,577.60
US TREASURY N/B-4.875%-30/10/31	3,000,000.00	3,089,178.00
US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	5,910,000.00	4,869,514.95
US TREASURY N/B-4.375%-30/11/30	3,000,000.00	3,011,658.00
US TREASURY N/B-4.0%-31/01/31	670,000.00	659,112.50
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	560,000.00	593,052.88
US TREASURY N/B-1.125%-31/02/15	3,300,000.00	2,745,121.50
US TREASURY N/B-4.25%-31/02/28	1,000,000.00	996,953.00
US TREASURY N/B-4.625%-31/04/30	1,185,000.00	1,205,412.81
US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	6,020,000.00	5,121,466.84
US TREASURY N/B-4.625%-31/05/31	1,450,000.00	1,474,864.60

US TREASURY N/B-4.25%-31/06/30	2,420,000.00	2,411,208.14	
US TREASURY N/B-4.125%-31/07/31	3,000,000.00	2,967,126.00	
US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	4,790,000.00	3,944,823.66	
US TREASURY N/B-4.125%-31/10/31	1,800,000.00	1,779,046.20	
US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	5,480,000.00	4,519,498.48	
US TREASURY N/B-1.875%-32/02/15	5,870,000.00	4,986,171.71	
US TREASURY N/B-2.875%-32/05/15	4,800,000.00	4,356,561.60	
US TREASURY N/B-2.75%-32/08/15	5,100,000.00	4,573,363.80	
US TREASURY N/B-4.125%-32/11/15	6,110,000.00	6,026,103.59	
US TREASURY N/B-3.5%-33/02/15	2,610,000.00	2,456,712.09	
US TREASURY N/B-3.375%-33/05/15	1,680,000.00	1,563,285.36	
US TREASURY N/B-3.875%-33/08/15	3,330,000.00	3,210,259.86	
US TREASURY N/B-4.5%-33/11/15	5,540,000.00	5,587,716.02	
US TREASURY N/B-4.0%-34/02/15	2,000,000.00	1,941,092.00	
US TREASURY N/B-4.375%-34/05/15	4,810,000.00	4,802,481.97	
US TREASURY N/B-3.875%-34/08/15	2,000,000.00	1,918,280.00	
US TREASURY N/B-4.25%-34/11/15	1,850,000.00	1,828,175.55	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	812,780.80	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	791,015.25	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	664,110.70	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	720,000.00	721,602.72	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	715,531.20	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	1,404,687.50	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	1,411,068.20	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	734,223.00	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	683,426.52	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	1,553,695.53	
US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,300,000.00	2,031,753.90	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,325,980.80	
US TREASURY N/B-1.125%-40/08/15	3,000,000.00	1,831,755.00	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	970,901.89	
US TREASURY N/B-1.375%-40/11/15	3,100,000.00	1,962,321.70	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	1,526,161.50	
US TREASURY N/B-1.875%-41/02/15	4,200,000.00	2,876,752.20	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	848,045.55	
US TREASURY N/B-2.25%-41/05/15	4,900,000.00	3,554,793.20	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	863,736.96	
US TREASURY N/B-1.75%-41/08/15	3,190,000.00	2,114,057.66	
US TREASURY N/B-2.0%-41/11/15	3,000,000.00	2,059,920.00	
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	410,546.50	
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	614,905.60	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	1,529,764.00	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	1,765,000.00	1,426,063.52	

US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	1,587,628.65
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	1,950,000.00	1,689,187.50
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	1,839,200.00
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	1,080,000.00	931,414.68
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,000,000.00	1,657,656.00
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	1,700,000.00	1,350,503.80
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	1,900,000.00	1,475,579.90
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	2,120,000.00	1,505,613.40
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	1,400,000.00	1,082,729.20
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	1,390,000.00	1,049,231.77
US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	1,190,000.00	915,834.71
US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	980,000.00	686,650.72
US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	900,000.00	628,382.70
US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	1,650,000.00	1,093,253.70
US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	540,000.00	402,173.10
US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	1,720,000.00	1,307,635.16
US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	1,530,000.00	1,159,990.92
US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	1,700,000.00	1,227,053.20
US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,440,000.00	1,037,052.00
US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	2,070,983.75
US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	1,846,593.60
US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	3,076,599.00
US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	2,367,661.15
US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	2,468,103.00
US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	2,186,658.00
US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,250,000.00	1,434,197.25
US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	2,028,984.10
US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	2,214,290.90
US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	2,450,000.00	1,199,542.05
US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,920,000.00	1,470,719.32
US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	3,000,000.00	1,615,605.00
US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	4,750,000.00	2,727,260.00
US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	4,100,000.00	2,658,349.80
US TREASURY N/B-2.0%-51/08/15	2,000,000.00	1,180,624.00
US TREASURY N/B-1.875%-51/11/15	1,400,000.00	798,354.20
US TREASURY N/B-2.25%-52/02/15	2,000,000.00	1,251,914.00
US TREASURY N/B-2.875%-52/05/15	600,000.00	432,621.00
US TREASURY N/B-3.0%-52/08/15	1,100,000.00	814,192.50
US TREASURY N/B-4.0%-52/11/15	1,500,000.00	1,346,044.50
US TREASURY N/B-3.625%-53/02/15	2,900,000.00	2,430,901.80
US TREASURY N/B-3.625%-53/05/15	2,150,000.00	1,803,185.65
US TREASURY N/B-4.125%-53/08/15	1,500,000.00	1,377,040.50
US TREASURY N/B-4.75%-53/11/15	1,500,000.00	1,528,125.00

		US TREASURY N/B-4.25%-54/02/15	1,000,000.00	939,687.00	
		US TREASURY N/B-4.625%-54/05/15	1,500,000.00	1,500,702.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-54/08/15	500,000.00	470,312.50	
		US TREASURY N/B-4.5%-54/11/15	230,000.00	225,867.13	
米ドル小計			555,105,000.00	498,736,661.34 (76,765,546,913)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-26/02/01	620,000.00	629,566.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	995,000.00	962,324.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-26/04/01	700,000.00	699,552.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-26/05/01	870,000.00	880,927.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	670,000.00	656,258.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-26/08/01	460,000.00	466,909.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-26/09/01	990,000.00	957,795.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-26/11/01	660,000.00	662,824.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-27/02/01	250,000.00	250,022.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	520,000.00	501,129.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	650,000.00	621,322.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-27/09/01	620,000.00	616,571.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-28/03/01	580,000.00	589,575.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	697,000.00	676,320.01	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-28/09/01	930,000.00	939,551.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-29/03/01	1,000,000.00	1,041,010.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	410,000.00	458,548.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	364,000.00	354,597.88	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-29/09/01	1,300,000.00	1,330,095.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/12/01	120,000.00	116,122.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	1,748,000.00	1,593,826.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-30/12/01	1,105,000.00	953,769.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	1,646,000.00	1,496,493.82	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/12/01	1,360,000.00	1,225,890.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-32/06/01	1,070,000.00	991,772.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-32/12/01	890,000.00	851,302.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	710,000.00	845,283.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-33/06/01	500,000.00	485,985.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-33/12/01	800,000.00	806,504.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-34/03/01	145,000.00	148,961.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-34/06/01	650,000.00	641,524.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-34/12/01	270,000.00	271,795.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	290,000.00	343,136.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	460,000.00	505,604.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	520,000.00	540,342.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	610,000.00	558,833.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	2,073,000.00	1,605,227.55	



		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-53/12/01	1,241,000.00	892,117.67	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-55/12/01	780,000.00	702,374.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	285,000.00	258,959.55	
加ドル小計			30,559,000.00	29,130,727.98	(3,152,818,689)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	23,150,000.00	22,166,125.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.0%-26/09/03	5,200,000.00	4,995,250.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	15,550,000.00	14,320,578.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	19,500,000.00	18,622,500.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/03/01	7,900,000.00	7,556,843.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	14,120,000.00	13,471,362.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	19,900,000.00	17,978,406.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-33/05/26	12,800,000.00	10,960,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	6,000,000.00	5,124,375.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	4,400,000.00	4,343,625.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	11,170,000.00	9,700,446.87	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 42/11/13	15,900,000.00	12,357,281.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	13,570,000.00	10,601,562.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-53/07/31	12,200,000.00	9,409,250.00	
メキシコペソ小計			181,360,000.00	161,607,606.24	(1,237,510,244)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	270,000.00	112,916.97	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	505,000.00	519,045.56	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	742,000.00	729,115.91	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	780,000.00	754,405.86	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	375,000.00	352,661.62	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	880,000.00	968,680.24	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	765,000.00	728,075.74	
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	840,000.00	787,967.88	
		BELGIUM KINGDOM-2.7%-29/10/22	215,000.00	217,907.43	
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	730,000.00	642,714.63	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	730,000.00	663,294.06	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-31/10/22	610,000.00	512,305.45	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	475,000.00	517,605.12	
		BELGIUM KINGDOM-0.35%-32/06/22	675,000.00	569,930.85	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	525,000.00	470,238.82	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-33/06/22	476,000.00	485,709.44	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	543,000.00	553,456.55	
		BELGIUM KINGDOM-2.85%-34/10/22	240,000.00	240,457.20	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	889,000.00	1,056,689.40	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	340,000.00	285,752.32	

BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	415,000.00	363,150.73
BELGIUM KINGDOM-2.75%-39/04/22	190,000.00	183,074.12
BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	345,000.00	229,938.01
BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	992,000.00	1,128,109.34
BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	435,000.00	467,016.87
BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	448,000.00	330,264.70
BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	461,000.00	333,966.84
BELGIUM KINGDOM-1.4%-53/06/22	485,000.00	312,930.73
BELGIUM KINGDOM-3.3%-54/06/22	433,000.00	424,545.24
BELGIUM KINGDOM-3.5%-55/06/22	263,000.00	266,334.31
BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	412,000.00	318,960.51
BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	446,000.00	331,838.71
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-71/10/31	345,000.00	184,071.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-26/01/31	955,000.00	931,123.09
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-26/04/30	1,055,000.00	1,051,647.21
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.8%-26/05/31	485,000.00	488,764.08
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	1,285,000.00	1,359,380.94
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%-26/10/31	1,640,000.00	1,614,681.68
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-27/01/31	755,000.00	720,627.11
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%-27/04/30	1,275,000.00	1,254,528.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.5%-27/05/31	490,000.00	492,870.42
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%-27/07/30	860,000.00	828,261.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-27/10/31	1,170,000.00	1,143,476.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-28/01/31	1,125,000.00	1,047,373.87
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/04/30	1,270,000.00	1,232,923.62
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/07/30	1,275,000.00	1,234,239.52
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-28/10/31	1,020,000.00	1,123,905.36
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	1,355,000.00	1,547,579.37
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-29/04/30	1,025,000.00	985,123.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.5%-29/05/31	430,000.00	449,181.87
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%-29/07/30	1,035,000.00	961,664.04
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%-29/10/31	1,210,000.00	1,108,257.15
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-30/04/30	1,205,000.00	1,086,083.37
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-30/07/30	1,180,000.00	1,146,387.70

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%-30/10/31	1,230,000.00	1,144,344.03	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%-31/04/30	1,175,000.00	1,006,176.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.1%-31/07/30	145,000.00	149,215.44	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-31/10/31	1,090,000.00	946,925.51	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.7%-32/04/30	1,190,000.00	1,036,049.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	1,050,000.00	1,270,987.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.55%-32/10/31	985,000.00	973,835.02	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-33/04/30	1,022,000.00	1,051,193.43	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%-33/07/30	1,015,000.00	982,159.67	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.55%-33/10/31	1,030,000.00	1,088,158.95	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.25%-34/04/30	738,000.00	760,783.53	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-34/10/31	252,000.00	263,554.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%-35/07/30	995,000.00	896,082.07	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	995,000.00	1,109,623.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.85%-37/07/30	670,000.00	512,902.42	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.9%-39/07/30	340,000.00	366,244.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	945,000.00	1,133,372.52	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%-40/10/31	1,000,000.00	745,380.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	1,190,000.00	1,404,205.95	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-42/07/30	390,000.00	271,344.06	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-43/07/30	300,000.00	302,653.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	710,000.00	892,351.43	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	980,000.00	907,962.16	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	785,000.00	694,518.54	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-50/10/31	1,170,000.00	690,128.01	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.9%-52/10/31	743,000.00	535,639.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-54/10/31	400,000.00	432,401.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	798,000.00	773,637.06	
BUNDESobligation-0.0%-26/04/10	1,600,000.00	1,558,625.60	
BUNDESobligation-0.0%-26/10/09	800,000.00	772,101.60	
BUNDESobligation-0.0%-27/04/16	1,050,000.00	1,003,181.55	

BUNDESobligation-1.3%-27/10/15	1,130,000.00	1,110,340.26	
BUNDESobligation-2.2%-28/04/13	750,000.00	755,310.00	
BUNDESobligation-2.4%-28/10/19	685,000.00	694,892.77	
BUNDESobligation-2.1%-29/04/12	297,000.00	297,715.17	
BUNDESobligation-2.1%-29/04/12	500,000.00	501,378.00	
BUNDESobligation-2.5%-29/10/11	260,000.00	265,067.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	1,820,000.00	1,787,132.62	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-26/08/15	1,910,000.00	1,848,622.15	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	1,315,000.00	1,268,608.11	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	910,000.00	1,010,928.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15	1,120,000.00	1,079,364.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-27/11/15	1,095,000.00	1,034,911.87	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	650,000.00	719,774.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-28/02/15	1,590,000.00	1,521,083.04	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	970,000.00	1,061,447.72	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-28/08/15	1,090,000.00	1,025,831.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-28/11/15	1,180,000.00	1,093,616.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-29/02/15	1,705,000.00	1,590,485.38	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-29/08/15	1,760,000.00	1,606,997.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.1%-29/11/15	620,000.00	621,094.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	660,000.00	790,541.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/02/15	1,290,000.00	1,165,169.28	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/08/15	1,650,000.00	1,475,662.65	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/08/15	740,000.00	662,018.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.4%-30/11/15	450,000.00	457,770.15	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	1,180,000.00	1,406,738.18	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/02/15	1,310,000.00	1,157,823.85	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/08/15	1,410,000.00	1,232,327.31	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/08/15	160,000.00	139,887.52	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-32/02/15	1,323,000.00	1,141,426.18	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.7%-32/08/15	1,220,000.00	1,185,230.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.3%-33/02/15	1,770,000.00	1,788,618.63	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.3%- 33/02/15	170,000.00	171,881.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.6%- 33/08/15	1,310,000.00	1,352,142.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.2%- 34/02/15	1,080,000.00	1,078,391.86	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,300,000.00	1,580,793.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.6%- 34/08/15	715,000.00	736,921.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 35/05/15	920,000.00	726,663.84	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 36/05/15	1,000,000.00	767,367.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	1,640,000.00	1,916,554.84	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 38/05/15	115,000.00	96,377.59	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,135,000.00	1,382,339.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,165,000.00	1,506,393.93	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.6%- 41/05/15	125,000.00	126,813.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	955,000.00	1,058,476.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,560,000.00	1,564,719.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,587,000.00	1,595,949.09	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	1,940,000.00	1,524,913.72	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	1,630,000.00	880,881.34	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	640,000.00	346,434.56	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 52/08/15	900,000.00	464,109.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%- 53/08/15	1,110,000.00	959,710.44	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%- 53/08/15	500,000.00	433,230.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 54/08/15	425,000.00	427,383.82	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-3.1%-25/12/12	420,000.00	423,644.34	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.5%-26/03/19	280,000.00	281,359.68	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.9%-26/06/18	560,000.00	566,577.20	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.7%-26/09/17	235,000.00	237,552.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 72/03/01	220,000.00	145,236.74	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	1,085,000.00	1,081,691.83	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 26/01/15	810,000.00	819,477.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.2%- 26/01/28	215,000.00	216,892.43	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 26/02/01	850,000.00	832,972.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-	1,130,000.00	1,159,021.79	

26/03/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 26/04/01	1,020,000.00	990,742.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%- 26/04/15	950,000.00	967,768.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	970,000.00	960,987.73	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%- 26/07/15	950,000.00	947,833.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 26/08/01	375,000.00	361,575.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 26/09/15	540,000.00	553,535.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	720,000.00	785,436.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,080,000.00	1,059,085.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%- 27/01/15	1,005,000.00	975,650.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 27/02/15	150,000.00	151,777.95	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.1%- 27/04/01	410,000.00	398,727.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	1,160,000.00	1,156,647.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 27/07/15	385,000.00	394,866.39	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	995,000.00	987,460.88	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 27/09/15	775,000.00	745,818.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	1,440,000.00	1,602,514.08	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.65%- 27/12/01	950,000.00	956,314.65	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	865,000.00	854,085.43	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%- 28/03/15	840,000.00	782,255.88	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.4%- 28/04/01	150,000.00	154,219.65	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 28/07/15	1,050,000.00	978,839.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%- 28/08/01	650,000.00	677,687.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,330,000.00	1,434,039.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 28/12/01	1,030,000.00	1,041,032.33	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.1%- 29/02/01	735,000.00	776,828.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 29/02/15	605,000.00	554,639.19	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 29/06/15	305,000.00	307,001.41	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 29/07/01	375,000.00	385,623.37	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 29/08/01	1,805,000.00	1,834,663.37	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	1,750,000.00	1,958,477.50	

BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 29/12/15	875,000.00	920,513.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,500,000.00	1,559,632.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 30/04/01	955,000.00	890,034.21
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.7%- 30/06/15	540,000.00	564,096.42
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 30/08/01	827,000.00	747,851.13
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 30/11/15	585,000.00	620,443.98
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 30/12/01	1,107,000.00	1,034,174.89
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 31/02/15	405,000.00	418,154.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 31/04/01	1,295,000.00	1,147,531.87
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	1,515,000.00	1,791,719.29
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 31/07/15	390,000.00	400,983.18
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%- 31/08/01	1,120,000.00	964,448.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 31/10/30	290,000.00	309,554.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 31/12/01	1,010,000.00	883,147.03
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,250,000.00	1,143,461.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 32/06/01	990,000.00	855,191.70
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 32/12/01	600,000.00	576,231.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,125,000.00	1,335,189.37
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.4%- 33/05/01	865,000.00	946,041.85
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	1,035,000.00	981,521.55
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.35%- 33/11/01	700,000.00	762,164.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.2%- 34/03/01	755,000.00	812,534.77
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 34/07/01	390,000.00	408,058.56
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	1,460,000.00	1,668,168.26
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 35/02/01	130,000.00	135,563.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	780,000.00	782,930.46
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 35/04/30	400,000.00	425,884.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 36/03/01	770,000.00	632,090.69
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	965,000.00	858,258.45
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	1,825,000.00	1,934,523.72
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-	400,000.00	301,253.20



37/03/01		
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.05%- 37/10/30	290,000.00	306,648.03
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 38/03/01	200,000.00	193,866.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	785,000.00	735,255.33
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,200,000.00	1,387,582.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.15%- 39/10/01	350,000.00	369,622.05
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%- 40/03/01	690,000.00	646,914.33
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	970,000.00	1,120,602.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%- 41/03/01	730,000.00	564,467.39
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.45%- 43/09/01	610,000.00	662,861.38
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	935,000.00	1,060,482.61
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 45/04/30	440,000.00	303,778.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	820,000.00	756,659.92
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	715,000.00	601,212.04
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	915,000.00	863,294.26
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 49/09/01	930,000.00	929,470.83
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 50/09/01	870,000.00	677,964.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%- 51/09/01	640,000.00	422,484.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 52/09/01	280,000.00	200,676.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 53/10/01	735,000.00	804,338.43
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.3%- 54/10/01	245,000.00	257,383.77
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 67/03/01	500,000.00	398,395.50
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	245,000.00	239,681.05
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-26/09/15	180,000.00	173,469.96
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-27/04/15	170,000.00	167,007.32
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	315,000.00	301,661.32
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	330,000.00	336,317.85
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	253,333.71
FINNISH GOVERNMENT-2.875%-29/04/15	270,000.00	276,249.14
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	375,000.00	344,783.62
FINNISH GOVERNMENT-2.5%-30/04/15	87,000.00	87,660.93
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-30/09/15	292,000.00	255,031.04
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	365,000.00	329,525.65
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-31/09/15	200,000.00	171,473.60
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-32/09/15	230,000.00	213,277.16

FINNISH GOVERNMENT-3.0%-33/09/15	110,000.00	113,348.73
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	325,000.00	284,453.00
FINNISH GOVERNMENT-3.0%-34/09/15	140,000.00	143,983.70
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	278,000.00	207,450.27
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-38/04/15	210,000.00	208,337.64
FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15	145,000.00	97,486.98
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	252,000.00	243,995.47
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-43/04/15	235,000.00	155,924.38
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	196,739.40
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-52/04/15	230,000.00	113,472.34
FINNISH GOVERNMENT-2.95%-55/04/15	133,000.00	133,835.63
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	515,000.00	184,498.75
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-26/02/25	1,640,000.00	1,598,257.08
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	1,970,000.00	2,003,302.85
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,340,000.00	2,284,228.44
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-26/09/24	1,360,000.00	1,366,643.60
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,520,000.00	2,428,261.92
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-27/02/25	2,005,000.00	1,910,548.46
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	1,775,000.00	1,723,106.10
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-27/09/24	180,000.00	180,905.22
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,020,000.00	3,057,946.30
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/02/25	1,275,000.00	1,212,213.90
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	3,450,000.00	3,265,362.90
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	2,930,000.00	2,744,170.61
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-29/02/25	1,000,000.00	1,009,680.99
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	2,105,000.00	2,361,431.10
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	2,980,000.00	2,730,579.96
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-29/11/25	2,510,000.00	2,217,125.67
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-30/02/25	330,000.00	332,402.40
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	2,935,000.00	2,921,672.16
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-30/11/25	2,549,000.00	2,183,379.08
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	2,860,000.00	2,661,026.94
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-31/11/25	2,505,000.00	2,076,041.29
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-32/05/25	1,763,000.00	1,435,898.26
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	1,655,000.00	1,992,610.07
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-32/11/25	2,075,000.00	1,950,373.42
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-33/05/25	1,800,000.00	1,811,705.39
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-33/11/25	2,013,000.00	2,098,594.77
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	2,385,000.00	2,049,678.54
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-34/11/25	360,000.00	359,252.64
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	1,425,000.00	1,639,177.50
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	2,145,000.00	1,764,770.86

FRANCE (GOVT OF) -1.25%-38/05/25	290,000.00	227,854.45
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	1,500,000.00	1,627,077.00
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-39/06/25	1,810,000.00	1,503,223.10
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	2,780,000.00	3,189,021.40
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-43/05/25	165,000.00	145,193.23
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-44/06/25	1,050,000.00	626,537.10
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	1,230,000.00	1,205,087.58
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-48/05/25	1,380,000.00	1,064,174.58
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-49/06/25	348,000.00	323,041.44
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-50/05/25	1,790,000.00	1,201,372.82
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-52/05/25	1,500,000.00	788,935.50
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-53/05/25	1,320,000.00	677,919.00
FRANCE (GOVT OF) -3.0%-54/05/25	850,000.00	766,155.15
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	1,130,000.00	1,222,254.33
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-55/05/25	400,000.00	376,706.40
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	970,000.00	1,053,719.73
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-66/05/25	945,000.00	594,646.92
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	505,000.00	497,078.57
IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15	327,000.00	312,985.10
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	355,000.00	341,657.68
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	413,000.00	394,270.45
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	424,000.00	427,475.10
IRISH TREASURY-0.2%-30/10/18	282,000.00	250,573.92
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	335,000.00	316,958.91
IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	405,000.00	345,747.28
IRISH TREASURY-0.35%-32/10/18	205,000.00	175,863.55
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	238,000.00	218,091.06
IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	250,000.00	201,331.75
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	325,000.00	292,771.70
IRISH TREASURY-0.55%-41/04/22	185,000.00	132,379.52
IRISH TREASURY-3.0%-43/10/18	170,000.00	177,508.39
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	475,000.00	420,570.70
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	411,000.00	318,711.59
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-26/01/15	455,000.00	444,642.38
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	730,000.00	712,349.33
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	635,000.00	608,851.33
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	760,000.00	735,404.88
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	550,000.00	604,926.85
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	791,000.00	753,828.53
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	660,000.00	605,000.22
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	595,000.00	545,393.06
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-30/01/15	395,000.00	400,288.26
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-30/07/15	670,000.00	592,564.08

NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-31/07/15	650,000.00	561,005.25	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-32/07/15	560,000.00	489,443.92	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	697,000.00	704,126.12	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/07/15	465,000.00	468,443.79	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-34/07/15	290,000.00	290,934.96	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	855,000.00	981,722.97	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-38/01/15	395,000.00	281,945.86	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	713,000.00	529,088.06	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	902,000.00	1,039,598.29	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-44/01/15	220,000.00	240,654.92	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	844,000.00	866,937.38	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	907,000.00	463,964.05	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-54/01/15	539,000.00	475,332.24	
OBRIGACOES DO TESOURO-2.875%-26/07/21	400,000.00	404,868.40	
OBRIGACOES DO TESOURO-4.125%-27/04/14	200,000.00	209,663.80	
OBRIGACOES DO TESOURO-0.7%-27/10/15	490,000.00	472,391.85	
OBRIGACOES DO TESOURO-2.125%-28/10/17	670,000.00	670,758.44	
OBRIGACOES DO TESOURO-1.95%-29/06/15	550,000.00	545,403.10	
OBRIGACOES DO TESOURO-3.875%-30/02/15	480,000.00	519,158.40	
OBRIGACOES DO TESOURO-0.475%-30/10/18	250,000.00	226,188.50	
OBRIGACOES DO TESOURO-0.3%-31/10/17	370,000.00	322,687.73	
OBRIGACOES DO TESOURO-1.65%-32/07/16	300,000.00	283,860.00	
OBRIGACOES DO TESOURO-2.25%-34/04/18	570,000.00	553,401.60	
OBRIGACOES DO TESOURO-0.9%-35/10/12	250,000.00	207,201.75	
OBRIGACOES DO TESOURO-4.1%-37/04/15	600,000.00	677,788.80	
OBRIGACOES DO TESOURO-1.15%-42/04/11	310,000.00	231,156.15	
OBRIGACOES DO TESOURO-4.1%-45/02/15	350,000.00	399,212.45	
OBRIGACOES DO TESOURO-1.0%-52/04/12	350,000.00	214,311.65	
OBRIGACOES DO TESOURO-3.625%-54/06/12	25,000.00	26,691.12	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.7%-71/04/20	180,000.00	86,771.88	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	173,000.00	110,716.54	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	328,000.00	259,980.67	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.85%-99/99/99	192,000.00	85,653.69	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	471,000.00	486,155.83	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.0%-26/07/15	170,000.00	169,609.68	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	738,000.00	720,067.33	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	659,514.57	
REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	487,000.00	536,245.44	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	660,000.00	630,822.72	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-28/10/20	382,000.00	350,692.04	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	715,000.00	664,874.21	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-29/05/23	225,000.00	230,729.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.5%-29/10/20	67,000.00	67,545.44	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	680,000.00	602,639.12
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.45%-30/10/20	155,000.00	163,658.30
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-31/02/20	745,000.00	641,975.44
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.9%-32/02/20	610,000.00	546,224.50
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-33/02/20	715,000.00	732,585.42
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-34/02/20	30,000.00	30,668.55
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	455,000.00	446,885.07
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-36/10/20	270,000.00	201,879.81
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	650,000.00	742,159.60
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-39/07/15	128,000.00	133,232.50
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	320,000.00	205,327.67
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	394,000.00	407,975.18
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	473,000.00	367,686.07
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.85%-49/05/23	288,000.00	237,551.04
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	455,000.00	279,828.64
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-53/10/20	206,000.00	214,182.32
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	180,000.00	216,258.48
ユーロ小計			317,929,000.00	303,910,621.42 (49,206,168,714)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	760,000.00	323,200.64
		UK TREASURY-1.125%-73/10/22	513,000.00	177,244.57
		UK TREASURY-0.125%-26/01/30	710,000.00	681,211.63
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	820,000.00	787,063.06
		UK TREASURY-0.375%-26/10/22	1,180,000.00	1,103,145.42
		UK TREASURY-4.125%-27/01/29	1,495,000.00	1,490,244.40
		UK TREASURY-3.75%-27/03/07	1,323,000.00	1,307,317.15
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	655,000.00	609,853.47
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	850,000.00	854,443.80
		UK TREASURY-0.125%-28/01/31	745,000.00	661,925.05
		UK TREASURY-4.375%-28/03/07	115,000.00	115,359.37
		UK TREASURY-4.5%-28/06/07	1,385,000.00	1,397,487.16
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	720,000.00	659,050.56
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	710,000.00	760,135.94
		UK TREASURY-0.5%-29/01/31	1,180,000.00	1,020,907.68
		UK TREASURY-4.125%-29/07/22	1,060,000.00	1,055,373.09
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	736,000.00	634,395.93
		UK TREASURY-0.375%-30/10/22	870,000.00	704,475.54
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	945,000.00	975,171.96
		UK TREASURY-0.25%-31/07/31	1,245,000.00	967,988.74
		UK TREASURY-4.0%-31/10/22	760,000.00	747,800.48
		UK TREASURY-1.0%-32/01/31	1,585,000.00	1,274,832.93
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,030,000.00	1,031,415.22
		UK TREASURY-3.25%-33/01/31	1,490,000.00	1,380,058.86

		UK TREASURY-0.875%-33/07/31	1,270,000.00	957,310.76	
		UK TREASURY-4.625%-34/01/31	1,123,000.00	1,142,415.54	
		UK TREASURY-4.25%-34/07/31	650,000.00	642,366.40	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	789,000.00	796,424.49	
		UK TREASURY-0.625%-35/07/31	967,000.00	658,013.52	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	970,000.00	949,396.23	
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,010,000.00	739,591.69	
		UK TREASURY-3.75%-38/01/29	710,000.00	652,261.38	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	985,000.00	996,832.80	
		UK TREASURY-1.125%-39/01/31	747,000.00	478,968.93	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	850,000.00	811,251.90	
		UK TREASURY-4.375%-40/01/31	90,000.00	86,722.83	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	815,000.00	770,120.39	
		UK TREASURY-1.25%-41/10/22	1,280,000.00	767,150.08	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,040,000.00	1,000,434.24	
		UK TREASURY-4.75%-43/10/22	260,000.00	256,221.68	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,115,000.00	890,559.42	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	980,000.00	805,615.86	
		UK TREASURY-0.875%-46/01/31	435,000.00	207,583.74	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	720,000.00	654,344.64	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	885,000.00	478,056.64	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	675,000.00	376,937.55	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	895,000.00	806,496.13	
		UK TREASURY-0.625%-50/10/22	770,000.00	296,041.90	
		UK TREASURY-1.25%-51/07/31	600,000.00	276,592.80	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	872,000.00	715,278.05	
		UK TREASURY-1.5%-53/07/31	580,000.00	278,345.48	
		UK TREASURY-3.75%-53/10/22	1,170,000.00	954,483.66	
		UK TREASURY-4.375%-54/07/31	350,000.00	318,477.95	
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	925,000.00	454,510.77	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	962,000.00	858,010.68	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	533,058.10	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	751,000.00	638,853.92	
		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	1,050,000.00	301,623.00	
		UK TREASURY-4.0%-63/10/22	440,000.00	371,491.12	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	765,000.00	579,562.47	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	742,000.00	435,198.58	
英債券小計			53,195,000.00	43,656,707.97 (8,489,046,864)	
スウェーデン ローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	3,680,000.00	3,620,034.40	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,300,000.00	3,176,926.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	3,330,000.00	3,145,484.70	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	2,700,000.00	2,397,033.00	

		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,800,000.00	1,824,345.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.75%-33/11/11	1,730,000.00	1,680,063.55	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-35/05/11	950,000.00	956,728.85	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	2,220,000.00	2,535,351.00	
スウェーデンコロナ小計			19,710,000.00	19,335,967.00	(271,670,336)
ノルウェークロネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,400,000.00	2,329,375.20	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,200,000.00	2,102,210.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	1,820,000.00	1,718,713.36	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	1,930,000.00	1,767,729.46	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	2,685,000.00	2,371,091.28	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.25%-31/09/17	2,040,000.00	1,747,158.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.125%-32/05/18	2,030,000.00	1,825,932.22	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-33/08/15	2,350,000.00	2,225,934.10	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.625%-34/04/13	1,100,000.00	1,092,349.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.5%-42/10/06	990,000.00	963,795.69	
ノルウェークロネ小計			19,545,000.00	18,144,288.81	(250,754,071)
デンマーククロネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-2.25%-26/11/15	1,170,000.00	1,181,979.63	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	2,380,000.00	2,300,079.60	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	2,290,000.00	2,153,747.29	
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-31/11/15	1,450,000.00	1,280,986.55	
		KINGDOM OF DENMARK-2.25%-33/11/15	700,000.00	717,436.30	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	6,495,000.00	8,410,518.39	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	1,750,000.00	1,063,727.00	
デンマーククロネ小計			16,235,000.00	17,108,474.76	(371,424,987)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-26/04/25	670,000.00	628,828.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	1,870,000.00	1,799,290.62	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,600,000.00	1,467,000.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-27/01/25	200,000.00	180,371.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	1,310,000.00	1,270,290.62	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	1,790,000.00	1,677,006.25	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	1,860,000.00	1,721,081.25	
		POLAND GOVERNMENT BOND-7.5%-28/07/25	1,720,000.00	1,841,475.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	2,075,000.00	2,103,128.70	
		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	2,277,239.06	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-30/01/25	500,000.00	488,906.25	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	2,025,000.00	1,600,382.81	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-32/04/25	2,090,000.00	1,606,687.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.0%-33/10/25	2,145,000.00	2,180,526.56	
POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-34/10/25	1,000,000.00	941,250.00			
			24,690,000.00	23,018,142.24	



ポーランドズロチ小計				(874,268,173)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	900,000.00	903,078.00
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,090,000.00	1,027,499.40
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,080,000.00	1,101,232.80
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	830,000.00	805,149.80
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	795,000.00	754,717.35
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	765,000.00	734,461.20
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	960,000.00	936,096.00
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	890,000.00	843,889.10
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,005,000.00	933,735.45
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	930,000.00	781,032.60
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,083,000.00	925,163.58
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,385,000.00	1,127,500.80
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,250,000.00	1,020,087.50
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	1,095,000.00	915,671.85
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,060,000.00	1,081,814.80
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-33/11/21	1,010,000.00	916,968.90
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-34/05/21	960,000.00	921,676.80
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-34/06/21	200,000.00	199,774.00
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.5%-34/12/21	855,000.00	800,527.95
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	700,000.00	608,055.00
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-35/12/21	360,000.00	357,501.60
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	550,000.00	517,044.00
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	522,000.00	453,753.72
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	710,000.00	559,948.60
AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	675,000.00	514,167.75		
AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	870,000.00	475,133.10		
AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-54/06/21	325,000.00	324,025.00		
豪ドル小計		22,855,000.00	20,539,706.65	(2,013,507,442)
ニュー ジーラン ドドル	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.5%-26/05/15	335,000.00	320,109.92
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-27/04/15	700,000.00	711,454.10
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.25%-28/05/15	495,000.00	438,973.42
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.0%-29/04/20	680,000.00	655,436.36
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-30/05/15	430,000.00	439,574.81
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.5%-31/05/15	350,000.00	297,590.30
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.0%-32/05/15	325,000.00	277,980.62
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.5%-33/04/14	430,000.00	404,194.41
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.25%-34/05/15	220,000.00	216,969.72
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-35/05/15	325,000.00	324,503.40
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-37/04/15	430,000.00	352,662.35
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.75%-41/05/15	225,000.00	145,762.65
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-51/05/15	500,000.00	334,038.00

		NEW ZEALAND GOVERNMENT-5.0%-54/05/15	170,000.00	168,258.69	
ニュージーランドドル小計			5,615,000.00	5,087,508.75 (451,821,652)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-72/08/01	262,000.00	280,995.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	420,000.00	416,010.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-26/11/01	365,000.00	354,973.45	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	446,000.00	453,269.80	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-27/09/01	150,000.00	150,630.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	347,000.00	345,959.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-28/08/01	100,000.00	100,520.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-29/04/01	131,000.00	132,585.10	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	365,000.00	367,478.35	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	440,000.00	443,300.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-31/07/01	300,000.00	279,900.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-32/08/01	170,000.00	168,317.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	335,000.00	350,477.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	391,000.00	371,254.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	206,000.00	196,015.18	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	280,000.00	280,000.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	387,000.00	386,529.79	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	342,000.00	289,160.65	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-51/10/01	222,000.00	185,592.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-54/06/01	97,000.00	107,425.07	
シンガポールドル小計			5,756,000.00	5,660,391.89 (646,303,546)	
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	830,000.00	836,930.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	920,000.00	929,108.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,200,000.00	1,213,200.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.519%-28/04/20	350,000.00	349,650.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.504%-29/04/30	350,000.00	362,687.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,320,000.00	1,334,322.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	985,000.00	922,698.75	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.582%-32/07/15	100,000.00	98,697.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	742,525.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,000,000.00	1,001,100.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	760,000.00	789,640.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,320,000.00	1,426,920.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	1,080,000.00	1,183,950.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.054%-39/04/18	200,000.00	202,330.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	1,490,000.00	1,452,005.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.696%-42/10/15	750,000.00	812,250.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	660,000.00	734,675.70	
MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	620,000.00	675,601.60			

		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	510,000.00	570,435.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	1,410,000.00	1,392,121.20	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.457%-53/03/31	760,000.00	794,580.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	540,000.00	547,383.96	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	950,617.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,410,000.00	1,416,486.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,150,000.00	1,196,455.40	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,063,629.13	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	1,010,000.00	1,011,951.32	
マレーシアリングット小計			23,410,000.00	24,011,950.56 (830,112,340)	
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-3.22%-25/12/06	18,800,000.00	19,182,956.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.46%-26/02/15	10,900,000.00	11,057,630.35	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	17,000,000.00	17,401,727.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.3%-26/05/15	16,000,000.00	16,239,736.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-26/06/06	19,800,000.00	20,408,652.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	16,000,000.00	16,381,408.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-26/08/15	32,000,000.00	32,480,272.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.39%-26/11/15	24,500,000.00	25,026,580.95	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-26/12/05	23,000,000.00	23,885,661.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-27/01/20	10,000,000.00	10,231,175.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.04%-27/02/25	14,000,000.00	14,237,314.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.85%-27/05/15	11,700,000.00	11,866,777.65	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	24,000,000.00	24,946,656.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	16,000,000.00	16,498,032.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.62%-27/08/15	4,100,000.00	4,139,909.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.44%-27/10/15	9,100,000.00	9,397,165.05	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.28%-27/12/03	19,500,000.00	20,685,795.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.64%-28/01/15	10,000,000.00	10,392,585.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-28/04/15	11,000,000.00	11,447,952.45	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	13,000,000.00	13,728,039.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.4%-28/07/15	10,900,000.00	11,284,155.24	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.48%-28/09/25	3,000,000.00	3,117,760.20	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	22,000,000.00	23,244,298.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.55%-28/10/15	10,000,000.00	10,428,131.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-28/11/22	10,000,000.00	10,721,690.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-29/01/15	7,500,000.00	7,782,058.87	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-29/03/24	15,000,000.00	15,834,595.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.05%-29/04/15	10,000,000.00	10,262,589.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-29/05/23	14,000,000.00	15,177,260.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-29/06/15	5,200,000.00	5,492,652.88	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.91%-29/07/15	10,700,000.00	10,926,336.03	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-29/09/25	20,200,000.00	21,267,490.21	

		CHINA GOVERNMENT BOND-1.74%-29/10/15	3,000,000.00	3,043,582.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.13%-29/11/21	11,900,000.00	12,870,218.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.79%-29/12/15	5,000,000.00	5,315,260.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-30/03/25	15,000,000.00	15,972,780.75	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	17,900,000.00	18,951,839.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-30/06/25	9,800,000.00	10,350,515.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-30/09/15	21,100,000.00	22,296,131.57	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	11,000,000.00	12,101,188.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.54%-30/12/25	8,400,000.00	8,843,184.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-31/03/25	13,000,000.00	13,488,982.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	10,000,000.00	10,861,040.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.12%-31/06/25	16,000,000.00	16,465,780.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.87%-31/09/15	6,800,000.00	6,898,946.12	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.89%-31/11/18	8,000,000.00	8,658,036.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	8,800,000.00	9,435,857.20	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.76%-32/05/15	9,000,000.00	9,655,542.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-32/08/15	9,000,000.00	9,618,250.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-32/09/01	7,400,000.00	7,857,505.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-32/11/15	6,000,000.00	6,472,895.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-33/02/25	11,000,000.00	11,954,166.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/05/25	12,000,000.00	12,843,360.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.52%-33/08/25	12,800,000.00	13,570,172.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/11/25	19,700,000.00	21,151,796.42	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.35%-34/02/25	15,000,000.00	15,713,559.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.27%-34/05/25	13,000,000.00	13,557,681.15	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.11%-34/08/25	11,000,000.00	11,325,458.65	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	19,800,000.00	26,697,052.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	10,000,000.00	13,348,540.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.53%-51/10/18	8,200,000.00	10,675,940.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.32%-52/04/15	10,000,000.00	12,622,320.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-52/10/25	8,000,000.00	9,764,692.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-53/04/15	9,000,000.00	11,174,244.75	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.0%-53/10/15	9,900,000.00	11,957,435.82	
	中国元小計		825,400,000.00	880,688,996.91 (18,628,950,144)	
イスラエル エルシュケ ル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-0.5%-26/02/27	1,080,000.00	1,033,434.34	
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	950,000.00	984,363.50	
		ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,270,000.00	1,209,781.47	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-27/09/30	670,000.00	661,979.68	
		ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,160,000.00	1,082,186.17	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-29/02/28	1,260,000.00	1,239,254.04	
		ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	1,645,000.00	1,399,042.06	
		ISRAEL FIXED BOND-1.3%-32/04/30	1,360,000.00	1,106,359.45	

	ISRAEL FIXED BOND-4.0%-35/03/30	600,000.00	582,150.41	
	ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	1,150,000.00	828,917.29	
	ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,160,000.00	1,287,261.91	
	ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,300,000.00	1,135,621.76	
	ISRAEL FIXED BOND-2.8%-52/11/29	640,000.00	445,539.91	
イスラエルシェケル小計		14,245,000.00	12,995,891.99 (555,315,764)	
合計			163,745,219,879 (163,745,219,879)	

(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 220銘柄	100.0%	46.8%
加ドル	国債証券 40銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 389銘柄	100.0%	30.1%
英ポンド	国債証券 61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 7銘柄	100.0%	0.2%
ポーランドズロチ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.2%
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 20銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 27銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券 65銘柄	100.0%	11.4%
イスラエルシェケル	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。

#### 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

#### 貸借対照表

（単位：円）

	2024年 6月17日現在	2024年12月16日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	299,696,528	139,404,760
株式	58,888,845,740	62,839,247,968
派生商品評価勘定	-	136,350
未収入金	-	80,711,370
未収配当金	404,352,660	8,762,145
未収利息	676	895
前払金	2,920,000	-
流動資産合計	59,595,815,604	63,068,263,488
資産合計	59,595,815,604	63,068,263,488

2024年 6月17日現在

2024年12月16日現在

負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	13,541,000	-
前受金	-	160,000
未払金	165,983,820	-
未払解約金	11,544,635	89,321,221
流動負債合計	191,069,455	89,481,221
負債合計	191,069,455	89,481,221
純資産の部		
元本等		
元本	21,236,631,163	21,946,246,284
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	38,168,114,986	41,032,535,983
元本等合計	59,404,746,149	62,978,782,267
純資産合計	59,404,746,149	62,978,782,267
負債純資産合計	59,595,815,604	63,068,263,488

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

		2024年 6月17日現在	2024年12月16日現在
1.	期首	2023年12月16日	2024年 6月18日
	期首元本額	21,959,599,100円	21,236,631,163円
	期首からの追加設定元本額	976,898,370円	1,919,505,314円
	期首からの一部解約元本額	1,699,866,307円	1,209,890,193円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス（株式20）	681,338,410円	714,563,950円
	DCインデックスバランス（株式40）	1,947,507,760円	2,034,408,659円
	DCインデックスバランス（株式60）	4,392,023,539円	4,630,578,748円
	DCインデックスバランス（株式80）	5,655,513,527円	6,002,261,078円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,844,251,733円	1,910,645,676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	2,280,029,201円	2,235,224,002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）	421,039,181円	433,981,686円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	1,798,631円	2,944,138円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	992,874円	1,465,541円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	446,332円	616,652円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,438,069,127円	1,355,654,178円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	179,330,306円	178,264,812円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	546,561,944円	559,451,305円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	901,570,726円	925,097,598円

		2024年 6月17日現在	2024年12月16日現在
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	946,157,872円	961,088,261円
	計	21,236,631,163円	21,946,246,284円
2.	受益権の総数	21,236,631,163口	21,946,246,284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	871,785,000円	757,897,000円

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

	自 2023年12月16日 至 2024年 6月17日	自 2024年 6月18日 至 2024年12月16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

	2024年 6月17日現在	2024年12月16日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、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)

(2024年 6月17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	10,046,091,178
合計	10,046,091,178

(2024年12月16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	1,815,284,027
合計	1,815,284,027

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2024年 6月17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	552,230,000	-	538,700,000	13,530,000
合計		552,230,000	-	538,700,000	13,530,000

(2024年12月16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	136,960,900	-	137,100,000	139,100
合計		136,960,900	-	137,100,000	139,100

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2024年 6月17日現在		2024年12月16日現在	
1口当たり純資産額	2.7973円	1口当たり純資産額	2.8697円
(1万口当たり純資産額)	(27,973円)	(1万口当たり純資産額)	(28,697円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	900	4,020.00	3,618,000	
ニッスイ	22,500	901.60	20,286,000	
マルハニチロ	3,300	2,949.00	9,731,700	
雪国まいたけ	2,000	1,020.00	2,040,000	
カネコ種苗	700	1,415.00	990,500	
サカタのタネ	2,500	3,415.00	8,537,500	



ホクト	2,000	1,812.00	3,624,000
住石ホールディングス	2,500	794.00	1,985,000
日鉄鉱業	900	4,305.00	3,874,500
I N P E X	67,900	1,956.00	132,812,400
石油資源開発	12,300	1,095.00	13,468,500
K & O エナジーグループ	1,000	3,065.00	3,065,000
ショーボンドホールディングス	3,000	5,257.00	15,771,000
ミライト・ワン	7,300	2,256.00	16,468,800
タマホーム	1,400	3,445.00	4,823,000
日本アクア	200	780.00	156,000
キャンディル	100	567.00	56,700
ダイセキ環境ソリューション	100	1,279.00	127,900
第一カッター興業	700	1,463.00	1,024,100
安藤・間	13,000	1,191.00	15,483,000
東急建設	7,000	707.00	4,949,000
コムシスホールディングス	8,000	3,290.00	26,320,000
ピーアールホールディングス	3,300	335.00	1,105,500
高松コンストラクショングループ	1,700	2,682.00	4,559,400
東建コーポレーション	600	11,470.00	6,882,000
ヤマウラ	1,100	1,183.00	1,301,300
オリエンタル白石	8,300	390.00	3,237,000
大成建設	14,300	6,668.00	95,352,400
大林組	51,800	2,074.00	107,433,200
清水建設	44,500	1,229.00	54,690,500
長谷工コーポレーション	14,400	2,028.50	29,210,400
松井建設	1,500	900.00	1,350,000
鹿島建設	34,800	2,782.50	96,831,000
不動テトラ	1,000	2,057.00	2,057,000
鉄建建設	1,000	2,251.00	2,251,000
西松建設	2,500	5,206.00	13,015,000
三井住友建設	12,600	416.00	5,241,600
大豊建設	400	3,330.00	1,332,000
奥村組	2,800	3,810.00	10,668,000
東鉄工業	1,700	3,185.00	5,414,500
イチケン	100	2,530.00	253,000
浅沼組	6,300	625.00	3,937,500
戸田建設	19,300	926.70	17,885,310
熊谷組	2,600	3,995.00	10,387,000
植木組	100	1,540.00	154,000
矢作建設工業	2,100	1,547.00	3,248,700
ピーエス・コンストラクション	1,200	1,089.00	1,306,800
日本ハウスホールディングス	3,400	329.00	1,118,600

新日本建設	2,200	1,465.00	3,223,000
東亜道路工業	2,700	1,283.00	3,464,100
日本道路	1,600	1,779.00	2,846,400
東亜建設工業	4,700	1,163.00	5,466,100
日本国土開発	4,400	519.00	2,283,600
若築建設	500	3,955.00	1,977,500
東洋建設	4,500	1,291.00	5,809,500
五洋建設	20,600	624.40	12,862,640
世紀東急工業	2,200	1,494.00	3,286,800
福田組	600	5,200.00	3,120,000
住友林業	13,600	5,600.00	76,160,000
巴コーポレーション	300	925.00	277,500
大和ハウス工業	47,400	4,750.00	225,150,000
ライト工業	3,200	2,239.00	7,164,800
積水ハウス	47,600	3,693.00	175,786,800
日特建設	1,500	989.00	1,483,500
北陸電気工事	1,100	1,120.00	1,232,000
ユアテック	3,000	1,439.00	4,317,000
日本リーテック	1,200	1,122.00	1,346,400
四電工	2,000	1,533.00	3,066,000
中電工	2,400	3,340.00	8,016,000
関電工	8,600	2,330.00	20,038,000
きんでん	10,900	3,095.00	33,735,500
東京エネシス	1,700	1,045.00	1,776,500
トーエネック	2,600	955.00	2,483,000
住友電設	1,300	4,800.00	6,240,000
日本電設工業	2,900	2,016.00	5,846,400
エクシオグループ	16,600	1,747.00	29,000,200
新日本空調	1,000	3,905.00	3,905,000
九電工	3,400	5,165.00	17,561,000
三機工業	3,300	3,140.00	10,362,000
日揮ホールディングス	15,500	1,285.00	19,917,500
中外炉工業	500	3,460.00	1,730,000
ヤマト	300	1,226.00	367,800
太平電業	1,000	5,000.00	5,000,000
高砂熱学工業	3,800	6,177.00	23,472,600
朝日工業社	1,400	2,102.00	2,942,800
明星工業	2,700	1,411.00	3,809,700
大気社	2,000	4,700.00	9,400,000
ダイダン	2,100	3,820.00	8,022,000
日比谷総合設備	1,300	3,765.00	4,894,500
飛島ホールディングス	1,600	1,577.00	2,523,200

テスホールディングス	3,400	268.00	911,200
インフロニア・ホールディングス	16,400	1,174.00	19,253,600
東洋エンジニアリング	2,300	703.00	1,616,900
レイズネクスト	2,300	1,603.00	3,686,900
ニッポン	5,200	2,147.00	11,164,400
日清製粉グループ本社	16,400	1,875.00	30,750,000
日東富士製粉	300	6,530.00	1,959,000
昭和産業	1,300	2,775.00	3,607,500
中部飼料	2,200	1,309.00	2,879,800
フィード・ワン	2,300	778.00	1,789,400
東洋精糖	100	1,448.00	144,800
日本甜菜製糖	800	2,332.00	1,865,600
D M三井製糖ホールディングス	1,600	3,400.00	5,440,000
塩水港精糖	500	317.00	158,500
ウェルネオシュガー	900	2,149.00	1,934,100
森永製菓	6,600	2,793.50	18,437,100
中村屋	400	3,180.00	1,272,000
江崎グリコ	4,500	4,687.00	21,091,500
名糖産業	700	1,970.00	1,379,000
井村屋グループ	900	2,453.00	2,207,700
不二家	1,100	2,683.00	2,951,300
山崎製パン	10,600	3,004.00	31,842,400
モロゾフ	500	4,670.00	2,335,000
亀田製菓	1,000	4,095.00	4,095,000
寿スピリッツ	9,300	2,077.00	19,316,100
カルビー	7,200	3,263.00	23,493,600
森永乳業	6,100	2,899.50	17,686,950
六甲バター	1,100	1,362.00	1,498,200
ヤクルト本社	22,600	3,075.00	69,495,000
明治ホールディングス	21,100	3,209.00	67,709,900
雪印メグミルク	4,200	2,795.00	11,739,000
プリマハム	2,100	2,229.00	4,680,900
日本ハム	6,800	5,077.00	34,523,600
林兼産業	200	460.00	92,000
丸大食品	1,600	1,678.00	2,684,800
S Foods	1,700	2,699.00	4,588,300
柿安本店	600	2,814.00	1,688,400
伊藤ハム米久ホールディングス	2,400	3,905.00	9,372,000
サッポロホールディングス	5,200	8,936.00	46,467,200
アサヒグループホールディングス	118,500	1,660.00	196,710,000
キリンホールディングス	65,700	2,100.00	137,970,000
シマダヤ	600	1,407.00	844,200

宝ホールディングス	10,600	1,325.00	14,045,000
オエノンホールディングス	5,100	404.00	2,060,400
養命酒製造	500	2,518.00	1,259,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,100	2,475.50	27,478,050
ライフドリンク カンパニー	3,400	2,259.00	7,680,600
サントリー食品インターナショナル	11,100	5,004.00	55,544,400
ダイドーグループホールディングス	1,800	3,375.00	6,075,000
伊藤園	5,300	3,677.00	19,488,100
キーコーヒー	1,800	2,042.00	3,675,600
ユニカフェ	200	950.00	190,000
日清オイリオグループ	2,200	5,130.00	11,286,000
不二製油グループ本社	3,100	3,674.00	11,389,400
J - オイルミルズ	1,800	2,169.00	3,904,200
キッコーマン	52,300	1,740.50	91,028,150
味の素	36,500	6,519.00	237,943,500
ブルドックソース	800	1,844.00	1,475,200
キューピー	8,500	3,476.00	29,546,000
ハウス食品グループ本社	5,300	2,860.00	15,158,000
カゴメ	6,800	2,996.00	20,372,800
アリアケジャパン	1,600	5,550.00	8,880,000
エバラ食品工業	400	2,881.00	1,152,400
ニチレイ	6,400	4,222.00	27,020,800
東洋水産	7,300	10,535.00	76,905,500
イトアンドホールディングス	800	2,185.00	1,748,000
大冷	100	1,901.00	190,100
ヨシムラ・フード・ホールディングス	900	1,304.00	1,173,600
日清食品ホールディングス	20,300	3,879.00	78,743,700
フジッコ	1,600	1,707.00	2,731,200
ロック・フィールド	1,900	1,520.00	2,888,000
日本たばこ産業	95,800	4,170.00	399,486,000
ケンコーマヨネーズ	1,000	2,128.00	2,128,000
わらべや日洋ホールディングス	1,100	1,944.00	2,138,400
なとり	1,000	2,175.00	2,175,000
イフジ産業	100	1,622.00	162,200
ファーマフーズ	2,100	909.00	1,908,900
ユーグレナ	9,800	396.00	3,880,800
紀文食品	1,400	1,065.00	1,491,000
ピククルスホールディングス	1,000	1,021.00	1,021,000
理研ビタミン	1,400	2,441.00	3,417,400
片倉工業	1,500	1,917.00	2,875,500
ゲンゼ	1,100	5,320.00	5,852,000
東洋紡	7,000	951.00	6,657,000

ユニチカ	5,500	154.00	847,000
富士紡ホールディングス	600	5,510.00	3,306,000
倉敷紡績	1,100	5,410.00	5,951,000
シキボウ	1,200	1,005.00	1,206,000
日本毛織	4,200	1,289.00	5,413,800
ダイドーリミテッド	300	910.00	273,000
帝国繊維	1,800	2,386.00	4,294,800
帝人	15,400	1,312.00	20,204,800
東レ	117,300	1,016.50	119,235,450
SUMINOE	100	2,028.00	202,800
セーレン	3,100	2,797.00	8,670,700
小松マテーレ	2,400	780.00	1,872,000
ワコールホールディングス	3,300	5,393.00	17,796,900
ホギメディカル	2,200	4,800.00	10,560,000
クラウディアホールディングス	300	333.00	99,900
T S Iホールディングス	5,100	1,034.00	5,273,400
マツオカコーポレーション	100	1,974.00	197,400
ワールド	2,500	2,545.00	6,362,500
三陽商会	900	2,830.00	2,547,000
オンワードホールディングス	10,500	563.00	5,911,500
ルックホールディングス	500	2,493.00	1,246,500
ゴールドウイン	2,800	8,248.00	23,094,400
デサント	1,400	4,330.00	6,062,000
特種東海製紙	800	3,540.00	2,832,000
王子ホールディングス	60,500	611.00	36,965,500
日本製紙	8,300	850.00	7,055,000
三菱製紙	300	473.00	141,900
北越コーポレーション	9,000	1,488.00	13,392,000
中越パルプ工業	100	1,484.00	148,400
大王製紙	8,100	825.00	6,682,500
レンゴー	14,500	869.80	12,612,100
トモク	900	2,192.00	1,972,800
ザ・パック	1,200	3,535.00	4,242,000
北の達人コーポレーション	6,900	143.00	986,700
クラレ	23,400	2,283.00	53,422,200
旭化成	108,500	1,075.00	116,637,500
レゾナック・ホールディングス	14,400	4,148.00	59,731,200
住友化学	128,900	345.10	44,483,390
住友精化	700	4,690.00	3,283,000
日産化学	8,200	5,045.00	41,369,000
ラサ工業	600	2,750.00	1,650,000
クレハ	3,300	2,777.00	9,164,100

多木化学	600	3,480.00	2,088,000	
テイカ	1,200	1,598.00	1,917,600	
石原産業	2,700	1,484.00	4,006,800	
日本曹達	3,400	2,762.00	9,390,800	
東ソー	21,400	2,068.50	44,265,900	
トクヤマ	5,200	2,632.00	13,686,400	
セントラル硝子	2,000	3,220.00	6,440,000	
東亜合成	7,700	1,503.00	11,573,100	
大阪ソーダ	5,600	2,006.00	11,233,600	
関東電化工業	3,400	1,069.00	3,634,600	
デンカ	5,800	2,170.00	12,586,000	
信越化学工業	143,900	5,205.00	748,999,500	代用有価証券 24,000株
日本カーバイド工業	800	1,703.00	1,362,400	
堺化学工業	1,100	2,672.00	2,939,200	
第一稀元素化学工業	1,800	689.00	1,240,200	
エア・ウォーター	15,100	1,871.00	28,252,100	
日本酸素ホールディングス	15,600	4,392.00	68,515,200	
日本化学工業	600	2,350.00	1,410,000	
東邦アセチレン	500	373.00	186,500	
日本パーカラライジング	7,100	1,248.00	8,860,800	
高压ガス工業	2,300	796.00	1,830,800	
四国化成ホールディングス	1,800	2,114.00	3,805,200	
戸田工業	500	1,182.00	591,000	
ステラ ケミファ	900	4,055.00	3,649,500	
保土谷化学工業	500	3,735.00	1,867,500	
日本触媒	10,300	1,857.50	19,132,250	
大日精化工業	1,100	2,942.00	3,236,200	
カネカ	4,000	3,650.00	14,600,000	
三菱瓦斯化学	13,000	2,693.00	35,009,000	
三井化学	14,400	3,271.00	47,102,400	
東京応化工業	7,600	3,516.00	26,721,600	
大阪有機化学工業	1,300	2,743.00	3,565,900	
三菱ケミカルグループ	117,300	778.80	91,353,240	
KHネオケム	2,900	2,047.00	5,936,300	
ダイセル	18,200	1,370.00	24,934,000	
住友ベークライト	5,000	3,768.00	18,840,000	
積水化学工業	31,900	2,379.00	75,890,100	
日本ゼオン	12,400	1,449.50	17,973,800	
アイカ工業	4,000	3,223.00	12,892,000	
UBE	8,300	2,380.50	19,758,150	
積水樹脂	2,200	2,129.00	4,683,800	
旭有機材	1,100	4,470.00	4,917,000	

ニチバン	1,000	2,005.00	2,005,000
リケンテクノス	3,000	1,060.00	3,180,000
大倉工業	700	3,000.00	2,100,000
積水化成成品工業	2,600	357.00	928,200
群栄化学工業	400	2,615.00	1,046,000
タイガースポリマー	200	706.00	141,200
ダイキョーニシカワ	3,500	609.00	2,131,500
森六ホールディングス	900	1,983.00	1,784,700
恵和	1,100	999.00	1,098,900
日本化薬	11,200	1,279.50	14,330,400
カーリット	1,600	1,286.00	2,057,600
日本精化	1,100	2,363.00	2,599,300
扶桑化学工業	1,500	3,465.00	5,197,500
トリケミカル研究所	1,700	2,752.00	4,678,400
A D E K A	5,600	2,790.00	15,624,000
日油	18,900	2,200.00	41,580,000
ハリマ化成グループ	1,300	874.00	1,136,200
花王	39,100	6,570.00	256,887,000
第一工業製薬	600	3,970.00	2,382,000
石原ケミカル	700	2,408.00	1,685,600
三洋化成工業	1,000	4,075.00	4,075,000
大日本塗料	1,800	1,156.00	2,080,800
日本ペイントホールディングス	71,000	1,059.00	75,189,000
関西ペイント	13,400	2,162.00	28,970,800
中国塗料	3,600	2,378.00	8,560,800
日本特殊塗料	200	1,245.00	249,000
藤倉化成	2,100	519.00	1,089,900
太陽ホールディングス	2,800	3,955.00	11,074,000
D I C	5,700	3,543.00	20,195,100
サカタインクス	3,600	1,636.00	5,889,600
a r t i e n c e	2,900	3,035.00	8,801,500
富士フイルムホールディングス	96,900	3,415.00	330,913,500
資生堂	33,500	2,746.00	91,991,000
ライオン	20,400	1,843.50	37,607,400
高砂香料工業	1,100	5,910.00	6,501,000
マンダム	3,200	1,299.00	4,156,800
ミルボン	2,600	3,495.00	9,087,000
コーセー	3,300	6,868.00	22,664,400
コタ	1,600	1,610.00	2,576,000
ポーラ・オルビスホールディングス	8,200	1,452.50	11,910,500
ノエビアホールディングス	1,400	4,945.00	6,923,000
新日本製薬	900	1,955.00	1,759,500

I - n e	500	1,927.00	963,500
アクシージア	1,300	567.00	737,100
エステー	1,300	1,541.00	2,003,300
アグロ カネショウ	600	1,894.00	1,136,400
コニシ	5,100	1,300.00	6,630,000
長谷川香料	3,100	3,230.00	10,013,000
小林製薬	4,200	6,019.00	25,279,800
荒川化学工業	1,500	1,133.00	1,699,500
メック	1,300	3,230.00	4,199,000
日本高純度化学	400	3,145.00	1,258,000
タカラバイオ	5,000	1,015.00	5,075,000
J C U	1,800	3,905.00	7,029,000
O A Tアグリオ	700	2,068.00	1,447,600
デクセリアルズ	14,000	2,517.50	35,245,000
アース製薬	1,500	5,520.00	8,280,000
北興化学工業	1,400	1,315.00	1,841,000
大成ラミック	500	2,470.00	1,235,000
クミアイ化学工業	6,400	734.00	4,697,600
日本農薬	2,400	681.00	1,634,400
アキレス	900	1,455.00	1,309,500
有沢製作所	2,400	1,419.00	3,405,600
日東電工	50,800	2,516.50	127,838,200
レック	2,000	1,275.00	2,550,000
三光合成	2,100	589.00	1,236,900
Z A C R O S	1,300	4,145.00	5,388,500
前澤化成工業	1,100	1,740.00	1,914,000
未来工業	600	3,830.00	2,298,000
J S P	1,300	2,132.00	2,771,600
エフピコ	3,500	2,898.00	10,143,000
天馬	1,300	2,992.00	3,889,600
信越ポリマー	3,500	1,590.00	5,565,000
東リ	800	466.00	372,800
ニフコ	6,000	3,700.00	22,200,000
バルカー	1,200	3,215.00	3,858,000
ユニ・チャーム	33,500	3,888.00	130,248,000
協和キリン	18,900	2,385.00	45,076,500
武田薬品工業	142,900	4,108.00	587,033,200
アステラス製薬	140,900	1,527.00	215,154,300
住友ファーマ	14,300	608.00	8,694,400
塩野義製薬	53,300	2,176.00	115,980,800
日本新薬	4,200	4,185.00	17,577,000
中外製薬	50,300	6,769.00	340,480,700



科研製薬	2,800	4,291.00	12,014,800
エーザイ	21,300	4,348.00	92,612,400
ロート製薬	17,000	2,707.00	46,019,000
小野薬品工業	32,800	1,672.00	54,841,600
久光製薬	3,600	4,215.00	15,174,000
持田製薬	2,000	3,470.00	6,940,000
参天製薬	30,500	1,601.50	48,845,750
扶桑薬品工業	600	2,607.00	1,564,200
ツムラ	5,500	4,832.00	26,576,000
キッセイ薬品工業	2,700	3,530.00	9,531,000
生化学工業	3,000	800.00	2,400,000
栄研化学	2,500	2,186.00	5,465,000
鳥居薬品	900	4,540.00	4,086,000
JCRファーマ	5,400	636.00	3,434,400
東和薬品	2,200	2,777.00	6,109,400
富士製薬工業	1,200	1,548.00	1,857,600
ゼリア新薬工業	2,500	2,467.00	6,167,500
ネクセラファーマ	7,500	1,054.00	7,905,000
第一三共	151,600	4,254.00	644,906,400
杏林製薬	3,500	1,452.00	5,082,000
大幸薬品	3,700	325.00	1,202,500
ダイト	1,200	2,054.00	2,464,800
大塚ホールディングス	40,100	8,740.00	350,474,000
ペプチドリーム	7,800	2,580.50	20,127,900
セルソース	1,100	903.00	993,300
あすか製薬ホールディングス	1,500	2,070.00	3,105,000
サワイグループホールディングス	9,400	2,032.50	19,105,500
日本コークス工業	16,000	95.00	1,520,000
ニチレキグループ	1,700	2,451.00	4,166,700
ユシロ化学工業	800	2,182.00	1,745,600
ビービー・カストロール	200	892.00	178,400
富士石油	4,200	277.00	1,163,400
MORESCO	100	1,277.00	127,700
出光興産	75,000	1,026.00	76,950,000
ENEOSホールディングス	272,400	805.40	219,390,960
コスモエネルギーホールディングス	5,300	6,659.00	35,292,700
横浜ゴム	8,100	3,219.00	26,073,900
TOYO TIRE	9,200	2,450.50	22,544,600
ブリヂストン	47,000	5,320.00	250,040,000
住友ゴム工業	15,700	1,804.00	28,322,800
藤倉コンポジット	1,500	1,526.00	2,289,000
オカモト	900	5,730.00	5,157,000

フコク	1,000	1,728.00	1,728,000
ニッタ	1,600	3,755.00	6,008,000
住友理工	3,100	1,559.00	4,832,900
三ツ星ベルト	2,200	4,040.00	8,888,000
バンドー化学	2,400	1,840.00	4,416,000
日東紡績	1,800	6,190.00	11,142,000
A G C	15,600	4,648.00	72,508,800
日本板硝子	8,000	360.00	2,880,000
日本山村硝子	100	1,577.00	157,700
日本電気硝子	5,900	3,388.00	19,989,200
オハラ	800	1,095.00	876,000
住友大阪セメント	2,900	3,271.00	9,485,900
太平洋セメント	9,900	3,672.00	36,352,800
日本ヒューム	1,300	1,317.00	1,712,100
日本コンクリート工業	3,000	376.00	1,128,000
三谷セキサン	700	6,060.00	4,242,000
アジアパイルホールディングス	2,200	796.00	1,751,200
東海カーボン	14,800	910.70	13,478,360
日本カーボン	900	4,490.00	4,041,000
東洋炭素	1,100	4,285.00	4,713,500
ノリタケ	1,800	3,840.00	6,912,000
T O T O	11,600	3,949.00	45,808,400
日本碍子	18,600	1,961.50	36,483,900
日本特殊陶業	13,100	4,704.00	61,622,400
M A R U W A	700	46,060.00	32,242,000
品川リフラクトリーズ	1,900	1,685.00	3,201,500
黒崎播磨	1,100	2,415.00	2,656,500
ヨータイ	800	1,568.00	1,254,400
フジミインコーポレーテッド	4,300	2,408.00	10,354,400
ニチアス	4,000	5,844.00	23,376,000
ニチハ	2,000	2,910.00	5,820,000
日本製鉄	83,700	3,031.00	253,694,700
神戸製鋼所	33,200	1,505.00	49,966,000
中山製鋼所	3,400	730.00	2,482,000
合同製鐵	900	3,785.00	3,406,500
J F E ホールディングス	49,800	1,687.00	84,012,600
東京製鐵	4,600	1,488.00	6,844,800
共英製鋼	1,600	1,803.00	2,884,800
大和工業	3,100	7,500.00	23,250,000
東京鐵鋼	700	6,470.00	4,529,000
大阪製鐵	800	3,015.00	2,412,000
淀川製鋼所	1,500	5,470.00	8,205,000

中部鋼板	1,100	2,277.00	2,504,700
丸一鋼管	5,000	3,464.00	17,320,000
モリ工業	400	4,760.00	1,904,000
大同特殊鋼	10,400	1,123.00	11,679,200
日本高周波鋼業	200	353.00	70,600
日本冶金工業	1,100	3,800.00	4,180,000
山陽特殊製鋼	1,600	1,811.00	2,897,600
愛知製鋼	1,000	4,930.00	4,930,000
大太平洋金属	1,500	1,410.00	2,115,000
新日本電工	9,900	285.00	2,821,500
栗本鐵工所	800	4,045.00	3,236,000
三菱製鋼	1,200	1,402.00	1,682,400
日本精線	1,300	1,276.00	1,658,800
エンビプロ・ホールディングス	2,000	398.00	796,000
新家工業	100	4,805.00	480,500
大紀アルミニウム工業所	2,400	1,064.00	2,553,600
日本軽金属ホールディングス	4,900	1,508.00	7,389,200
三井金属鉱業	4,100	4,691.00	19,233,100
三菱マテリアル	11,800	2,350.50	27,735,900
住友金属鉱山	20,900	3,552.00	74,236,800
D O W Aホールディングス	4,500	4,506.00	20,277,000
古河機械金属	2,200	1,545.00	3,399,000
エス・サイエンス	6,500	22.00	143,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,900	1,662.00	4,819,800
東邦チタニウム	3,500	942.00	3,297,000
U A C J	2,300	5,400.00	12,420,000
C Kサンエツ	400	3,760.00	1,504,000
古河電気工業	5,500	7,015.00	38,582,500
住友電気工業	57,100	2,868.00	163,762,800
フジクラ	17,800	6,490.00	115,522,000
S W C C	2,200	7,740.00	17,028,000
カナレ電気	100	1,442.00	144,200
平河ヒューテック	1,100	1,535.00	1,688,500
リョービ	1,800	2,243.00	4,037,400
アーレスティ	500	534.00	267,000
A R Eホールディングス	6,800	1,705.00	11,594,000
稲葉製作所	900	1,714.00	1,542,600
宮地エンジニアリンググループ	2,000	1,914.00	3,828,000
トーカロ	4,800	1,897.00	9,105,600
S U M C O	31,400	1,136.00	35,670,400
川田テクノロジーズ	1,100	2,732.00	3,005,200
R S Technologies	1,300	3,310.00	4,303,000

信和	200	738.00	147,600
東洋製罐グループホールディングス	10,500	2,519.00	26,449,500
ホッカンホールディングス	900	1,666.00	1,499,400
コロナ	1,100	962.00	1,058,200
横河ブリッジホールディングス	2,800	2,820.00	7,896,000
三和ホールディングス	16,300	4,655.00	75,876,500
文化シャッター	4,300	1,852.00	7,963,600
三協立山	2,100	659.00	1,383,900
アルインコ	1,300	1,040.00	1,352,000
東洋シャッター	100	778.00	77,800
L I X I L	24,100	1,730.00	41,693,000
ノーリツ	2,300	1,683.00	3,870,900
長府製作所	1,900	1,862.00	3,537,800
リンナイ	8,800	3,197.00	28,133,600
日東精工	2,400	637.00	1,528,800
岡部	2,900	772.00	2,238,800
ジーテクト	1,800	1,634.00	2,941,200
東プレ	2,900	1,952.00	5,660,800
高周波熱錬	2,400	964.00	2,313,600
東京製綱	1,000	1,239.00	1,239,000
サンコール	2,300	280.00	644,000
パイオラックス	2,200	2,456.00	5,403,200
エイチワン	1,700	992.00	1,686,400
日本発條	14,600	1,838.00	26,834,800
中央発條	1,100	1,289.00	1,417,900
立川ブラインド工業	800	1,337.00	1,069,600
日本ドライケミカル	100	4,120.00	412,000
日本製鋼所	4,900	6,205.00	30,404,500
三浦工業	7,500	3,865.00	28,987,500
タクマ	5,500	1,663.00	9,146,500
ツガミ	3,500	1,382.00	4,837,000
オークマ	2,800	3,255.00	9,114,000
芝浦機械	2,100	3,540.00	7,434,000
アマダ	22,500	1,479.50	33,288,750
アイダエンジニアリング	3,600	798.00	2,872,800
F U J I	7,000	2,234.50	15,641,500
牧野フライス製作所	1,800	7,340.00	13,212,000
オーエスジー	7,200	1,760.50	12,675,600
旭ダイヤモンド工業	4,100	836.00	3,427,600
D M G 森精機	10,200	2,512.00	25,622,400
ソディック	4,300	738.00	3,173,400
ディスコ	7,800	41,190.00	321,282,000

日東工器	600	2,535.00	1,521,000
日進工具	1,400	736.00	1,030,400
富士ダイス	1,300	777.00	1,010,100
リケンNPR	2,000	2,571.00	5,142,000
島精機製作所	2,600	1,027.00	2,670,200
オプトラン	2,700	1,907.00	5,148,900
イワキポンプ	1,100	2,568.00	2,824,800
フリー	1,500	1,098.00	1,647,000
ヤマシンフィルタ	3,400	643.00	2,186,200
日阪製作所	2,000	1,078.00	2,156,000
やまびこ	2,700	2,632.00	7,106,400
野村マイクロ・サイエンス	2,700	1,585.00	4,279,500
平田機工	800	5,360.00	4,288,000
PEGASUS	2,100	436.00	915,600
マルマエ	700	1,461.00	1,022,700
タツモ	1,200	2,318.00	2,781,600
ナブテスコ	10,100	2,731.50	27,588,150
三井海洋開発	2,100	3,200.00	6,720,000
レオン自動機	1,700	1,455.00	2,473,500
SMC	4,800	62,820.00	301,536,000
ホソカワミクロン	1,100	4,310.00	4,741,000
ユニオンツール	700	5,060.00	3,542,000
瑞光	1,000	1,214.00	1,214,000
オイレス工業	2,200	2,486.00	5,469,200
日精エー・エス・ビー機械	600	5,160.00	3,096,000
サトーホールディングス	2,000	2,257.00	4,514,000
技研製作所	1,500	1,794.00	2,691,000
日本エアテック	800	1,197.00	957,600
日精樹脂工業	1,100	953.00	1,048,300
オカダアイヨン	100	1,870.00	187,000
ワイエイシイホールディングス	800	1,832.00	1,465,600
小松製作所	79,700	4,242.00	338,087,400
住友重機械工業	9,600	3,253.00	31,228,800
日立建機	6,400	3,511.00	22,470,400
日工	2,400	713.00	1,711,200
巴工業	600	3,930.00	2,358,000
井関農機	1,500	916.00	1,374,000
TOWA	5,000	1,468.00	7,340,000
北川鉄工所	800	1,183.00	946,400
ローツェ	8,500	1,533.00	13,030,500
タカキタ	200	377.00	75,400
クボタ	84,600	1,877.00	158,794,200

荏原実業	800	4,170.00	3,336,000
三菱化工機	600	3,415.00	2,049,000
月島ホールディングス	2,200	1,384.00	3,044,800
帝国電機製作所	1,100	2,742.00	3,016,200
新東工業	3,600	925.00	3,330,000
澁谷工業	1,500	3,725.00	5,587,500
アイチ コーポレーション	2,700	1,383.00	3,734,100
小森コーポレーション	4,000	1,191.00	4,764,000
鶴見製作所	1,200	3,270.00	3,924,000
酒井重工業	600	2,310.00	1,386,000
荏原製作所	33,200	2,420.00	80,344,000
西島製作所	1,400	2,371.00	3,319,400
北越工業	1,600	1,724.00	2,758,400
ダイキン工業	21,100	18,070.00	381,277,000
オルガノ	2,500	8,260.00	20,650,000
トーヨーカネツ	600	4,085.00	2,451,000
栗田工業	9,000	5,545.00	49,905,000
椿本チエイン	7,400	1,892.00	14,000,800
木村化工機	1,300	873.00	1,134,900
アネスト岩田	2,800	1,464.00	4,099,200
ダイフク	27,300	3,331.00	90,936,300
サムコ	400	2,767.00	1,106,800
加藤製作所	200	1,445.00	289,000
タダノ	9,300	1,139.00	10,592,700
フジテック	5,200	6,059.00	31,506,800
C K D	4,500	2,406.00	10,827,000
平和	5,400	2,121.00	11,453,400
理想科学工業	1,300	3,260.00	4,238,000
S A N K Y O	18,700	2,012.00	37,624,400
日本金銭機械	2,000	1,006.00	2,012,000
マースグループホールディングス	1,100	3,110.00	3,421,000
フクシマガリレイ	1,200	5,450.00	6,540,000
オーイズミ	200	326.00	65,200
ダイコク電機	700	2,910.00	2,037,000
竹内製作所	2,900	4,930.00	14,297,000
アマノ	4,600	4,303.00	19,793,800
J U K I	2,600	371.00	964,600
ジャノメ	1,400	987.00	1,381,800
マックス	2,000	3,425.00	6,850,000
グローリー	4,200	2,595.00	10,899,000
新晃工業	4,900	1,180.00	5,782,000
大和冷機工業	2,500	1,465.00	3,662,500

セガサミーホールディングス	14,400	2,619.00	37,713,600
T P R	2,100	2,393.00	5,025,300
ツバキ・ナカシマ	4,000	489.00	1,956,000
ホシザキ	10,400	6,363.00	66,175,200
大豊工業	1,600	598.00	956,800
日本精工	29,900	675.30	20,191,470
N T N	38,300	245.80	9,414,140
ジェイテクト	14,400	1,128.00	16,243,200
不二越	1,200	3,135.00	3,762,000
日本トムソン	4,400	501.00	2,204,400
T H K	9,300	3,646.00	33,907,800
ユーシン精機	1,600	667.00	1,067,200
前澤給装工業	1,200	1,308.00	1,569,600
イーグル工業	1,800	2,005.00	3,609,000
前澤工業	200	1,169.00	233,800
P I L L A R	1,500	4,245.00	6,367,500
キッツ	5,400	1,114.00	6,015,600
マキタ	20,100	4,782.00	96,118,200
三井E & S	8,700	1,653.00	14,381,100
カナデビア	13,300	925.00	12,302,500
三菱重工業	282,900	2,281.00	645,294,900
I H I	13,000	8,230.00	106,990,000
スター精密	2,700	1,873.00	5,057,100
日清紡ホールディングス	12,200	879.00	10,723,800
イビデン	9,300	4,127.00	38,381,100
コニカミノルタ	36,200	704.00	25,484,800
ブラザー工業	21,600	2,704.50	58,417,200
ミネベアミツミ	28,100	2,542.00	71,430,200
日立製作所	416,600	3,978.00	1,657,234,800
三菱電機	164,600	2,649.00	436,025,400
富士電機	9,800	8,743.00	85,681,400
安川電機	17,600	3,940.00	69,344,000
シンフォニアテクノロジー	1,600	6,450.00	10,320,000
明電舎	2,700	4,065.00	10,975,500
山洋電気	700	8,500.00	5,950,000
デンヨー	1,200	2,819.00	3,382,800
P H C ホールディングス	3,100	965.00	2,991,500
K O K U S A I E L E C T R I C	11,300	2,099.00	23,718,700
ソシオネクスト	16,100	2,817.00	45,353,700
東芝テック	2,400	3,780.00	9,072,000
芝浦メカトロニクス	1,200	7,880.00	9,456,000
マブチモーター	7,100	2,225.50	15,801,050

ニデック	71,400	2,798.00	199,777,200
トレックス・セミコンダクター	800	1,190.00	952,000
東光高岳	900	2,083.00	1,874,700
ダブル・スコープ	5,000	272.00	1,360,000
ダイヘン	1,500	7,430.00	11,145,000
ヤーマン	3,200	720.00	2,304,000
JVCケンウッド	12,800	1,770.50	22,662,400
ミマキエンジニアリング	1,400	1,461.00	2,045,400
I-PEX	900	2,946.00	2,651,400
大崎電気工業	3,500	818.00	2,863,000
オムロン	14,800	4,987.00	73,807,600
日東工業	2,200	2,866.00	6,305,200
I D E C	2,400	2,374.00	5,697,600
正興電機製作所	100	1,186.00	118,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	7,200	2,512.50	18,090,000
サクサ	100	2,800.00	280,000
メルコホールディングス	500	2,084.00	1,042,000
テクノメディカ	400	1,795.00	718,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	1,000	501.00	501,000
日本電気	22,900	12,970.00	297,013,000
富士通	148,900	2,802.50	417,292,250
沖電気工業	7,900	1,060.00	8,374,000
電気興業	700	1,641.00	1,148,700
サンケン電気	1,700	6,178.00	10,502,600
アイホン	1,000	2,710.00	2,710,000
ルネサスエレクトロニクス	123,300	2,005.00	247,216,500
セイコーエプソン	20,800	2,850.50	59,290,400
ワコム	11,400	737.00	8,401,800
アルバック	3,500	6,332.00	22,162,000
アクセル	900	1,215.00	1,093,500
E I Z O	2,100	2,227.00	4,676,700
日本信号	3,700	919.00	3,400,300
京三製作所	3,800	525.00	1,995,000
能美防災	2,200	3,140.00	6,908,000
ホーチキ	1,000	2,487.00	2,487,000
星和電機	200	533.00	106,600
エレコム	3,900	1,464.00	5,709,600
パナソニック ホールディングス	191,100	1,608.50	307,384,350
シャープ	23,400	997.30	23,336,820
アンリツ	11,400	1,220.50	13,913,700
富士通ゼネラル	4,600	2,176.00	10,009,600
ソニーグループ	560,900	3,324.00	1,864,431,600



T D K	139,700	2,027.50	283,241,750
帝国通信工業	700	2,589.00	1,812,300
タムラ製作所	6,500	498.00	3,237,000
アルプスアルパイン	13,100	1,622.50	21,254,750
日本電波工業	1,500	863.00	1,294,500
鈴木	900	1,821.00	1,638,900
メイコー	1,600	9,270.00	14,832,000
日本トリム	400	3,585.00	1,434,000
フォスター電機	1,700	1,568.00	2,665,600
S M K	400	2,438.00	975,200
ヨコオ	1,400	1,710.00	2,394,000
ホシデン	4,100	2,290.00	9,389,000
ヒロセ電機	2,400	18,600.00	44,640,000
日本航空電子工業	4,200	2,671.00	11,218,200
T O A	1,700	919.00	1,562,300
マクセル	3,300	1,720.00	5,676,000
古野電気	1,900	2,735.00	5,196,500
スミダコーポレーション	2,200	896.00	1,971,200
アイコム	600	2,642.00	1,585,200
リオン	700	2,643.00	1,850,100
横河電機	17,700	3,413.00	60,410,100
新電元工業	600	2,354.00	1,412,400
アズビル	44,100	1,230.00	54,243,000
東亜ディーケーケー	300	729.00	218,700
日本光電工業	14,300	2,147.00	30,702,100
チノー	700	2,170.00	1,519,000
日本電子材料	1,000	2,075.00	2,075,000
堀場製作所	3,000	8,887.00	26,661,000
アドバンテスト	50,500	9,558.00	482,679,000
エスベック	1,400	2,654.00	3,715,600
キーエンス	16,000	64,210.00	1,027,360,000
日置電機	800	7,610.00	6,088,000
シスメックス	41,500	2,966.50	123,109,750
日本マイクロニクス	2,600	4,000.00	10,400,000
メガチップス	1,200	6,230.00	7,476,000
O B A R A G R O U P	1,000	4,065.00	4,065,000
原田工業	400	520.00	208,000
コーセル	1,700	1,163.00	1,977,100
イリソ電子工業	1,600	2,682.00	4,291,200
オプテックスグループ	3,000	1,708.00	5,124,000
千代田インテグレ	600	3,490.00	2,094,000
レーザーテック	7,300	15,300.00	111,690,000

スタンレー電気	10,000	2,544.50	25,445,000	
ウシオ電機	7,100	2,031.00	14,420,100	
岡谷電機産業	300	221.00	66,300	
日本セラミック	1,500	2,642.00	3,963,000	
遠藤照明	200	1,449.00	289,800	
古河電池	1,200	1,377.00	1,652,400	
山一電機	1,300	2,324.00	3,021,200	
図研	1,500	4,415.00	6,622,500	
日本電子	3,700	5,485.00	20,294,500	
カシオ計算機	12,900	1,297.50	16,737,750	
ファナック	77,500	4,041.00	313,177,500	
日本シイエムケイ	4,800	399.00	1,915,200	
エンプラス	500	5,100.00	2,550,000	
大真空	2,100	540.00	1,134,000	
ローム	29,000	1,383.00	40,107,000	
浜松ホトニクス	25,700	1,812.00	46,568,400	
三井ハイテック	7,100	866.00	6,148,600	
新光電気工業	5,700	5,501.00	31,355,700	
京セラ	99,500	1,530.50	152,284,750	
太陽誘電	7,000	2,117.00	14,819,000	
村田製作所	143,100	2,470.00	353,457,000	
双葉電子工業	3,100	507.00	1,571,700	
ニチコン	4,200	1,044.00	4,384,800	
日本ケミコン	2,000	958.00	1,916,000	
K O A	2,700	980.00	2,646,000	
市光工業	3,100	388.00	1,202,800	
小糸製作所	16,600	1,972.50	32,743,500	
ミツバ	3,000	891.00	2,673,000	
S C R E E Nホールディングス	6,700	9,171.00	61,445,700	
キャノン電子	1,500	2,525.00	3,787,500	
キャノン	79,900	5,044.00	403,015,600	
リコー	42,200	1,782.50	75,221,500	
象印マホービン	4,800	1,568.00	7,526,400	
東京エレクトロン	33,900	23,655.00	801,904,500	代用有価証券 3,000株
イノテック	1,200	1,382.00	1,658,400	
トヨタ紡織	6,700	1,991.00	13,339,700	
芦森工業	100	2,565.00	256,500	
ユニプレス	2,900	1,049.00	3,042,100	
豊田自動織機	13,700	11,135.00	152,549,500	
モリタホールディングス	2,500	2,103.00	5,257,500	
三櫻工業	2,200	727.00	1,599,400	
デンソー	169,900	2,136.00	362,906,400	

東海理化電機製作所	4,500	2,191.00	9,859,500	
川崎重工業	12,100	6,356.00	76,907,600	
名村造船所	4,500	1,630.00	7,335,000	
日本車輛製造	600	2,225.00	1,335,000	
三菱ロジスネクスト	2,500	1,948.00	4,870,000	
日産自動車	200,100	351.40	70,315,140	
いすゞ自動車	49,500	2,169.50	107,390,250	
トヨタ自動車	851,400	2,692.00	2,291,968,800	代用有価証券 45,000株
日野自動車	24,000	455.00	10,920,000	
三菱自動車工業	62,300	413.90	25,785,970	
レシップホールディングス	300	477.00	143,100	
武蔵精密工業	3,900	4,095.00	15,970,500	
日産車体	2,400	1,004.00	2,409,600	
新明和工業	4,600	1,335.00	6,141,000	
極東開発工業	2,200	2,351.00	5,172,200	
トピー工業	1,300	1,921.00	2,497,300	
ティラド	400	3,590.00	1,436,000	
曙ブレーキ工業	9,900	112.00	1,108,800	
タチエス	2,900	1,711.00	4,961,900	
NOK	6,200	2,406.00	14,917,200	
フタバ産業	4,800	692.00	3,321,600	
カヤバ	2,700	2,745.00	7,411,500	
大同メタル工業	3,100	479.00	1,484,900	
プレス工業	6,200	538.00	3,335,600	
ミクニ	500	317.00	158,500	
太平洋工業	3,600	1,310.00	4,716,000	
アイシン	33,900	1,722.00	58,375,800	
マツダ	49,200	970.20	47,733,840	
本田技研工業	379,500	1,287.50	488,606,250	
スズキ	129,400	1,775.00	229,685,000	
S U B A R U	48,300	2,511.00	121,281,300	
安永	200	478.00	95,600	
ヤマハ発動機	67,600	1,398.50	94,538,600	
エクセディ	2,600	4,730.00	12,298,000	
豊田合成	4,600	2,677.00	12,314,200	
愛三工業	3,000	1,557.00	4,671,000	
ヨロズ	1,600	1,158.00	1,852,800	
エフ・シー・シー	2,800	3,140.00	8,792,000	
シマノ	7,000	21,005.00	147,035,000	
テイ・エス テック	6,500	1,696.00	11,024,000	
ジャムコ	1,000	1,480.00	1,480,000	
リガク・ホールディングス	8,100	916.00	7,419,600	

テルモ	107,100	3,066.00	328,368,600
日機装	4,200	958.00	4,023,600
日本エム・ディ・エム	1,500	588.00	882,000
島津製作所	23,100	4,436.00	102,471,600
JMS	1,800	428.00	770,400
長野計器	1,000	2,461.00	2,461,000
ブイ・テクノロジー	800	2,288.00	1,830,400
東京計器	1,100	3,305.00	3,635,500
愛知時計電機	800	1,983.00	1,586,400
インターアクション	1,000	970.00	970,000
東京精密	3,300	7,222.00	23,832,600
マニー	6,400	1,790.50	11,459,200
ニコン	25,200	1,659.50	41,819,400
トプコン	9,100	2,808.50	25,557,350
オリンパス	91,700	2,365.50	216,916,350
理研計器	2,300	3,825.00	8,797,500
タムロン	2,200	4,340.00	9,548,000
HOYA	31,300	19,920.00	623,496,000
ノーリツ鋼機	1,500	4,660.00	6,990,000
A & Dホロンホールディングス	2,000	2,012.00	4,024,000
朝日インテック	19,500	2,517.00	49,081,500
シチズン時計	14,800	914.00	13,527,200
大研医器	300	524.00	157,200
メニコン	6,000	1,488.00	8,928,000
シンシア	100	523.00	52,300
松風	1,600	2,159.00	3,454,400
セイコーグループ	2,500	4,700.00	11,750,000
ニプロ	13,300	1,443.50	19,198,550
三井松島ホールディングス	1,100	3,305.00	3,635,500
パラマウントベッドホールディングス	3,700	2,606.00	9,642,200
トランザクション	1,100	2,210.00	2,431,000
粧美堂	100	510.00	51,000
ニホンフラッシュ	1,400	810.00	1,134,000
前田工織	2,900	1,830.00	5,307,000
アートネイチャー	1,700	814.00	1,383,800
フルヤ金属	1,500	3,510.00	5,265,000
バンダイナムコホールディングス	43,500	3,679.00	160,036,500
アイフィスジャパン	100	569.00	56,900
SHOEI	4,500	2,280.00	10,260,000
フランスベッドホールディングス	2,300	1,263.00	2,904,900
パイロットコーポレーション	2,500	4,770.00	11,925,000
萩原工業	1,100	1,661.00	1,827,100

フジシールインターナショナル	3,600	2,498.00	8,992,800	
タカラトミー	6,700	4,520.00	30,284,000	
広済堂ホールディングス	6,000	538.00	3,228,000	
プロネクサス	1,700	1,272.00	2,162,400	
TOPPANホールディングス	21,000	4,139.00	86,919,000	
大日本印刷	33,200	2,224.50	73,853,400	
共同印刷	400	3,995.00	1,598,000	
NISSHA	2,700	1,585.00	4,279,500	
TAKARA & COMPANY	900	3,050.00	2,745,000	
アシックス	59,200	3,029.00	179,316,800	
ツツミ	400	2,098.00	839,200	
ローランド	1,200	4,005.00	4,806,000	
小松ウオール工業	1,200	1,527.00	1,832,400	
ヤマハ	29,300	1,092.50	32,010,250	
河合楽器製作所	500	2,970.00	1,485,000	
クリナップ	1,600	666.00	1,065,600	
ピジョン	10,200	1,477.00	15,065,400	
キングジム	1,500	866.00	1,299,000	
リンテック	3,200	3,025.00	9,680,000	
イトーキ	3,200	1,631.00	5,219,200	
任天堂	101,100	9,184.00	928,502,400	代用有価証券 18,000株
三菱鉛筆	2,200	2,394.00	5,266,800	
タカラスタンド	3,700	1,677.00	6,204,900	
コクヨ	8,000	2,842.50	22,740,000	
ナカバヤシ	2,000	506.00	1,012,000	
グローブライド	1,600	1,905.00	3,048,000	
オカムラ	4,800	2,060.00	9,888,000	
美津濃	1,600	8,930.00	14,288,000	
グリムス	700	2,488.00	1,741,600	
東京電力ホールディングス	134,800	473.40	63,814,320	
中部電力	59,000	1,594.00	94,046,000	
関西電力	78,100	1,707.00	133,316,700	
中国電力	27,800	873.50	24,283,300	
北陸電力	16,400	839.00	13,759,600	
東北電力	42,200	1,165.50	49,184,100	
四国電力	14,900	1,202.00	17,909,800	
九州電力	36,900	1,406.00	51,881,400	
北海道電力	16,800	790.40	13,278,720	
沖縄電力	4,100	927.00	3,800,700	
電源開発	12,000	2,612.00	31,344,000	
イーレックス	3,200	605.00	1,936,000	
レノバ	4,400	712.00	3,132,800	

東京瓦斯	30,300	4,458.00	135,077,400
大阪瓦斯	31,500	3,261.00	102,721,500
東邦瓦斯	6,300	3,987.00	25,118,100
北海道瓦斯	4,800	546.00	2,620,800
広島ガス	3,500	377.00	1,319,500
西部ガスホールディングス	1,700	1,686.00	2,866,200
静岡ガス	3,700	1,017.00	3,762,900
メタウォーター	2,200	1,795.00	3,949,000
SBSホールディングス	1,400	2,377.00	3,327,800
東武鉄道	16,900	2,450.00	41,405,000
相鉄ホールディングス	5,300	2,400.50	12,722,650
東急	44,900	1,678.00	75,342,200
京浜急行電鉄	19,800	1,268.50	25,116,300
小田急電鉄	26,500	1,412.00	37,418,000
京王電鉄	8,500	3,902.00	33,167,000
京成電鉄	9,300	4,017.00	37,358,100
富士急行	2,000	2,215.00	4,430,000
東日本旅客鉄道	88,300	2,763.50	244,017,050
西日本旅客鉄道	40,900	2,778.50	113,640,650
東海旅客鉄道	61,700	2,907.00	179,361,900
東京地下鉄	26,800	1,594.00	42,719,200
西武ホールディングス	17,400	3,258.00	56,689,200
鴻池運輸	2,700	2,965.00	8,005,500
西日本鉄道	4,600	2,150.00	9,890,000
ハマキョウレックス	5,500	1,307.00	7,188,500
サカイ引越センター	2,000	2,430.00	4,860,000
近鉄グループホールディングス	17,100	3,187.00	54,497,700
阪急阪神ホールディングス	21,300	4,125.00	87,862,500
南海電気鉄道	7,100	2,383.50	16,922,850
京阪ホールディングス	8,800	3,323.00	29,242,400
神戸電鉄	500	2,296.00	1,148,000
名古屋鉄道	17,700	1,697.00	30,036,900
山陽電気鉄道	1,200	2,008.00	2,409,600
ヤマトホールディングス	19,400	1,757.00	34,085,800
山九	3,900	5,356.00	20,888,400
丸全昭和運輸	1,000	5,900.00	5,900,000
センコーグループホールディングス	9,400	1,523.00	14,316,200
トナミホールディングス	400	5,890.00	2,356,000
ニッコンホールディングス	9,100	2,021.50	18,395,650
福山通運	1,700	3,740.00	6,358,000
セイノーホールディングス	7,900	2,410.00	19,039,000
神奈川中央交通	500	3,795.00	1,897,500

A Z - COM丸和ホールディングス	5,000	1,115.00	5,575,000
九州旅客鉄道	12,200	3,971.00	48,446,200
S Gホールディングス	26,800	1,474.50	39,516,600
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	5,700	7,375.00	42,037,500
日本郵船	33,100	5,114.00	169,273,400
商船三井	30,400	5,239.00	159,265,600
川崎汽船	36,400	2,090.50	76,094,200
N Sユナイテッド海運	1,000	3,970.00	3,970,000
飯野海運	6,000	1,181.00	7,086,000
乾汽船	2,100	1,626.00	3,414,600
日本航空	36,700	2,544.00	93,364,800
A N Aホールディングス	43,500	2,921.00	127,063,500
トランコム	200	10,250.00	2,050,000
日新	1,100	4,490.00	4,939,000
三菱倉庫	16,700	1,183.50	19,764,450
三井倉庫ホールディングス	1,600	7,290.00	11,664,000
住友倉庫	4,700	2,762.00	12,981,400
澁澤倉庫	700	3,025.00	2,117,500
日本トランスシティ	3,300	1,036.00	3,418,800
中央倉庫	900	1,587.00	1,428,300
川西倉庫	100	1,063.00	106,300
安田倉庫	1,100	1,746.00	1,920,600
ファイズホールディングス	200	885.00	177,000
上組	7,400	3,423.00	25,330,200
キムラユニティー	100	1,457.00	145,700
キューソー流通システム	1,100	2,210.00	2,431,000
エーアイティー	1,000	1,752.00	1,752,000
内外トランスライン	700	2,741.00	1,918,700
日本コンセプト	600	1,864.00	1,118,400
N E C ネットエスアイ	6,200	3,300.00	20,460,000
クロスキャット	900	1,058.00	952,200
システナ	22,800	364.00	8,299,200
デジタルアーツ	1,000	6,090.00	6,090,000
日鉄ソリューションズ	5,500	4,154.00	22,847,000
キューブシステム	900	1,066.00	959,400
コア	700	1,843.00	1,290,100
手間いらず	300	3,630.00	1,089,000
ラクーンホールディングス	1,400	720.00	1,008,000
ソリトンシステムズ	900	1,148.00	1,033,200
ソフトクリエイイトホールディングス	1,100	2,261.00	2,487,100
T I S	17,000	3,890.00	66,130,000
グリー	5,300	445.00	2,358,500

コーエーテックモホールディングス	12,100	1,790.00	21,659,000
三菱総合研究所	800	4,625.00	3,700,000
電算	100	1,430.00	143,000
A G S	200	813.00	162,600
ファインデックス	1,300	803.00	1,043,900
ブレインパッド	1,300	1,181.00	1,535,300
K L a b	4,900	167.00	818,300
ポールトゥウィンホールディングス	2,400	424.00	1,017,600
ネクソン	35,300	2,190.00	77,307,000
アイスタイル	5,300	439.00	2,326,700
エムアップホールディングス	1,900	1,602.00	3,043,800
セルシス	2,300	1,401.00	3,222,300
エニグモ	2,300	297.00	683,100
テクノスジャパン	300	773.00	231,900
コロプラ	5,400	464.00	2,505,600
ブロードリーフ	6,400	699.00	4,473,600
クロス・マーケティンググループ	200	722.00	144,400
デジタルハーツホールディングス	1,200	843.00	1,011,600
メディアドゥ	700	1,423.00	996,100
じげん	4,000	495.00	1,980,000
フィックスターズ	1,600	1,822.00	2,915,200
C A R T A H O L D I N G S	900	1,438.00	1,294,200
オブティム	1,700	723.00	1,229,100
セレス	700	3,700.00	2,590,000
S H I F T	1,100	17,675.00	19,442,500
ティーガイア	1,400	2,658.00	3,721,200
セック	300	4,000.00	1,200,000
テクマトリックス	3,400	2,481.00	8,435,400
プロシップ	700	1,582.00	1,107,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,000	3,125.00	12,500,000
G M O ペイメントゲートウェイ	3,700	8,495.00	31,431,500
システムリサーチ	1,100	1,450.00	1,595,000
インターネットイニシアティブ	8,800	3,014.00	26,523,200
さくらインターネット	2,500	4,525.00	11,312,500
G M O グローバルサイン・ホールディングス	500	2,504.00	1,252,000
S R A ホールディングス	900	4,400.00	3,960,000
システムインテグレータ	200	305.00	61,000
朝日ネット	1,800	650.00	1,170,000
e B A S E	2,300	643.00	1,478,900
アバントグループ	2,000	2,079.00	4,158,000
アドソル日進	700	2,130.00	1,491,000
フリービット	700	1,440.00	1,008,000



コムチュア	2,100	2,218.00	4,657,800
アステリア	1,500	503.00	754,500
アイル	900	2,603.00	2,342,700
マークラインズ	900	2,283.00	2,054,700
メディカル・データ・ビジョン	2,200	386.00	849,200
g u m i	2,700	430.00	1,161,000
テラスカイ	600	2,019.00	1,211,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	800	2,210.00	1,768,000
P C Iホールディングス	200	896.00	179,200
ネオジャパン	500	1,800.00	900,000
P R T I M E S	400	1,685.00	674,000
ラクス	7,600	1,890.00	14,364,000
ランドコンピュータ	200	668.00	133,600
ダブルスタンダード	600	1,630.00	978,000
アカツキ	800	2,700.00	2,160,000
U b i c o mホールディングス	600	1,259.00	755,400
カナミックネットワーク	2,100	505.00	1,060,500
ノムラシステムコーポレーション	600	121.00	72,600
チェンジホールディングス	4,000	1,300.00	5,200,000
シンクロ・フード	200	366.00	73,200
オークネット	700	2,532.00	1,772,400
エイトレッド	100	1,530.00	153,000
マクロミル	3,100	1,198.00	3,713,800
ビーグリー	100	2,035.00	203,500
オロ	700	2,455.00	1,718,500
ユーザーローカル	700	1,907.00	1,334,900
P K S H A Technology	1,300	3,940.00	5,122,000
マネーフォワード	3,900	4,980.00	19,422,000
S u n A s t e r i s k	1,400	688.00	963,200
プラスアルファ・コンサルティング	2,000	1,922.00	3,844,000
電算システムホールディングス	700	2,432.00	1,702,400
A p p i e r Group	4,900	1,395.00	6,835,500
ビジョナル	1,900	8,304.00	15,777,600
ソルクシーズ	300	335.00	100,500
ハイマックス	600	1,364.00	818,400
野村総合研究所	34,800	4,587.00	159,627,600
C Eホールディングス	200	552.00	110,400
日本システム技術	1,500	1,947.00	2,920,500
インテージホールディングス	1,800	1,602.00	2,883,600
東邦システムサイエンス	800	1,384.00	1,107,200
ソースネクスト	8,200	179.00	1,467,800
シンプレクス・ホールディングス	3,100	2,557.00	7,926,700

HEROZ	800	926.00	740,800
ラクスル	3,900	1,398.00	5,452,200
メルカリ	7,800	1,886.50	14,714,700
I P S	500	2,495.00	1,247,500
システムサポート	600	1,768.00	1,060,800
イーソル	1,300	626.00	813,800
東海ソフト	100	1,367.00	136,700
ウイングアーク1st	1,700	3,550.00	6,035,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	700	821.00	574,700
サーバーワークス	300	2,275.00	682,500
東名	100	2,406.00	240,600
トピラシステムズ	100	784.00	78,400
Sansan	5,300	2,390.00	12,667,000
Link-Uグループ	100	422.00	42,200
ギフトィ	1,400	1,305.00	1,827,000
メドレー	1,700	4,045.00	6,876,500
ベース	800	3,030.00	2,424,000
JMDC	1,900	3,994.00	7,588,600
フォーカスシステムズ	1,100	1,102.00	1,212,200
クレスコ	2,600	1,198.00	3,114,800
フジ・メディア・ホールディングス	15,400	1,734.50	26,711,300
オービック	29,800	4,830.00	143,934,000
ジャストシステム	2,300	3,575.00	8,222,500
TDCソフト	2,700	1,444.00	3,898,800
LINEヤフー	256,900	438.00	112,522,200
トレンドマイクロ	8,400	8,450.00	70,980,000
IDホールディングス	1,100	1,612.00	1,773,200
日本オラクル	3,100	14,415.00	44,686,500
アルファシステムズ	500	3,500.00	1,750,000
フューチャー	4,000	1,902.00	7,608,000
CAC Holdings	1,000	1,692.00	1,692,000
オービックビジネスコンサルタント	2,700	7,203.00	19,448,100
アイティフォー	1,900	1,470.00	2,793,000
東計電算	400	4,390.00	1,756,000
エクスネット	100	1,507.00	150,700
大塚商会	18,200	3,684.00	67,048,800
サイボウズ	2,200	2,117.00	4,657,400
電通総研	1,600	5,780.00	9,248,000
ACCESS	1,700	881.00	1,497,700
デジタルガレージ	2,600	3,685.00	9,581,000
EMシステムズ	2,700	770.00	2,079,000
ウェザーニューズ	1,000	3,265.00	3,265,000

C I J	4,000	463.00	1,852,000	
ビジネスエンジニアリング	400	3,800.00	1,520,000	
WOWOW	1,200	1,004.00	1,204,800	
スカラ	1,800	402.00	723,600	
インテリジェント ウェイブ	200	1,133.00	226,600	
ANYCOLOR	2,200	2,796.00	6,151,200	
I M A G I C A G R O U P	1,900	558.00	1,060,200	
ネットワンシステムズ	6,700	4,478.00	30,002,600	
アルゴグラフィックス	1,500	5,080.00	7,620,000	
マーベラス	2,900	577.00	1,673,300	
エイベックス	3,000	1,505.00	4,515,000	
B I P R O G Y	5,400	4,597.00	24,823,800	
都築電気	1,000	2,692.00	2,692,000	
T B S ホールディングス	8,100	3,844.00	31,136,400	
日本テレビホールディングス	14,200	2,690.50	38,205,100	
朝日放送グループホールディングス	1,500	625.00	937,500	
テレビ朝日ホールディングス	3,900	2,319.00	9,044,100	
スカパーJ S A Tホールディングス	12,400	909.00	11,271,600	
テレビ東京ホールディングス	1,000	2,982.00	2,982,000	
ビジョン	2,400	1,324.00	3,177,600	
U - N E X T H O L D I N G S	5,400	1,701.00	9,185,400	
日本通信	12,800	130.00	1,664,000	
クロップス	100	1,011.00	101,100	
日本電信電話	4,778,200	154.90	740,143,180	代用有価証券 700,000株
K D D I	118,200	4,970.00	587,454,000	
ソフトバンク	2,570,500	198.70	510,758,350	
光通信	1,900	34,910.00	66,329,000	
エムティーアイ	1,100	1,264.00	1,390,400	
G M O インターネットグループ	5,200	2,796.00	14,539,200	
ファイバーゲート	1,000	932.00	932,000	
K A D O K A W A	8,500	4,475.00	38,037,500	
学研ホールディングス	2,900	1,011.00	2,931,900	
ゼンリン	2,700	809.00	2,184,300	
アイネット	1,000	1,645.00	1,645,000	
松竹	900	11,290.00	10,161,000	
東宝	10,000	6,782.00	67,820,000	
東映	2,600	6,370.00	16,562,000	
N T T データグループ	42,000	3,047.00	127,974,000	
ピー・シー・エー	1,100	2,153.00	2,368,300	
ビジネスブレイン太田昭和	700	2,087.00	1,460,900	
D T S	2,900	4,260.00	12,354,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,100	6,250.00	50,625,000	

シーイーシー	2,000	1,951.00	3,902,000
カブコン	31,900	3,438.00	109,672,200
アイ・エス・ピー	800	1,375.00	1,100,000
S C S K	13,100	3,252.00	42,601,200
N S W	700	3,090.00	2,163,000
アイネス	1,200	1,822.00	2,186,400
T K C	2,900	3,970.00	11,513,000
富士ソフト	4,400	9,652.00	42,468,800
N S D	6,200	3,419.00	21,197,800
コナミグループ	6,000	15,075.00	90,450,000
福井コンピュータホールディングス	1,100	3,145.00	3,459,500
J B C Cホールディングス	1,100	4,560.00	5,016,000
ミロク情報サービス	1,400	1,959.00	2,742,600
ソフトバンクグループ	79,200	9,421.00	746,143,200
リョーサン菱洋ホールディングス	2,900	2,258.00	6,548,200
高千穂交易	700	3,790.00	2,653,000
オルバヘルスケアホールディングス	100	2,027.00	202,700
伊藤忠食品	400	6,950.00	2,780,000
エレマテック	1,500	2,389.00	3,583,500
あらた	2,600	3,090.00	8,034,000
トーメンデバイス	200	6,650.00	1,330,000
東京エレクトロン デバイス	1,700	2,877.00	4,890,900
円谷フィールズホールディングス	2,700	1,778.00	4,800,600
双日	18,900	3,050.00	57,645,000
アルフレッサ ホールディングス	15,800	2,219.00	35,060,200
横浜冷凍	4,200	834.00	3,502,800
ラサ商事	900	1,340.00	1,206,000
アルコニックス	2,400	1,479.00	3,549,600
神戸物産	13,100	3,529.00	46,229,900
あい ホールディングス	2,700	2,123.00	5,732,100
ダイワボウホールディングス	7,500	3,078.00	23,085,000
マクニカホールディングス	13,100	1,688.50	22,119,350
ラクト・ジャパン	700	2,754.00	1,927,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,300	1,146.00	2,635,800
八洲電機	1,400	1,551.00	2,171,400
メディアスホールディングス	1,100	816.00	897,600
レスター	1,400	2,449.00	3,428,600
ジオリーブグループ	100	1,063.00	106,300
大光	200	588.00	117,600
O C H Iホールディングス	100	1,306.00	130,600
T O K A Iホールディングス	9,200	959.00	8,822,800
三洋貿易	1,700	1,574.00	2,675,800

ビューティガレージ	600	1,321.00	792,600
ウイン・パートナーズ	1,200	1,246.00	1,495,200
シップヘルスケアホールディングス	6,700	2,255.50	15,111,850
明治電機工業	700	1,342.00	939,400
デリカフーズホールディングス	200	500.00	100,000
スターティアホールディングス	100	2,249.00	224,900
コメダホールディングス	4,400	2,910.00	12,804,000
アセンテック	800	912.00	729,600
フルサト・マルカホールディングス	1,300	2,246.00	2,919,800
ヤマエグループホールディングス	1,800	1,912.00	3,441,600
小野建	1,800	1,472.00	2,649,600
南陽	100	1,103.00	110,300
佐島電機	1,200	1,748.00	2,097,600
エコートレーディング	100	927.00	92,700
伯東	1,000	4,150.00	4,150,000
コンドーテック	1,300	1,349.00	1,753,700
ナガイレーベン	2,100	2,165.00	4,546,500
三菱食品	1,600	4,975.00	7,960,000
松田産業	1,300	3,115.00	4,049,500
第一興商	6,600	1,842.50	12,160,500
メディバルホールディングス	18,400	2,440.00	44,896,000
S P K	700	2,068.00	1,447,600
萩原電気ホールディングス	700	3,120.00	2,184,000
アズワン	5,300	2,799.00	14,834,700
スズデン	700	1,834.00	1,283,800
シモジマ	1,100	1,309.00	1,439,900
ドウシシャ	1,600	2,164.00	3,462,400
高速	1,000	2,331.00	2,331,000
たけびし	700	2,021.00	1,414,700
リックス	400	2,791.00	1,116,400
丸文	1,500	1,044.00	1,566,000
ハピネット	1,300	4,720.00	6,136,000
橋本総業ホールディングス	800	1,286.00	1,028,800
日本ライフライン	4,500	1,345.00	6,052,500
タカショー	1,700	453.00	770,100
I D O M	5,700	1,094.00	6,235,800
進和	1,000	2,907.00	2,907,000
エスケイジャパン	100	694.00	69,400
ダイトロン	700	2,710.00	1,897,000
シークス	2,400	1,144.00	2,745,600
オーハシテクニカ	800	1,994.00	1,595,200
白銅	500	2,383.00	1,191,500

伊藤忠商事	113,900	7,680.00	874,752,000
丸紅	139,300	2,271.50	316,419,950
高島	200	1,257.00	251,400
長瀬産業	7,600	3,171.00	24,099,600
蝶理	900	3,960.00	3,564,000
豊田通商	50,900	2,632.00	133,968,800
三共生興	2,200	590.00	1,298,000
兼松	7,100	2,596.50	18,435,150
三井物産	249,000	3,238.00	806,262,000
日本紙パルプ商事	8,000	671.00	5,368,000
カメイ	1,800	1,926.00	3,466,800
スターゼン	1,200	2,987.00	3,584,400
山善	5,700	1,405.00	8,008,500
椿本興業	900	1,993.00	1,793,700
住友商事	101,600	3,332.00	338,531,200
内田洋行	700	6,700.00	4,690,000
三菱商事	313,200	2,532.50	793,179,000
第一実業	1,600	2,772.00	4,435,200
キャノンマーケティングジャパン	3,300	4,984.00	16,447,200
西華産業	800	4,735.00	3,788,000
佐藤商事	1,100	1,400.00	1,540,000
東京産業	1,700	715.00	1,215,500
ユアサ商事	1,400	4,345.00	6,083,000
神鋼商事	400	6,170.00	2,468,000
阪和興業	2,800	4,885.00	13,678,000
正栄食品工業	1,100	4,030.00	4,433,000
カナデン	1,200	1,478.00	1,773,600
RYODEN	1,400	2,404.00	3,365,600
岩谷産業	16,800	1,812.50	30,450,000
ナイス	100	1,595.00	159,500
ニチモウ	100	1,977.00	197,700
極東貿易	1,000	1,559.00	1,559,000
アステナホールディングス	3,100	480.00	1,488,000
三愛オブリ	3,900	1,857.00	7,242,300
稲畑産業	4,600	3,290.00	15,134,000
G S Iクレオス	900	2,170.00	1,953,000
明和産業	2,400	637.00	1,528,800
ワキタ	2,500	1,601.00	4,002,500
東邦ホールディングス	4,600	4,322.00	19,881,200
サンゲツ	4,300	2,804.00	12,057,200
ミツウロコグループホールディングス	2,100	1,796.00	3,771,600
シナネンホールディングス	500	6,040.00	3,020,000

伊藤忠エネクス	4,200	1,630.00	6,846,000
サンリオ	13,800	4,436.00	61,216,800
サンワテクノス	800	2,165.00	1,732,000
新光商事	2,200	950.00	2,090,000
トーヨー	700	2,820.00	1,974,000
三信電気	700	1,857.00	1,299,900
東陽テクニカ	1,500	1,402.00	2,103,000
モスフードサービス	2,500	3,805.00	9,512,500
加賀電子	3,400	2,915.00	9,911,000
ソーダニッカ	1,600	1,150.00	1,840,000
立花エレテック	1,000	2,620.00	2,620,000
フォーバル	700	1,345.00	941,500
PALTAC	2,600	4,354.00	11,320,400
三谷産業	3,000	320.00	960,000
西本Wismettacホールディングス	1,000	1,927.00	1,927,000
コア商事ホールディングス	1,500	597.00	895,500
KPPグループホールディングス	3,500	647.00	2,264,500
ヤマタネ	700	3,815.00	2,670,500
泉州電業	1,200	5,500.00	6,600,000
トラスコ中山	3,500	2,331.00	8,158,500
オートバックスセブン	5,900	1,451.00	8,560,900
モリト	1,300	1,540.00	2,002,000
加藤産業	2,100	4,515.00	9,481,500
イエローハット	3,000	2,660.00	7,980,000
JKホールディングス	1,300	1,037.00	1,348,100
日伝	1,000	2,992.00	2,992,000
杉本商事	1,500	1,404.00	2,106,000
因幡電機産業	4,700	3,869.00	18,184,300
東テク	1,700	2,590.00	4,403,000
ミスミグループ本社	25,600	2,437.50	62,400,000
蔵王産業	100	2,428.00	242,800
スズケン	5,600	4,741.00	26,549,600
ジェコス	1,000	992.00	992,000
インターメスティック	1,000	2,569.00	2,569,000
サンエー	2,900	2,892.00	8,386,800
カワチ薬品	1,300	2,558.00	3,325,400
エービーシー・マート	7,400	3,232.00	23,916,800
ハードオフコーポレーション	700	1,799.00	1,259,300
アスクル	4,000	1,740.00	6,960,000
ゲオホールディングス	1,900	1,632.00	3,100,800
アダストリア	2,300	3,640.00	8,372,000
シー・ヴィー・エス・バイエリア	200	528.00	105,600

くら寿司	2,000	3,010.00	6,020,000
キャンドウ	600	3,425.00	2,055,000
パルグループホールディングス	3,900	3,225.00	12,577,500
エディオン	7,400	1,791.00	13,253,400
サーラコーポレーション	3,600	869.00	3,128,400
ハローズ	700	3,995.00	2,796,500
フジオフードグループ本社	1,900	1,182.00	2,245,800
あみやき亭	1,200	1,657.00	1,988,400
大黒天物産	500	9,800.00	4,900,000
ハニーズホールディングス	1,500	1,650.00	2,475,000
ファーマライズホールディングス	200	586.00	117,200
アルペン	1,400	2,023.00	2,832,200
ハブ	200	740.00	148,000
クオールホールディングス	2,100	1,490.00	3,129,000
ジinzホールディングス	1,300	6,280.00	8,164,000
ビックカメラ	10,200	1,765.00	18,003,000
D C Mホールディングス	8,800	1,433.00	12,610,400
Monotaro	24,000	2,761.00	66,264,000
東京一番フーズ	200	499.00	99,800
J.フロント リテイリング	19,400	1,913.50	37,121,900
ドトール・日レスホールディングス	3,000	2,328.00	6,984,000
マツキヨココカラ&カンパニー	29,900	2,141.50	64,030,850
ブロンコビリー	1,000	3,810.00	3,810,000
Z O Z O	12,600	4,742.00	59,749,200
トレジャー・ファクトリー	1,200	1,393.00	1,671,600
物語コーポレーション	3,000	3,555.00	10,665,000
三越伊勢丹ホールディングス	25,700	2,363.50	60,741,950
Hamee	800	1,293.00	1,034,400
ウエルシアホールディングス	8,800	1,935.00	17,028,000
クリエイティブSDホールディングス	2,400	2,796.00	6,710,400
丸善CHIホールディングス	700	317.00	221,900
ティーライフ	100	1,151.00	115,100
シュッピン	1,700	1,001.00	1,701,700
オイシックス・ラ・大地	2,800	1,401.00	3,922,800
ネクステージ	3,900	1,345.00	5,245,500
ジョイフル本田	4,700	1,828.00	8,591,600
エターナルホスピタリティグループ	600	2,875.00	1,725,000
ホットランド	1,300	2,222.00	2,888,600
すかいらーくホールディングス	23,200	2,435.50	56,503,600
SFPホールディングス	1,000	1,973.00	1,973,000
綿半ホールディングス	1,300	1,508.00	1,960,400
ヨシックスホールディングス	600	3,345.00	2,007,000



ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	7,252	744.00	5,395,488
B E E N O S	1,100	3,360.00	3,696,000
あさひ	1,400	1,511.00	2,115,400
日本調剤	1,100	1,428.00	1,570,800
コスモス薬品	2,900	6,710.00	19,459,000
トーエル	200	751.00	150,200
セブン&アイ・ホールディングス	187,200	2,510.00	469,872,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	12,800	1,186.00	15,180,800
ツルハホールディングス	3,600	8,283.00	29,818,800
サンマルクホールディングス	1,400	2,581.00	3,613,400
トリドールホールディングス	4,800	4,005.00	19,224,000
ウイルプラスホールディングス	100	994.00	99,400
J Mホールディングス	1,200	2,460.00	2,952,000
アレンザホールディングス	1,300	1,080.00	1,404,000
串カツ田中ホールディングス	600	1,410.00	846,000
パロックジャパンリミテッド	2,000	787.00	1,574,000
クスリのアオキホールディングス	5,700	3,253.00	18,542,100
力の源ホールディングス	1,300	977.00	1,270,100
FOOD & LIFE COMPANIE	9,000	3,503.00	31,527,000
メディカルシステムネットワーク	2,100	429.00	900,900
一家ホールディングス	200	668.00	133,600
ノジマ	5,500	2,326.00	12,793,000
カップ・クリエイト	2,700	1,602.00	4,325,400
良品計画	20,200	3,471.00	70,114,200
アドヴァングループ	1,500	958.00	1,437,000
アルビス	600	2,608.00	1,564,800
ハウス オブ ローゼ	100	1,442.00	144,200
G - 7ホールディングス	1,900	1,400.00	2,660,000
イオン北海道	4,200	891.00	3,742,200
コジマ	3,300	1,090.00	3,597,000
コーナン商事	1,900	3,615.00	6,868,500
エコス	600	2,040.00	1,224,000
ワタミ	2,100	966.00	2,028,600
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	34,200	4,196.00	143,503,200
西松屋チェーン	3,800	2,266.00	8,610,800
ゼンショーホールディングス	9,600	9,415.00	90,384,000
幸楽苑	1,300	1,027.00	1,335,100
サイゼリヤ	2,500	5,640.00	14,100,000
V Tホールディングス	6,700	491.00	3,289,700
魚力	600	2,455.00	1,473,000

フジ・コーポレーション	800	2,144.00	1,715,200
ユナイテッドアローズ	1,800	2,683.00	4,829,400
ハイデイ日高	2,800	2,809.00	7,865,200
コロワイド	9,600	1,750.00	16,800,000
壱番屋	6,700	1,011.00	6,773,700
スギホールディングス	9,100	2,482.50	22,590,750
薬王堂ホールディングス	800	1,975.00	1,580,000
スクロール	2,500	1,090.00	2,725,000
ヨンドシーホールディングス	1,600	1,873.00	2,996,800
木曽路	2,600	2,120.00	5,512,000
S R Sホールディングス	2,800	1,174.00	3,287,200
千趣会	3,700	299.00	1,106,300
リテールパートナーズ	2,500	1,256.00	3,140,000
上新電機	1,700	2,303.00	3,915,100
日本瓦斯	8,100	2,148.50	17,402,850
ロイヤルホールディングス	3,000	2,422.00	7,266,000
チヨダ	1,600	1,352.00	2,163,200
ライフコーポレーション	1,800	3,435.00	6,183,000
リンガーハット	2,200	2,220.00	4,884,000
MrMaxHD	2,200	693.00	1,524,600
AOKIホールディングス	3,700	1,298.00	4,802,600
オークワ	2,700	902.00	2,435,400
コメリ	2,300	3,280.00	7,544,000
青山商事	3,600	2,282.00	8,215,200
しまむら	4,000	8,404.00	33,616,000
はせがわ	300	301.00	90,300
高島屋	23,500	1,255.50	29,504,250
松屋	2,900	966.00	2,801,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,300	2,194.00	18,210,200
近鉄百貨店	1,000	2,164.00	2,164,000
丸井グループ	11,200	2,544.50	28,498,400
アクシアル リテイリング	4,700	905.00	4,253,500
イオン	62,700	3,845.00	241,081,500
イズミ	2,600	3,191.00	8,296,600
平和堂	2,800	2,295.00	6,426,000
フジ	3,100	2,070.00	6,417,000
ヤオコー	2,000	9,246.00	18,492,000
ゼビオホールディングス	2,300	1,160.00	2,668,000
ケーズホールディングス	11,400	1,404.00	16,005,600
日産東京販売ホールディングス	600	470.00	282,000
シルバーライフ	700	714.00	499,800
Genky DrugStores	1,500	3,130.00	4,695,000

ナルミヤ・インターナショナル	100	1,293.00	129,300
ブックオフグループホールディングス	1,200	1,505.00	1,806,000
ギフトホールディングス	800	3,215.00	2,572,000
アインホールディングス	2,300	4,506.00	10,363,800
Genki Global Dining	1,000	3,500.00	3,500,000
ヤマダホールディングス	52,200	447.40	23,354,280
アークランズ	5,100	1,673.00	8,532,300
ニトリホールディングス	6,200	19,340.00	119,908,000
グルメ杵屋	1,400	1,048.00	1,467,200
ケーユーホールディングス	1,100	1,111.00	1,222,100
吉野家ホールディングス	6,600	3,192.00	21,067,200
松屋フーズホールディングス	800	6,650.00	5,320,000
サガミホールディングス	2,700	1,811.00	4,889,700
王将フードサービス	3,400	3,055.00	10,387,000
ミニストップ	1,400	1,706.00	2,388,400
アークス	2,900	2,589.00	7,508,100
パローホールディングス	3,200	2,170.00	6,944,000
ベルク	800	6,670.00	5,336,000
大庄	1,100	1,065.00	1,171,500
ファーストリテイリング	9,500	52,780.00	501,410,000
サンドラッグ	5,700	3,986.00	22,720,200
サックスパーホールディングス	1,600	995.00	1,592,000
やまや	100	2,871.00	287,100
ベルーナ	4,100	786.00	3,222,600
いよぎんホールディングス	20,600	1,511.50	31,136,900
しずおかフィナンシャルグループ	34,800	1,324.00	46,075,200
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	13,300	1,652.50	21,978,250
楽天銀行	7,300	4,306.00	31,433,800
京都フィナンシャルグループ	19,800	2,273.00	45,005,400
じもとホールディングス	500	296.00	148,000
めぶきフィナンシャルグループ	79,200	666.30	52,770,960
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	4,475.00	8,950,000
九州フィナンシャルグループ	27,800	716.60	19,921,480
ゆうちょ銀行	130,000	1,512.50	196,625,000
富山第一銀行	5,000	1,106.00	5,530,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	83,900	897.80	75,325,420
西日本フィナンシャルホールディングス	9,700	2,078.00	20,156,600
三十三フィナンシャルグループ	1,400	2,220.00	3,108,000
第四北越フィナンシャルグループ	5,000	2,902.00	14,510,000
ひろぎんホールディングス	22,200	1,170.00	25,974,000
おきなわフィナンシャルグループ	1,200	2,701.00	3,241,200
十六フィナンシャルグループ	2,200	4,370.00	9,614,000

北國フィナンシャルホールディングス	1,500	5,410.00	8,115,000	
プロクレアホールディングス	1,800	1,741.00	3,133,800	
あいちフィナンシャルグループ	2,900	2,437.00	7,067,300	
あおぞら銀行	10,900	2,408.50	26,252,650	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,034,600	1,857.00	1,921,252,200	代用有価証券 90,000株
りそなホールディングス	194,900	1,195.00	232,905,500	
三井住友トラストグループ	56,200	3,772.00	211,986,400	
三井住友フィナンシャルグループ	329,100	3,760.00	1,237,416,000	
千葉銀行	48,900	1,257.50	61,491,750	
群馬銀行	27,400	1,113.50	30,509,900	
武蔵野銀行	2,400	3,015.00	7,236,000	
千葉興業銀行	3,700	1,407.00	5,205,900	
筑波銀行	6,900	250.00	1,725,000	
七十七銀行	5,100	4,602.00	23,470,200	
秋田銀行	1,100	2,216.00	2,437,600	
山形銀行	1,700	968.00	1,645,600	
岩手銀行	1,000	2,725.00	2,725,000	
東邦銀行	13,600	283.00	3,848,800	
東北銀行	200	1,157.00	231,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	13,700	4,098.00	56,142,600	
スルガ銀行	10,600	1,110.00	11,766,000	
八十二銀行	36,900	1,022.00	37,711,800	
山梨中央銀行	1,800	1,861.00	3,349,800	
大垣共立銀行	3,000	1,879.00	5,637,000	
福井銀行	1,400	1,838.00	2,573,200	
清水銀行	600	1,463.00	877,800	
滋賀銀行	2,400	3,835.00	9,204,000	
南都銀行	2,400	3,205.00	7,692,000	
百五銀行	14,900	629.00	9,372,100	
紀陽銀行	5,700	2,097.00	11,952,900	
ほくほくフィナンシャルグループ	8,900	1,936.50	17,234,850	
山陰合同銀行	9,900	1,247.00	12,345,300	
鳥取銀行	100	1,225.00	122,500	
百十四銀行	1,500	3,340.00	5,010,000	
四国銀行	2,300	1,131.00	2,601,300	
阿波銀行	2,200	2,757.00	6,065,400	
大分銀行	900	3,130.00	2,817,000	
宮崎銀行	1,000	3,055.00	3,055,000	
佐賀銀行	900	2,198.00	1,978,200	
琉球銀行	3,600	1,050.00	3,780,000	
セブン銀行	56,500	322.90	18,243,850	
みずほフィナンシャルグループ	212,900	3,810.00	811,149,000	

山口フィナンシャルグループ	15,500	1,635.00	25,342,500
名古屋銀行	1,000	6,370.00	6,370,000
北洋銀行	21,500	470.00	10,105,000
大光銀行	100	1,451.00	145,100
愛媛銀行	2,300	1,117.00	2,569,100
トマト銀行	100	1,186.00	118,600
京葉銀行	7,100	811.00	5,758,100
栃木銀行	7,200	291.00	2,095,200
北日本銀行	600	2,840.00	1,704,000
東和銀行	2,900	644.00	1,867,600
大東銀行	200	726.00	145,200
トモニホールディングス	15,100	449.00	6,779,900
フィデアホールディングス	1,600	1,399.00	2,238,400
池田泉州ホールディングス	21,900	403.00	8,825,700
F P G	5,600	2,768.00	15,500,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	2,500	1,031.00	2,577,500
マーキュリアホールディングス	200	819.00	163,800
S B Iホールディングス	25,400	4,131.00	104,927,400
ジャフコ グループ	4,700	2,215.00	10,410,500
大和証券グループ本社	112,800	1,054.00	118,891,200
野村ホールディングス	265,300	914.30	242,563,790
岡三証券グループ	12,500	650.00	8,125,000
丸三証券	5,300	1,004.00	5,321,200
東洋証券	4,700	622.00	2,923,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,800	490.00	9,212,000
水戸証券	4,300	592.00	2,545,600
いちよし証券	3,200	1,007.00	3,222,400
松井証券	10,900	821.00	8,948,900
マネックスグループ	15,500	1,064.00	16,492,000
極東証券	2,000	1,450.00	2,900,000
岩井コスモホールディングス	1,800	2,308.00	4,154,400
アイザワ証券グループ	2,300	1,786.00	4,107,800
スパークス・グループ	1,700	1,516.00	2,577,200
かんぽ生命保険	18,400	2,930.00	53,912,000
F P パートナー	700	2,126.00	1,488,200
S O M P Oホールディングス	77,100	4,241.00	326,981,100
アニコム ホールディングス	5,300	656.00	3,476,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	115,600	3,421.00	395,467,600
第一生命ホールディングス	74,200	4,230.00	313,866,000
東京海上ホールディングス	154,000	5,559.00	856,086,000
T & Dホールディングス	42,400	2,787.50	118,190,000
アドバンスクリエイト	1,400	503.00	704,200

NEXYZ . Group	100	787.00	78,700
全国保証	4,100	5,483.00	22,480,300
あんしん保証	200	154.00	30,800
ジェイリース	1,200	1,224.00	1,468,800
イントラスト	200	796.00	159,200
日本モーゲージサービス	400	425.00	170,000
SBIアルヒ	1,600	819.00	1,310,400
プレミアグループ	2,700	2,533.00	6,839,100
ネットプロテクションズホールディングス	5,200	500.00	2,600,000
クレディセゾン	10,000	3,623.00	36,230,000
芙蓉総合リース	1,400	11,305.00	15,827,000
みずほリース	11,800	1,003.00	11,835,400
東京センチュリー	11,800	1,518.00	17,912,400
日本証券金融	5,800	2,087.00	12,104,600
アイフル	26,000	327.00	8,502,000
リコーリース	1,500	5,130.00	7,695,000
イオンフィナンシャルサービス	9,000	1,272.50	11,452,500
アコム	37,500	379.60	14,235,000
ジャックス	1,900	3,690.00	7,011,000
オリエントコーポレーション	5,100	821.00	4,187,100
オリックス	94,600	3,309.00	313,031,400
三菱HCキャピタル	79,000	1,012.50	79,987,500
日本取引所グループ	93,800	1,829.50	171,607,100
イー・ギャランティ	2,600	1,763.00	4,583,800
NECキャピタルソリューション	800	3,745.00	2,996,000
大東建託	5,400	17,695.00	95,553,000
サムティホールディングス	3,100	3,285.00	10,183,500
いちご	13,300	360.00	4,788,000
日本駐車場開発	18,700	208.00	3,889,600
スター・マイカ・ホールディングス	1,700	735.00	1,249,500
SREホールディングス	600	3,160.00	1,896,000
ヒューリック	36,800	1,357.00	49,937,600
野村不動産ホールディングス	9,900	3,704.00	36,669,600
三重交通グループホールディングス	3,300	497.00	1,640,100
ディア・ライフ	2,700	1,057.00	2,853,900
コーセーアールイー	100	720.00	72,000
地主	1,400	2,113.00	2,958,200
プレサンスコーポレーション	2,100	1,907.00	4,004,700
THEグローバル社	300	621.00	186,300
JPMC	900	1,133.00	1,019,700
サンセイランディック	200	961.00	192,200
エストラスト	100	693.00	69,300

フージャースホールディングス	2,400	1,002.00	2,404,800
オープンハウスグループ	5,800	5,531.00	32,079,800
東急不動産ホールディングス	47,400	920.30	43,622,220
飯田グループホールディングス	15,100	2,345.00	35,409,500
イーランド	100	1,394.00	139,400
ムゲンエステート	200	1,967.00	393,400
ビーロッド	200	1,332.00	266,400
ファーストブラザーズ	100	1,007.00	100,700
A n d D oホールディングス	1,000	978.00	978,000
シーアールイー	800	1,189.00	951,200
ケイアイスター不動産	900	4,295.00	3,865,500
アグレ都市デザイン	100	1,602.00	160,200
グッドコムアセット	1,300	852.00	1,107,600
ジェイ・エス・ビー	700	2,645.00	1,851,500
ロードスターキャピタル	900	2,501.00	2,250,900
イノベーションホールディングス	200	917.00	183,400
グローバル・リンク・マネジメント	100	2,749.00	274,900
霞ヶ関キャピタル	600	11,770.00	7,062,000
パーク24	12,300	1,847.50	22,724,250
パラカ	600	1,779.00	1,067,400
ミガロホールディングス	100	1,529.00	152,900
宮越ホールディングス	700	1,832.00	1,282,400
三井不動産	218,900	1,243.50	272,202,150
三菱地所	91,400	2,134.50	195,093,300
平和不動産	2,600	4,205.00	10,933,000
東京建物	13,800	2,503.50	34,548,300
京阪神ビルディング	2,600	1,590.00	4,134,000
住友不動産	25,700	4,645.00	119,376,500
テーオーシー	2,800	650.00	1,820,000
レオパレス21	13,700	569.00	7,795,300
スターツコーポレーション	2,600	3,655.00	9,503,000
フジ住宅	2,000	773.00	1,546,000
空港施設	2,200	570.00	1,254,000
明和地所	1,300	1,009.00	1,311,700
ゴールドクレスト	1,100	3,220.00	3,542,000
エスリード	700	4,435.00	3,104,500
日神グループホールディングス	2,500	524.00	1,310,000
日本エスコン	4,100	944.00	3,870,400
M I R A R T Hホールディングス	9,200	500.00	4,600,000
イオンモール	9,500	1,989.00	18,895,500
毎日コムネット	200	714.00	142,800
カチタス	4,200	2,180.00	9,156,000

トーセイ	2,600	2,502.00	6,505,200
サンフロンティア不動産	2,600	1,904.00	4,950,400
FJネクストホールディングス	1,600	1,190.00	1,904,000
グランディハウス	1,700	560.00	952,000
日本空港ビルデング	5,600	4,950.00	27,720,000
明豊ファシリティワークス	200	864.00	172,800
MIXI	3,100	3,160.00	9,796,000
ジェイエイシーリクルートメント	6,000	737.00	4,422,000
日本M&Aセンターホールディングス	24,300	661.10	16,064,730
中広	200	432.00	86,400
UTグループ	2,200	2,120.00	4,664,000
アイティメディア	900	1,545.00	1,390,500
ケアネット	3,400	573.00	1,948,200
E・Jホールディングス	1,000	1,695.00	1,695,000
オープンアップグループ	5,000	1,799.00	8,995,000
コシダカホールディングス	5,000	1,161.00	5,805,000
アルトナー	200	2,006.00	401,200
パソナグループ	2,000	1,995.00	3,990,000
CDS	100	1,840.00	184,000
リンクアンドモチベーション	4,100	578.00	2,369,800
エス・エム・エス	6,300	1,582.50	9,969,750
サニーサイドアップグループ	200	553.00	110,600
パーソルホールディングス	153,500	236.00	36,226,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	300	730.00	219,000
学情	900	2,280.00	2,052,000
スタジオアリス	800	2,116.00	1,692,800
エプコ	200	788.00	157,600
NJS	400	3,560.00	1,424,000
総合警備保障	27,500	1,112.00	30,580,000
カカクコム	11,900	2,348.50	27,947,150
アイロムグループ	700	2,590.00	1,813,000
セントケア・ホールディング	1,300	728.00	946,400
ルネサンス	1,300	1,010.00	1,313,000
ディップ	2,900	2,470.00	7,163,000
デジタルホールディングス	900	1,266.00	1,139,400
新日本科学	1,700	1,568.00	2,665,600
キャリアデザインセンター	100	1,829.00	182,900
エムスリー	32,500	1,403.50	45,613,750
ツカダ・グローバルホールディング	400	431.00	172,400
ウェルネット	300	815.00	244,500
ワールドホールディングス	700	1,993.00	1,395,100
ディー・エヌ・エー	6,600	2,735.00	18,051,000



博報堂D Yホールディングス	18,700	1,267.00	23,692,900
ぐるなび	3,200	285.00	912,000
タカミヤ	2,300	407.00	936,100
ファンコミュニケーションズ	2,400	417.00	1,000,800
ライク	700	1,376.00	963,200
エスプール	5,200	311.00	1,617,200
WDBホールディングス	900	1,685.00	1,516,500
ティア	400	427.00	170,800
アドウェイズ	2,500	300.00	750,000
バリューコマース	1,400	1,175.00	1,645,000
インフォマート	15,600	284.00	4,430,400
J Pホールディングス	4,200	649.00	2,725,800
プレステージ・インターナショナル	7,700	697.00	5,366,900
プロトコーポレーション	1,800	1,301.00	2,341,800
アミューズ	1,000	1,441.00	1,441,000
ドリームインキュベータ	400	3,420.00	1,368,000
クイック	1,200	2,195.00	2,634,000
電通グループ	17,500	4,075.00	71,312,500
ぴあ	600	3,120.00	1,872,000
イオンファンタジー	700	3,055.00	2,138,500
シーティーエス	2,300	929.00	2,136,700
H . U . グループホールディングス	4,800	2,610.00	12,528,000
アルプス技研	1,400	2,627.00	3,677,800
日本空調サービス	1,800	1,024.00	1,843,200
オリエンタルランド	98,000	3,248.00	318,304,000
ダスキン	3,600	3,678.00	13,240,800
明光ネットワークジャパン	2,100	726.00	1,524,600
ファルコホールディングス	700	2,345.00	1,641,500
ラウンドワン	15,500	1,341.00	20,785,500
リゾートトラスト	6,500	3,123.00	20,299,500
ビー・エム・エル	2,000	3,035.00	6,070,000
リソー教育	10,400	300.00	3,120,000
早稲田アカデミー	900	1,816.00	1,634,400
ユー・エス・エス	33,800	1,366.50	46,187,700
東京個別指導学院	2,400	376.00	902,400
サイバーエージェント	36,400	1,136.00	41,350,400
楽天グループ	116,000	988.20	114,631,200
クリーク・アンド・リバー社	900	1,598.00	1,438,200
S B I グローバルアセットマネジメント	3,300	667.00	2,201,100
テー・オー・ダブリュー	3,400	314.00	1,067,600
山田コンサルティンググループ	800	1,887.00	1,509,600
セントラルスポーツ	600	2,410.00	1,446,000

フルキャストホールディングス	1,400	1,477.00	2,067,800
エン・ジャパン	2,700	2,167.00	5,850,900
テクノプロ・ホールディングス	9,600	2,893.00	27,772,800
アイ・アールジャパンホールディングス	1,100	741.00	815,100
K e e P e r 技研	1,000	4,630.00	4,630,000
楽待	200	685.00	137,000
三機サービス	100	994.00	99,400
G u n o s y	1,500	682.00	1,023,000
イー・ガーディアン	800	2,029.00	1,623,200
リブセンス	600	149.00	89,400
ジャパンマテリアル	5,100	1,703.00	8,685,300
ベクトル	2,300	1,028.00	2,364,400
チャーム・ケア・コーポレーション	1,400	1,286.00	1,800,400
キャリアリンク	600	2,400.00	1,440,000
I B J	1,500	620.00	930,000
アサンテ	800	1,645.00	1,316,000
バリューHR	1,500	1,821.00	2,731,500
M & A キャピタルパートナーズ	1,300	2,776.00	3,608,800
ライドオンエクスプレスホールディングス	800	999.00	799,200
E R I ホールディングス	100	2,114.00	211,400
シグマクシス・ホールディングス	4,800	886.00	4,252,800
ウィルグループ	1,400	970.00	1,358,000
メドピア	1,700	467.00	793,900
レアジョブ	200	368.00	73,600
リクルートホールディングス	128,500	11,570.00	1,486,745,000
エラン	2,200	740.00	1,628,000
日本郵政	184,400	1,518.50	280,011,400
ベルシステム24ホールディングス	1,800	1,280.00	2,304,000
鎌倉新書	1,700	503.00	855,100
一蔵	200	395.00	79,000
エアトリ	1,200	1,104.00	1,324,800
ストライク	800	3,830.00	3,064,000
ソラスト	4,600	472.00	2,171,200
セラク	600	1,259.00	755,400
インソース	3,600	1,160.00	4,176,000
ベイカレント	12,100	5,229.00	63,270,900
O r c h e s t r a H o l d i n g s	600	798.00	478,800
アイモバイル	2,200	552.00	1,214,400
M S - J a p a n	1,000	1,085.00	1,085,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,400	2,719.00	17,401,600
グリーンズ	100	1,898.00	189,800
エル・ティー・エス	300	2,443.00	732,900

ミダックホールディングス	1,000	1,545.00	1,545,000
キュービーネットホールディングス	1,000	1,043.00	1,043,000
マネジメントソリューションズ	800	1,678.00	1,342,400
プロレド・パートナーズ	700	542.00	379,400
フロンティア・マネジメント	700	772.00	540,400
コプロ・ホールディングス	100	1,645.00	164,500
アンビスホールディングス	3,500	763.00	2,670,500
カーブスホールディングス	4,500	813.00	3,658,500
フォーラムエンジニアリング	1,900	982.00	1,865,800
Fast Fitness Japan	700	1,394.00	975,800
Macbee Planet	500	2,981.00	1,490,500
ポピンズ	400	1,224.00	489,600
LITALICO	1,500	873.00	1,309,500
コンフィデンス・インターワークス	100	1,566.00	156,600
アドバンテッジリスクマネジメント	300	622.00	186,600
リログループ	9,200	1,931.00	17,765,200
東祥	1,600	641.00	1,025,600
ID&Eホールディングス	1,000	6,480.00	6,480,000
ビーウィズ	500	1,490.00	745,000
サンウェルズ	800	748.00	598,400
TREホールディングス	3,800	1,567.00	5,954,600
人・夢・技術グループ	700	1,382.00	967,400
NISSOホールディングス	1,500	748.00	1,122,000
大栄環境	3,600	3,005.00	10,818,000
日本管財ホールディングス	1,700	2,586.00	4,396,200
M&A総研ホールディングス	1,800	1,912.00	3,441,600
エイチ・アイ・エス	5,300	1,600.00	8,480,000
ラックランド	700	1,807.00	1,264,900
共立メンテナンス	5,200	2,832.50	14,729,000
イチネンホールディングス	1,600	1,878.00	3,004,800
建設技術研究所	900	5,110.00	4,599,000
スペース	1,200	1,187.00	1,424,400
燦ホールディングス	1,400	1,220.00	1,708,000
スバル興業	600	3,250.00	1,950,000
ナガワ	400	6,160.00	2,464,000
東京都競馬	1,200	4,335.00	5,202,000
カナモト	2,600	3,380.00	8,788,000
ニシオホールディングス	1,400	4,030.00	5,642,000
トランス・コスモス	2,100	3,455.00	7,255,500
乃村工藝社	7,200	843.00	6,069,600
藤田観光	700	8,140.00	5,698,000
KNT-CTホールディングス	1,000	1,171.00	1,171,000

トーカイ	1,500	2,283.00	3,424,500
白洋舎	100	2,248.00	224,800
セコム	33,500	5,316.00	178,086,000
セントラル警備保障	900	2,911.00	2,619,900
丹青社	3,500	948.00	3,318,000
メイテックグループホールディングス	6,100	2,863.50	17,467,350
応用地質	1,500	2,477.00	3,715,500
船井総研ホールディングス	3,300	2,457.00	8,108,100
オオバ	200	981.00	196,200
学究社	700	2,039.00	1,427,300
イオンディライト	1,800	4,380.00	7,884,000
ナック	1,800	579.00	1,042,200
ダイセキ	4,000	3,825.00	15,300,000
ステップ	600	2,117.00	1,270,200
合 計	30,101,252		62,839,247,968

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

## 貸借対照表

（単位：円）

	2024年 6月17日現在	2024年12月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	2,287,799,228	179,977,387
コール・ローン	4,669,439,542	6,361,177,981
株式	412,973,561,923	452,009,995,831
投資証券	7,633,035,032	8,379,453,099
派生商品評価勘定	136,347,249	150,070,337
未収入金	5,687,657	47,273,697
未収配当金	445,848,034	374,920,661
未収利息	10,538	40,880
差入委託証拠金	697,047,301	725,238,705
流動資産合計	428,848,776,504	468,228,148,578
資産合計		
	428,848,776,504	468,228,148,578
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,091,535	25,605,293
未払金	2,119,499,366	657,135
未払解約金	115,627,728	146,762,694
流動負債合計	2,247,218,629	173,025,122
負債合計		
	2,247,218,629	173,025,122
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	63,890,308,192	64,927,121,230
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	362,711,249,683	403,128,002,226

	2024年 6月17日現在	2024年12月16日現在
元本等合計	426,601,557,875	468,055,123,456
純資産合計	426,601,557,875	468,055,123,456
負債純資産合計	428,848,776,504	468,228,148,578

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

	2024年 6月17日現在	2024年12月16日現在
1. 期首	2023年12月16日	2024年 6月18日
期首元本額	61,539,821,052円	63,890,308,192円
期首からの追加設定元本額	5,907,299,398円	4,570,142,771円
期首からの一部解約元本額	3,556,812,258円	3,533,329,733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）	35,569,339,131円	36,570,649,846円
DCインデックスバランス（株式20）	97,765,501円	96,494,672円
DCインデックスバランス（株式40）	284,851,081円	277,025,680円
DCインデックスバランス（株式60）	640,667,893円	632,513,578円
DCインデックスバランス（株式80）	828,232,393円	822,671,548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	1,013,764,879円	933,682,758円
日興五大陸株式ファンド	3,401,444,973円	3,324,903,285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）	61,501,442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）	5,606,177,694円	5,618,460,283円
グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	7,427,646,928円	6,465,341,472円
Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	14,488,505円	23,435,091円
インデックスファンドMSCIオール・カンントリー（全世界株式）	3,052,926,149円	4,264,717,059円
Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）	515,065,720円	649,283,931円
Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	432,130円	587,569円
Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	193,460円	249,594円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,059,413,705円	916,329,318円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	12,875,139円	11,998,050円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	40,127,956円	38,129,860円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	66,554,202円	63,284,584円

	2024年 6月17日現在	2024年12月16日現在
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	68,168,612円	65,353,338円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,128,670,699円	4,089,964,312円
計	63,890,308,192円	64,927,121,230円
2. 受益権の総数	63,890,308,192口	64,927,121,230口

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

	自 2023年12月16日 至 2024年 6月17日	自 2024年 6月18日 至 2024年12月16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

	2024年 6月17日現在	2024年12月16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）

（2024年 6月17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	82,187,607,620
投資証券	1,159,952,150
合計	83,347,559,770

（2024年12月16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	16,533,754,058

投資証券	315,667,932
合計	16,218,086,126

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2024年 6月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	6,250,261,782	-	6,319,481,048	69,219,266
合計		6,250,261,782	-	6,319,481,048	69,219,266

(2024年12月16日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	7,760,393,136	-	7,817,827,085	57,433,949
合計		7,760,393,136	-	7,817,827,085	57,433,949

(注) 1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(2024年 6月17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	5,359,601,749	-	5,414,637,207	55,035,458
	米ドル	4,312,122,720	-	4,362,460,480	50,337,760
	ユーロ	919,219,217	-	923,915,715	4,696,498
	英ポンド	66,942,380	-	66,946,634	4,254
	スイスフラン	41,202,275	-	41,202,158	117
	デンマーククローネ	20,115,157	-	20,112,220	2,937
	売建	11,087,725	-	11,086,735	990
	香港ドル	11,087,725	-	11,086,735	990
合計		5,370,689,474	-	5,425,723,942	55,036,448

(2024年12月16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	6,822,018,835	-	6,889,056,750	67,037,915
	米ドル	5,977,684,730	-	6,042,277,350	64,592,620
	ユーロ	844,334,105	-	846,779,400	2,445,295
	売建	93,921,000	-	93,927,820	6,820
	米ドル	61,556,000	-	61,551,760	4,240
	ユーロ	32,365,000	-	32,376,060	11,060
合計		6,915,939,835	-	6,982,984,570	67,031,095

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

2024年 6月17日現在		2024年12月16日現在	
1口当たり純資産額	6.6771円	1口当たり純資産額	7.2089円
(1万口当たり純資産額)	(66,771円)	(1万口当たり純資産額)	(72,089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	22.86	431,825.40	
	BAKER HUGHES CO	44,165	42.15	1,861,554.75	
	CHENIERE ENERGY INC	9,880	213.06	2,105,032.80	
	CHEVRON CORP	76,051	153.87	11,701,967.37	
	CONOCOPHILLIPS	58,052	101.02	5,864,413.04	
	COTERRA ENERGY INC	32,460	25.33	822,211.80	
	DEVON ENERGY CORPORATION	25,260	33.88	855,808.80	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,580	163.34	1,238,117.20	
	EOG RESOURCES INC	25,002	126.77	3,169,503.54	
	EQT CORP	23,250	45.59	1,059,967.50	
	EXPAND ENERGY CORP	8,220	98.53	809,916.60	



EXXON MOBIL CORP	195,039	110.84	21,618,122.76
HALLIBURTON CO	37,607	28.68	1,078,568.76
HESS CORP	12,110	140.20	1,697,822.00
HF SINCLAIR CORP	5,940	37.45	222,453.00
KINDER MORGAN INC	88,560	26.88	2,380,492.80
MARATHON PETROLEUM CORP	15,742	145.56	2,291,405.52
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	28,351	47.64	1,350,641.64
ONEOK INC	25,810	104.03	2,685,014.30
OVINTIV INC	13,280	40.51	537,972.80
PHILLIPS 66	18,855	122.72	2,313,885.60
SCHLUMBERGER LTD	60,961	40.22	2,451,851.42
TARGA RESOURCES CORP	9,510	184.62	1,755,736.20
TEXAS PACIFIC LAND CORP	835	1,198.97	1,001,139.95
VALERO ENERGY CORP	14,682	129.14	1,896,033.48
WILLIAMS COS INC	53,564	54.43	2,915,488.52
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,925	312.30	3,099,577.50
ALBEMARLE CORP	4,750	99.38	472,055.00
AMCOR PLC	65,600	9.90	649,440.00
AVERY DENNISON CORP	3,040	195.14	593,225.60
BALL CORP	14,380	58.24	837,491.20
CELANESE CORP	4,090	68.58	280,492.20
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,820	89.50	699,890.00
CORTEVA INC	29,832	59.49	1,774,705.68
CRH PLC	29,300	97.92	2,869,056.00
CROWN HOLDINGS INC	5,525	87.88	485,537.00
DOW INC	31,205	40.86	1,275,036.30
DUPONT DE NEMOURS INC	19,162	80.84	1,549,056.08
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,815	98.50	474,277.50
ECOLAB INC	11,060	250.20	2,767,212.00
FREEMONT-MCMORAN INC	61,328	41.59	2,550,631.52
INTERNATIONAL PAPER CO	13,670	55.54	759,231.80
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,755	87.40	1,027,387.00
LINDE PLC	20,895	435.30	9,095,593.50
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,860	75.67	973,116.20
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,720	550.92	1,498,502.40
MOSAIC CO/THE	13,580	26.79	363,808.20
NEWMONT CORP	49,002	40.22	1,970,860.44
NUCOR CORP	9,959	125.25	1,247,364.75
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,400	238.10	1,047,640.00
PPG INDUSTRIES INC	10,334	124.17	1,283,172.78
RELIANCE INC	2,770	292.16	809,283.20
RPM INTERNATIONAL INC	4,960	132.43	656,852.80
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,456	364.50	3,811,212.00

SMURFIT WESTROCK PLC	22,989	53.73	1,235,198.97
STEEL DYNAMICS INC	7,090	122.37	867,603.30
VULCAN MATERIALS CO	5,563	275.77	1,534,108.51
WESTLAKE CORP	1,360	119.46	162,465.60
3M CO	23,576	129.92	3,062,993.92
AECOM	6,650	111.51	741,541.50
AERCAP HOLDINGS NV	8,630	95.66	825,545.80
ALLEGION PLC	3,340	138.83	463,692.20
AMETEK INC	10,233	187.38	1,917,459.54
AXON ENTERPRISE INC	3,150	644.91	2,031,466.50
BOEING CO/THE	31,512	169.65	5,346,010.80
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	5,240	166.43	872,093.20
CARLISLE COS INC	2,250	420.03	945,067.50
CARRIER GLOBAL CORP	35,878	73.01	2,619,452.78
CATERPILLAR INC	21,266	380.51	8,091,925.66
CNH INDUSTRIAL NV	40,400	11.82	477,528.00
CUMMINS INC	6,175	367.51	2,269,374.25
DEERE & CO	11,485	440.44	5,058,453.40
DOVER CORP	6,030	201.01	1,212,090.30
EATON CORP PLC	17,416	356.01	6,200,270.16
EMCOR GROUP INC	2,010	479.28	963,352.80
EMERSON ELECTRIC CO	24,700	130.20	3,215,940.00
FASTENAL CO	24,326	78.47	1,908,861.22
FERGUSON ENTERPRISES INC	8,440	187.49	1,582,415.60
FORTIVE CORP	14,854	76.86	1,141,678.44
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	5,050	75.85	383,042.50
GE VERNOVA INC	11,966	332.01	3,972,831.66
GENERAL DYNAMICS CORP	10,037	263.11	2,640,835.07
GENERAL ELECTRIC CO	47,607	166.01	7,903,238.07
GRACO INC	8,120	87.93	713,991.60
HEICO CORP	1,800	256.89	462,402.00
HEICO CORP-CLASS A	3,120	200.71	626,215.20
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	28,216	227.62	6,422,525.92
HOWMET AEROSPACE INC	17,943	113.43	2,035,274.49
HUBBELL INC	2,320	453.62	1,052,398.40
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,530	192.14	293,974.20
IDEX CORP	3,640	223.00	811,720.00
ILLINOIS TOOL WORKS	12,835	272.11	3,492,531.85
INGERSOLL-RAND INC	16,398	101.10	1,657,837.80
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,570	43.29	284,415.30
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	29,834	82.63	2,465,183.42
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	8,190	223.16	1,827,680.40
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,385	664.50	920,332.50

LOCKHEED MARTIN CORP	9,336	494.65	4,618,052.40
MASCO CORP	9,849	78.76	775,707.24
NORDSON CORP	2,345	226.46	531,048.70
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,154	480.00	2,953,920.00
OTIS WORLDWIDE CORP	17,124	97.79	1,674,555.96
OWENS CORNING	3,550	191.40	679,470.00
PACCAR INC	21,896	113.01	2,474,466.96
PARKER HANNIFIN CORP	5,655	671.82	3,799,142.10
PENTAIR PLC	6,918	107.16	741,332.88
QUANTA SERVICES INC	6,380	337.60	2,153,888.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,178	297.20	1,538,901.60
RTX CORP	58,626	117.75	6,903,211.50
SMITH (A.O.) CORP	5,020	72.49	363,899.80
SNAP-ON INC	2,525	355.11	896,652.75
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,226	82.80	598,312.80
TEXTRON INC	7,956	80.92	643,799.52
TORO CO	4,950	88.32	437,184.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,976	399.36	3,984,015.36
TRANSDIGM GROUP INC	2,460	1,259.12	3,097,435.20
UNITED RENTALS INC	2,905	778.82	2,262,472.10
VERTIV HOLDINGS CO	15,630	125.78	1,965,941.40
WABTEC CORP	7,770	199.68	1,551,513.60
WATSCO INC	1,540	509.72	784,968.80
MW GRAINGER INC	1,847	1,142.62	2,110,419.14
XYLEM INC	10,898	120.60	1,314,298.80
AUTOMATIC DATA PROCESSING	17,901	296.76	5,312,300.76
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,910	134.46	794,658.60
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	5,230	233.53	1,221,361.90
CINTAS CORP	15,528	211.22	3,279,824.16
COPART INC	37,560	61.23	2,299,798.80
DAYFORCE INC	7,010	77.17	540,961.70
EQUIFAX INC	5,024	265.81	1,335,429.44
JACOBS SOLUTIONS INC	5,870	136.99	804,131.30
LEIDOS HOLDINGS INC	5,950	153.16	911,302.00
PAYCHEX INC	14,002	140.98	1,974,001.96
PAYCOM SOFTWARE INC	2,415	234.50	566,317.50
REPUBLIC SERVICES INC	9,560	208.97	1,997,753.20
ROLLINS INC	12,745	48.77	621,573.65
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	76.67	649,394.90
TRANSUNION	7,940	98.43	781,534.20
VERALTO CORP	11,363	104.22	1,184,251.86
VERISK ANALYTICS INC	6,310	283.35	1,787,938.50
WASTE CONNECTIONS INC	11,606	179.95	2,088,499.70

WASTE MANAGEMENT INC	17,644	213.20	3,761,700.80
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,930	111.38	549,103.40
CSX CORP	84,959	33.24	2,824,037.16
DELTA AIR LINES INC	8,345	61.52	513,384.40
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,467	118.51	766,404.17
FEDEX CORP	10,298	283.42	2,918,659.16
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	77,000	5.13	395,010.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,750	179.79	674,212.50
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,140	55.43	340,340.20
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,745	246.22	2,399,413.90
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,450	200.69	1,695,830.50
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	33.02	180,619.40
U-HAUL HOLDING CO	3,375	66.68	225,045.00
UBER TECHNOLOGIES INC	82,790	59.93	4,961,604.70
UNION PACIFIC CORP	26,476	234.98	6,221,330.48
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	32,167	128.76	4,141,822.92
APTIV PLC	12,290	57.97	712,451.30
FORD MOTOR COMPANY	170,845	10.39	1,775,079.55
GENERAL MOTORS CORP	50,335	52.53	2,644,097.55
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	39,110	14.37	562,010.70
TESLA INC	126,275	436.23	55,084,943.25
DECKERS OUTDOOR CORP	6,980	206.63	1,442,277.40
DR HORTON INC	12,896	149.87	1,932,723.52
GARMIN LTD	7,025	215.40	1,513,185.00
LENNAR CORP-CL A	10,040	154.39	1,550,075.60
LULULEMON ATHLETICA INC	5,130	391.63	2,009,061.90
NIKE INC -CL B	52,908	77.25	4,087,143.00
NVR INC	138	8,587.63	1,185,092.94
PULTE GROUP INC	8,850	118.42	1,048,017.00
AIRBNB INC-CLASS A	18,550	130.95	2,429,122.50
BOOKING HOLDINGS INC	1,473	5,227.61	7,700,269.53
CARNIVAL CORP	43,817	25.90	1,134,860.30
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	60,100	64.59	3,881,859.00
DARDEN RESTAURANTS INC	4,853	166.69	808,946.57
DOMINO'S PIZZA INC	1,375	453.17	623,108.75
DOORDASH INC - A	12,760	175.09	2,234,148.40
DRAFTKINGS INC-CL A	20,420	39.88	814,349.60
EXPEDIA GROUP INC	5,582	183.00	1,021,506.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	7,820	277.71	2,171,692.20
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,650	252.76	2,691,894.00
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,680	158.99	267,103.20
LAS VEGAS SANDS CORP	16,310	53.87	878,619.70
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,673	287.08	3,064,004.84

MCDONALD'S CORP	31,321	296.60	9,289,808.60
MGM RESORTS INTERNATIONAL	10,530	36.25	381,712.50
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,718	245.17	2,627,732.06
STARBUCKS CORP	50,054	97.42	4,876,260.68
WYNN RESORTS LTD	4,180	94.53	395,135.40
YUM! BRANDS INC	12,704	137.00	1,740,448.00
ALPHABET INC-CL A	257,380	189.82	48,855,871.60
ALPHABET INC-CL C	221,030	191.38	42,300,721.40
CHARTER COMMUNICATION-A	4,181	379.78	1,587,860.18
COMCAST CORP-CLASS A	170,594	39.92	6,810,112.48
ELECTRONIC ARTS INC	10,834	157.62	1,707,655.08
FOX CORP - CLASS A	11,624	47.08	547,257.92
FOX CORP- CLASS B	5,466	44.72	244,439.52
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,096	29.89	451,219.44
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	10,280	95.09	977,525.20
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	7,630	135.95	1,037,298.50
MATCH GROUP INC	10,912	31.45	343,182.40
META PLATFORMS INC-CLASS A	95,990	620.35	59,547,396.50
NETFLIX INC	18,870	918.87	17,339,076.90
NEWS CORP - CLASS A	14,750	28.61	421,997.50
OMNICOM GROUP	9,397	90.32	848,737.04
PINTEREST INC- CLASS A	27,330	30.65	837,664.50
ROBLOX CORP -CLASS A	21,110	59.60	1,258,156.00
ROKU INC	6,620	82.99	549,393.80
SEA LTD-ADR	16,470	116.47	1,918,260.90
SNAP INC - A	45,300	11.31	512,343.00
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	6,660	483.31	3,218,844.60
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,240	185.48	1,342,875.20
THE WALT DISNEY CO.	79,512	113.34	9,011,890.08
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	19,370	132.42	2,564,975.40
WARNER BROS DISCOVERY INC	94,890	12.07	1,145,322.30
AMAZON.COM INC	414,810	227.46	94,352,682.60
AUTOZONE INC	722	3,370.27	2,433,334.94
BEST BUY CO INC	7,814	87.60	684,506.40
BURLINGTON STORES INC	2,935	289.97	851,061.95
CARMAX INC	6,969	86.26	601,145.94
CARVANA CO	4,950	248.25	1,228,837.50
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,600	223.39	580,814.00
EBAY INC	21,897	63.84	1,397,904.48
GENUINE PARTS CO	5,751	121.22	697,136.22
GLOBAL-E ONLINE LTD	5,190	56.46	293,027.40
HOME DEPOT INC	43,555	416.98	18,161,563.90
LKQ CORP	10,260	37.98	389,674.80

LOWE'S COS INC	24,952	262.39	6,547,155.28
MERCADOLIBRE INC	2,020	1,823.86	3,684,197.20
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,610	1,270.60	3,316,266.00
POOL CORP	1,540	362.95	558,943.00
ROSS STORES INC	14,742	153.53	2,263,339.26
TJX COMPANIES INC	49,656	124.85	6,199,551.60
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,530	285.45	1,293,088.50
ULTA BEAUTY INC	2,100	424.11	890,631.00
WILLIAMS-SONOMA INC	6,000	195.63	1,173,780.00
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	17,570	19.50	342,615.00
COSTCO WHOLESALE CORP	19,484	989.35	19,276,495.40
DOLLAR GENERAL CORP	9,855	76.94	758,243.70
DOLLAR TREE INC	8,986	70.09	629,828.74
KROGER CO	30,580	62.06	1,897,794.80
SYSCO CORP	20,636	79.96	1,650,054.56
TARGET CORP	19,870	134.52	2,672,912.40
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	30,782	10.39	319,824.98
WALMART INC	194,396	94.25	18,321,823.00
ALTRIA GROUP INC	74,608	54.92	4,097,471.36
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,143	52.40	1,160,293.20
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	8,490	44.98	381,880.20
BUNGE GLOBAL SA	5,847	82.65	483,254.55
COCA-COLA CO/THE	179,172	63.12	11,309,336.64
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	10,150	78.86	800,429.00
CONAGRA BRANDS INC	20,640	28.20	582,048.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,870	239.66	1,646,464.20
GENERAL MILLS INC	25,189	66.69	1,679,854.41
HERSHEY CO/THE	6,245	183.10	1,143,459.50
HORMEL FOODS CORP	15,290	32.94	503,652.60
JM SMUCKER CO/THE	4,100	113.53	465,473.00
KELLANOVA	12,848	80.56	1,035,034.88
KEURIG DR PEPPER INC	46,480	33.55	1,559,404.00
KRAFT HEINZ CO/THE	38,121	31.69	1,208,054.49
LAMB WESTON HOLDING INC	6,150	79.27	487,510.50
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,420	80.56	839,435.20
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,570	61.07	462,299.90
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	58,795	61.93	3,641,174.35
MONSTER BEVERAGE CORP	31,880	52.76	1,681,988.80
PEPSICO INC	60,041	157.97	9,484,676.77
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	68,478	126.62	8,670,684.36
THE CAMPBELL'S COMPANY	7,885	42.99	338,976.15
TYSON FOODS INC-CL A	12,336	60.48	746,081.28
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,310	105.64	1,089,148.40

CLOROX COMPANY	5,266	164.90	868,363.40
COLGATE-PALMOLIVE CO	33,970	93.44	3,174,156.80
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	10,080	80.04	806,803.20
KENVUE INC	85,740	22.21	1,904,285.40
KIMBERLY-CLARK CORP	14,753	131.34	1,937,659.02
PROCTER & GAMBLE CO	102,649	171.06	17,559,137.94
ABBOTT LABORATORIES	76,636	113.38	8,688,989.68
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,060	235.39	720,293.40
BAXTER INTERNATIONAL INC	23,599	30.32	715,521.68
BECTON DICKINSON AND CO	12,277	225.56	2,769,200.12
BOSTON SCIENTIFIC CORP	64,678	90.11	5,828,134.58
CARDINAL HEALTH INC	10,305	118.10	1,217,020.50
CENCORA INC	7,964	232.24	1,849,559.36
CENTENE CORP	22,367	59.42	1,329,047.14
CIGNA GROUP/THE	12,320	281.86	3,472,515.20
COOPER COS INC/THE	9,240	94.85	876,414.00
CVS HEALTH CORP	54,808	49.37	2,705,870.96
DAVITA INC	2,108	152.73	321,954.84
DEXCOM INC	16,520	77.19	1,275,178.80
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	26,110	73.32	1,914,385.20
ELEVANCE HEALTH INC	10,191	381.41	3,886,949.31
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	19,125	81.10	1,551,037.50
HCA HEALTHCARE INC	8,580	313.93	2,693,519.40
HENRY SCHEIN INC	5,280	76.60	404,448.00
HOLOGIC INC	9,858	73.65	726,041.70
HUMANA INC	5,055	274.12	1,385,676.60
IDEXX LABORATORIES INC	3,720	432.10	1,607,412.00
INSULET CORP	2,745	269.34	739,338.30
INTUITIVE SURGICAL INC	15,655	539.58	8,447,124.90
LABCORP HOLDINGS INC	4,005	232.01	929,200.05
MCKESSON CORP	5,699	576.24	3,283,991.76
MEDTRONIC PLC	56,468	82.48	4,657,480.64
MOLINA HEALTHCARE INC	2,655	303.02	804,518.10
QUEST DIAGNOSTICS	5,276	155.00	817,780.00
RESMED INC	6,510	238.52	1,552,765.20
SOLVENTUM CORP	5,894	69.56	409,986.64
STERIS PLC	4,240	214.22	908,292.80
STRYKER CORP	15,023	374.60	5,627,615.80
TELEFLEX INC	2,290	180.14	412,520.60
UNITEDHEALTH GROUP INC	40,590	520.48	21,126,283.20
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,720	187.40	509,728.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	6,870	228.78	1,571,718.60
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,902	106.74	1,056,939.48

ABBVIE INC	77,706	173.37	13,471,889.22
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,750	139.00	1,772,250.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,760	245.44	1,413,734.40
AMGEN INC	23,681	270.62	6,408,552.22
AVANTOR INC	27,110	22.33	605,366.30
BIO-RAD LABORATORIES-A	950	336.28	319,466.00
BIO-TECHNE CORP	6,730	75.69	509,393.70
BIOGEN INC	6,663	150.03	999,649.89
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,380	66.01	553,163.80
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	89,085	55.78	4,969,161.30
CATALENT INC	7,860	63.07	495,730.20
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,420	190.46	460,913.20
DANAHER CORP	28,959	234.89	6,802,179.51
ELI LILLY & CO	35,499	789.12	28,012,970.88
EXACT SCIENCES CORP	7,370	61.25	451,412.50
GILEAD SCIENCES INC	54,724	91.85	5,026,673.02
ILLUMINA INC	6,855	143.87	986,228.85
INCYTE CORP	7,670	68.55	525,778.50
IQVIA HOLDINGS INC	8,208	199.06	1,633,884.48
JOHNSON & JOHNSON	105,361	146.62	15,448,029.82
MERCK & CO. INC.	110,063	102.00	11,226,426.00
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	965	1,276.98	1,232,285.70
MODERNA INC	14,425	41.83	603,397.75
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,120	126.70	522,004.00
PFIZER INC	246,490	25.58	6,305,214.20
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,730	731.30	3,459,049.00
REVVITY INC	4,910	115.94	569,265.40
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,800	24.84	466,992.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	49,020	16.50	808,830.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	16,719	526.89	8,809,073.91
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,900	361.81	687,439.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,355	463.73	5,265,654.15
VIATRIS INC	53,899	12.63	680,744.37
WATERS CORP	2,661	378.26	1,006,549.86
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,320	330.05	1,095,766.00
ZOETIS INC	20,055	178.18	3,573,399.90
BANK OF AMERICA CORP	306,329	45.67	13,990,045.43
CITIGROUP INC	83,287	71.01	5,914,209.87
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,310	45.70	882,467.00
FIFTH THIRD BANCORP	29,319	45.55	1,335,480.45
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	450	2,086.91	939,109.50
HUNTINGTON BANCSHARES INC	61,450	17.17	1,055,096.50
JPMORGAN CHASE & CO	124,950	239.94	29,980,503.00



KEYCORP	36,108	18.13	654,638.04
M & T BANK CORP	7,483	199.29	1,491,287.07
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	17,350	201.50	3,496,025.00
REGIONS FINANCIAL CORP	40,884	25.11	1,026,597.24
TRUIST FINANCIAL CORP	59,360	45.78	2,717,500.80
US BANCORP	69,161	51.03	3,529,285.83
WELLS FARGO & CO	151,810	70.44	10,693,496.40
ALLY FINANCIAL INC	12,240	37.68	461,203.20
AMERICAN EXPRESS CO	25,014	302.14	7,557,729.96
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,225	549.76	2,322,736.00
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	16,940	176.43	2,988,724.20
ARES MANAGEMENT CORP-A	8,510	182.45	1,552,649.50
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	32,742	78.83	2,581,051.86
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	57,975	457.90	26,546,752.50
BLACKROCK INC	6,455	1,056.54	6,819,965.70
BLACKSTONE INC	31,770	188.42	5,986,103.40
BLOCK INC	25,180	91.98	2,316,056.40
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,005	184.53	3,137,932.65
CARLYLE GROUP INC/THE	11,690	52.64	615,361.60
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,570	200.98	918,478.60
CME GROUP INC	15,880	237.19	3,766,577.20
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	8,570	310.58	2,661,670.60
COREBRIDGE FINANCIAL INC	12,150	30.69	372,883.50
CORPAY INC	2,880	357.07	1,028,361.60
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,750	176.00	1,892,000.00
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,420	47.47	684,517.40
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,590	488.74	777,096.60
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	24,878	84.10	2,092,239.80
FISERV INC	25,424	204.66	5,203,275.84
FRANKLIN RESOURCES INC	11,755	21.97	258,257.35
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	86.54	216,350.00
GLOBAL PAYMENTS INC	10,989	114.21	1,255,053.69
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,053	585.48	8,227,750.44
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	25,020	155.58	3,892,611.60
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,200	179.80	575,360.00
KKR & CO INC -A	27,540	154.34	4,250,523.60
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,185	330.23	1,051,782.55
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,545	233.73	361,112.85
MASTERCARD INC - A	36,260	529.00	19,181,540.00
MOODY'S CORP	7,072	489.02	3,458,349.44
MORGAN STANLEY	53,133	127.40	6,769,144.20
MSCI INC	3,545	625.10	2,215,979.50
NASDAQ INC	19,695	80.12	1,577,963.40

NORTHERN TRUST CORP	9,930	104.98	1,042,451.40
PAYPAL HOLDINGS INC	42,267	91.02	3,847,142.34
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,470	160.49	1,359,350.30
ROBINHOOD MARKETS INC - A	23,380	40.20	939,876.00
S&P GLOBAL INC	14,110	505.75	7,136,132.50
SCHWAB (CHARLES) CORP	70,483	79.54	5,606,217.82
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,375	85.83	375,506.25
STATE STREET CORP	12,947	100.46	1,300,655.62
SYNCHRONY FINANCIAL	17,560	68.06	1,195,133.60
T ROWE PRICE GROUP INC	10,315	119.54	1,233,055.10
TOAST INC-CLASS A	16,230	38.13	618,849.90
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,200	131.50	552,300.00
VISA INC-CLASS A SHARES	73,362	314.74	23,089,955.88
AFLAC INC	23,424	104.52	2,448,276.48
ALLSTATE CORP	11,683	196.26	2,292,905.58
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,660	139.91	372,160.60
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	29,545	72.87	2,152,944.15
AON PLC	8,567	361.19	3,094,314.73
ARCH CAPITAL GROUP LTD	16,205	93.42	1,513,871.10
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,840	284.59	3,084,955.60
ASSURANT INC	2,470	217.83	538,040.10
BROWN & BROWN INC	10,940	104.19	1,139,838.60
CHUBB LTD	16,725	276.09	4,617,605.25
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,350	152.22	1,118,817.00
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,090	420.78	458,650.20
EVEREST GROUP LTD	1,989	362.81	721,629.09
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	11,071	59.96	663,817.16
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,382	112.08	1,387,774.56
LOEWS CORP	8,155	84.18	686,487.90
MARKEL GROUP INC	530	1,735.79	919,968.70
MARSH & MCLENNAN COS	21,548	215.07	4,634,328.36
METLIFE INC	26,335	82.99	2,185,541.65
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,520	78.91	751,223.20
PROGRESSIVE CORP	25,820	251.80	6,501,476.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,962	120.48	1,802,621.76
TRAVELERS COS INC/THE	10,189	246.30	2,509,550.70
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,638	311.39	1,444,226.82
WR BERKLEY CORP	12,136	60.76	737,383.36
ACCENTURE PLC-CL A	27,513	358.68	9,868,362.84
ADOBE INC	19,279	465.69	8,978,037.51
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,030	99.24	598,417.20
ANSYS INC	3,935	340.24	1,338,844.40
APPROVIN CORP-CLASS A	8,930	324.47	2,897,517.10

ASPEN TECHNOLOGY INC	1,300	248.80	323,440.00
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	6,850	278.65	1,908,752.50
AUTODESK INC	9,390	303.77	2,852,400.30
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	8,020	47.13	377,982.60
CADENCE DESIGN SYS INC	11,820	306.75	3,625,785.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,840	187.77	721,036.80
CLOUDFLARE INC-CLASS A	13,050	113.60	1,482,480.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	21,758	80.06	1,741,945.48
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,980	368.02	3,672,839.60
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,920	313.36	601,651.20
DATADOG INC-CLASS A	11,930	153.03	1,825,647.90
DOCUSIGN INC	8,320	94.48	786,073.60
DYNATRACE INC	12,980	54.41	706,241.80
EPAM SYSTEMS INC	2,500	244.64	611,600.00
FAIR ISAAC CORP	1,090	2,168.89	2,364,090.10
FORTINET INC	28,035	97.95	2,746,028.25
GARTNER INC	3,340	508.46	1,698,256.40
GEN DIGITAL INC	24,365	29.86	727,538.90
GODADDY INC-CLASS A	6,020	206.78	1,244,815.60
HUBSPOT INC	2,075	721.86	1,497,859.50
INTL BUSINESS MACHINES CORP	40,572	230.82	9,364,829.04
INTUIT INC	12,351	656.45	8,107,813.95
MANHATTAN ASSOCIATES INC	2,840	298.17	846,802.80
MICROSOFT CORP	310,054	447.27	138,677,852.58
MICROSTRATEGY INC-CL A	8,170	408.67	3,338,833.90
MONDAY.COM LTD	1,740	273.08	475,159.20
MONGODB INC	3,420	267.19	913,789.80
NUTANIX INC - A	10,900	66.05	719,945.00
OKTA INC	7,610	81.99	623,943.90
ORACLE CORP	73,153	173.39	12,683,998.67
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	89,190	76.07	6,784,683.30
PALO ALTO NETWORKS INC	14,225	393.12	5,592,132.00
PTC INC	5,250	198.68	1,043,070.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,620	543.66	2,511,709.20
SALESFORCE INC	42,146	354.31	14,932,749.26
SAMSARA INC-CL A	9,840	46.08	453,427.20
SERVICENOW INC	9,070	1,121.10	10,168,377.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	13,300	167.67	2,230,011.00
SYNOPSYS INC	6,732	508.28	3,421,740.96
TWILIO INC - A	7,225	112.98	816,280.50
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,110	611.65	1,290,581.50
VERISIGN INC	4,160	197.40	821,184.00
WIX.COM LTD	2,280	219.61	500,710.80

WORKDAY INC-CLASS A	9,170	273.67	2,509,553.90
ZOOM COMMUNICATIONS INC	11,170	83.79	935,934.30
ZSCALER INC	3,630	198.54	720,700.20
AMPHENOL CORP-CL A	53,280	73.63	3,923,006.40
APPLE INC	667,364	248.13	165,593,029.32
ARISTA NETWORKS INC	46,760	112.37	5,254,421.20
CDW CORP/DE	5,895	176.06	1,037,873.70
CISCO SYSTEMS INC	174,560	58.62	10,232,707.20
CORNING INC	36,848	48.15	1,774,231.20
DELL TECHNOLOGIES -C	13,952	118.45	1,652,614.40
F5 INC	2,385	261.81	624,416.85
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	57,545	21.83	1,256,207.35
HP INC	43,415	34.55	1,499,988.25
JABIL INC	5,160	135.13	697,270.80
JUNIPER NETWORKS INC	13,453	37.23	500,855.19
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,630	166.50	1,270,395.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,290	469.79	3,424,769.10
NETAPP INC	9,416	121.95	1,148,281.20
PURE STORAGE INC - CLASS A	13,200	63.70	840,840.00
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	9,164	95.75	877,453.00
SUPER MICRO COMPUTER INC	22,800	36.45	831,060.00
TE CONNECTIVITY PLC	13,715	150.09	2,058,484.35
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,020	475.05	959,601.00
TRIMBLE INC	11,410	73.59	839,661.90
WESTERN DIGITAL CORP	14,028	65.12	913,503.36
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,435	403.59	982,741.65
AT&T INC	311,337	23.63	7,356,893.31
T-MOBILE US INC	22,969	231.94	5,327,429.86
VERIZON COMMUNICATIONS INC	182,727	42.28	7,725,697.56
AES CORP	27,958	13.35	373,239.30
ALLIANT ENERGY CORP	12,150	60.45	734,467.50
AMEREN CORPORATION	12,892	89.84	1,158,217.28
AMERICAN ELECTRIC POWER	22,348	92.71	2,071,883.08
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,295	129.59	1,204,539.05
ATMOS ENERGY CORP	6,760	140.58	950,320.80
CENTERPOINT ENERGY INC	31,272	31.94	998,827.68
CMS ENERGY CORP	12,560	67.32	845,539.20
CONSOLIDATED EDISON INC	14,746	92.69	1,366,806.74
CONSTELLATION ENERGY	13,908	239.07	3,324,985.56
DOMINION ENERGY INC	36,341	54.04	1,963,867.64
DTE ENERGY COMPANY	8,318	121.28	1,008,807.04
DUKE ENERGY CORP	33,776	108.82	3,675,504.32
EDISON INTERNATIONAL	16,329	81.89	1,337,181.81

ENERGY CORP	9,247	74.24	686,497.28
ENERGY CORP(N)	9,247	74.24	686,497.28
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,210	38.69	433,714.90
EVERGY INC	8,720	61.91	539,855.20
EVERSOURCE ENERGY	17,540	59.52	1,043,980.80
EXELON CORP	43,056	36.87	1,587,474.72
FIRSTENERGY CORP	23,295	40.27	938,089.65
NEXTERA ENERGY INC	90,160	73.62	6,637,579.20
NISOURCE INC	23,010	36.55	841,015.50
NRG ENERGY INC	9,770	94.98	927,954.60
P G & E CORP	85,070	19.75	1,680,132.50
PPL CORP	30,338	32.29	979,614.02
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	22,058	86.81	1,914,854.98
SEMPRA	27,094	89.16	2,415,701.04
SOUTHERN CO	48,385	83.20	4,025,632.00
VISTRA CORP	14,720	144.89	2,132,780.80
WEC ENERGY GROUP INC	14,270	95.74	1,366,209.80
XCEL ENERGY INC	25,054	68.12	1,706,678.48
ADVANCED MICRO DEVICES	71,264	126.91	9,044,114.24
ANALOG DEVICES INC	21,937	216.61	4,751,773.57
APPLIED MATERIALS INC	36,153	169.35	6,122,510.55
BROADCOM INC	194,960	224.80	43,827,008.00
ENPHASE ENERGY INC	6,430	73.84	474,791.20
ENTEGRIS INC	6,650	106.66	709,289.00
FIRST SOLAR INC	4,560	199.67	910,495.20
INTEL CORP	187,572	20.34	3,815,214.48
KLA CORP	5,909	653.76	3,863,067.84
LAM RESEARCH CORP	56,690	76.26	4,323,179.40
MARVELL TECHNOLOGY INC	38,164	120.77	4,609,066.28
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	23,418	59.93	1,403,440.74
MICRON TECHNOLOGY INC	48,257	102.50	4,946,342.50
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,200	608.44	1,338,568.00
NVIDIA CORP	1,076,510	134.25	144,521,467.50
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,887	216.84	2,360,737.08
ON SEMICONDUCTOR CORP	19,180	65.96	1,265,112.80
QORVO INC	4,240	69.59	295,061.60
QUALCOMM INC	48,472	158.53	7,684,266.16
SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,440	90.98	585,911.20
TERADYNE INC	6,880	123.22	847,753.60
TEXAS INSTRUMENTS INC	40,232	191.59	7,708,048.88
CBRE GROUP INC - A	13,850	137.30	1,901,605.00
COSTAR GROUP INC	18,730	75.07	1,406,061.10
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,500	4.56	184,680.00

	ZILLOW GROUP INC - C	6,370	79.93	509,154.10	
米ドル小計		16,130,121		2,299,084,342.74 (353,875,062,034)	
加ドル	ARC RESOURCES LTD	25,510	25.72	656,117.20	
	CAMECO CORP	19,282	77.28	1,490,112.96	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,918	44.78	4,205,648.04	
	CENOVUS ENERGY INC	68,613	21.71	1,489,588.23	
	ENBRIDGE INC	95,987	59.69	5,729,464.03	
	IMPERIAL OIL LTD	8,922	96.00	856,512.00	
	KEYERA CORP	8,460	43.42	367,333.20	
	MEG ENERGY CORP	11,500	23.73	272,895.00	
	PARKLAND CORP	6,170	34.97	215,764.90	
	PEMBINA PIPELINE CORP	26,182	54.61	1,429,799.02	
	SUNCOR ENERGY INC	53,489	52.37	2,801,218.93	
	TC ENERGY CORP	45,033	66.11	2,977,131.63	
	TOURMALINE OIL CORP	15,980	63.39	1,012,972.20	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	21,496	119.22	2,562,753.12	
	BARRICK GOLD CORP	84,324	23.90	2,015,343.60	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	74.71	429,582.50	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	19.40	439,410.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,125	170.09	1,381,981.25	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	24,510	18.13	444,366.30	
	KINROSS GOLD CORP	55,925	13.90	777,357.50	
	LUNDIN MINING CORP	25,010	12.82	320,628.20	
	NUTRIEN LTD	24,688	68.63	1,694,337.44	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	16,410	31.61	518,720.10	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	21,725	62.75	1,363,243.75	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,450	127.38	312,081.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,165	86.22	1,652,406.30	
	CAE INC	12,305	33.18	408,279.90	
	STANTEC INC	5,720	117.60	672,672.00	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,260	111.56	363,685.60	
	WSP GLOBAL INC	5,800	250.64	1,453,712.00	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	21,040	28.60	601,744.00	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	10,040	63.85	641,054.00	
	RB GLOBAL INC	7,560	135.07	1,021,129.20	
	THOMSON REUTERS CORP	7,350	239.41	1,759,663.50	
	AIR CANADA	7,190	25.04	180,037.60	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	23,418	147.89	3,463,288.02	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	41,421	105.89	4,386,069.69	
	TFI INTERNATIONAL INC	3,210	217.88	699,394.80	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	10,668	63.08	672,937.44	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,040	69.52	489,420.80	

RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	12,858	97.20	1,249,797.60
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,250	153.00	344,250.00
DOLLARAMA INC	12,990	141.84	1,842,501.60
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	34,600	80.90	2,799,140.00
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	44.69	310,595.50
LOBLAW COMPANIES LTD	6,339	193.97	1,229,575.83
METRO INC	9,570	93.06	890,584.20
WESTON (GEORGE) LTD	2,808	234.90	659,599.20
SAPUTO INC	9,620	26.22	252,236.40
BANK OF MONTREAL	30,681	141.00	4,326,021.00
BANK OF NOVA SCOTIA	52,339	78.92	4,130,593.88
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	42,300	94.20	3,984,660.00
NATIONAL BANK OF CANADA	15,290	133.91	2,047,483.90
ROYAL BANK OF CANADA	62,349	177.31	11,055,101.19
TORONTO-DOMINION BANK	76,470	75.87	5,801,778.90
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	13,859	81.74	1,132,834.66
BROOKFIELD CORP	61,179	83.56	5,112,117.24
IGM FINANCIAL INC	1,665	47.60	79,254.00
ONEX CORPORATION	2,765	115.12	318,306.80
TMX GROUP LTD	10,850	44.03	477,725.50
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	1,992.20	1,792,980.00
GREAT-WEST LIFECO INC	11,324	46.77	529,623.48
IA FINANCIAL CORP INC	4,075	133.58	544,338.50
INTACT FINANCIAL CORP	7,215	263.30	1,899,709.50
MANULIFE FINANCIAL CORP	78,291	44.07	3,450,284.37
POWER CORP OF CANADA	27,929	46.37	1,295,067.73
SUN LIFE FINANCIAL INC	24,774	85.61	2,120,902.14
CGI INC	9,510	160.22	1,523,692.20
CONSTELLATION SOFTWARE INC	870	4,659.43	4,053,704.10
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,740	170.57	637,931.80
OPEN TEXT CORP	11,190	42.00	469,980.00
SHOPIFY INC - CLASS-A	53,480	163.22	8,729,005.60
BCE INC	3,000	36.32	108,960.00
QUEBECOR INC -CL B	6,110	32.32	197,475.20
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	16,655	47.54	791,778.70
TELUS CORP	12,662	20.73	262,483.26
ALTAGAS LTD	11,170	32.83	366,711.10
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	42.34	230,541.30
CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,280	35.42	80,757.60
EMERA INC	15,550	54.66	849,963.00
FORTIS INC	22,635	60.26	1,363,985.10
HYDRO ONE LTD	13,230	44.43	587,808.90
FIRSTSERVICE CORP	1,500	267.60	401,400.00

加ドル小計		1,788,563		134,563,097.93 (14,563,764,088)
ユーロ	ENI SPA	100,696	13.29	1,338,854.01
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	18,755	17.00	318,835.00
	NESTE OYJ	18,710	12.64	236,587.95
	OMV AG	5,480	37.24	204,075.20
	REPSOL SA	54,849	11.31	620,616.43
	TENARIS SA	23,455	18.43	432,275.65
	TOTALENERGIES SE	94,227	53.36	5,027,952.72
	AIR LIQUIDE SA	25,154	159.70	4,017,093.80
	AKZO NOBEL	6,937	59.02	409,421.74
	ARCELORMITTAL	20,552	23.73	487,698.96
	ARKEMA	2,215	75.40	167,011.00
	BASF SE	39,385	44.60	1,756,767.92
	COVESTRO AG-TEND	7,410	57.50	426,075.00
	DSM-FIRMENICH AG	8,752	101.45	887,890.40
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,230	17.45	283,213.50
	HEIDELBERG MATERIALS AG	5,715	125.10	714,946.50
	STORA ENSO OYJ-R SHS	25,365	9.67	245,279.55
	SYENSQO SA	2,811	74.98	210,768.78
	SYMRISE AG	5,790	103.70	600,423.00
	UPM-KYMMENE OYJ	25,098	25.99	652,297.02
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,876	48.14	379,150.64
	AIRBUS GROUP SE	25,728	160.22	4,122,140.16
	ALSTOM	13,962	22.15	309,258.30
	BOUYGUES SA	8,460	29.07	245,932.20
	BRENTAG SE	6,865	61.08	419,314.20
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	19,106	88.78	1,696,230.68
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	21,636	37.19	804,642.84
	DASSAULT AVIATION SA	900	190.10	171,090.00
	EIFFAGE	3,250	87.12	283,140.00
	FERROVIAL SE	24,155	40.62	981,176.10
	GEA GROUP AG	6,020	48.86	294,137.20
	IMCD NV	2,120	147.70	313,124.00
KINGSPAN GROUP PLC	7,300	69.60	508,080.00	
KNORR-BREMSE AG	2,970	70.00	207,900.00	
KONE OYJ-B	13,614	48.12	655,105.68	
LEGRAND SA	11,128	95.34	1,060,943.52	
LEONARDO SPA	16,300	25.75	419,725.00	
METSO CORPORATION	24,200	8.90	215,380.00	
MTU AERO ENGINES AG	2,540	322.90	820,166.00	
PRYSMIAN SPA	12,035	61.68	742,318.80	
RATIONAL AG	230	848.00	195,040.00	



REXEL SA	11,150	24.88	277,412.00
RHEINMETALL AG	1,955	616.00	1,204,280.00
SAFRAN SA	16,220	209.10	3,391,602.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	24,118	244.70	5,901,674.60
SIEMENS AG-REG	33,516	191.38	6,414,292.08
SIEMENS ENERGY AG	28,893	48.88	1,412,289.84
THALES SA	4,405	138.00	607,890.00
VINCI SA	22,380	101.20	2,264,856.00
WARTSILA OYJ ABP	25,650	17.49	448,618.50
BUREAU VERITAS SA	16,910	30.12	509,329.20
RANDSTAD NV	4,675	42.00	196,350.00
TELEPERFORMANCE	2,240	85.34	191,161.60
WOLTERS KLUWER	11,197	162.40	1,818,392.80
ADP	1,630	113.80	185,494.00
AENA SA	3,380	199.30	673,634.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	6.75	161,190.00
DEUTSCHE POST AG-REG	46,023	35.32	1,625,532.36
GETLINK	17,310	15.62	270,382.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,355	80.16	1,070,536.80
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,150	74.35	234,202.50
CONTINENTAL AG	4,385	66.64	292,216.40
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	4,380	60.70	265,866.00
FERRARI NV	5,459	431.50	2,355,558.50
MERCEDES-BENZ GROUP AG	33,252	56.53	1,879,735.56
MICHELIN (CGDE)	30,986	32.78	1,015,721.08
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	36.01	204,176.70
RENAULT SA	8,247	44.77	369,218.19
STELLANTIS NV	98,206	13.34	1,310,853.68
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,083	88.02	799,485.66
ADIDAS AG	7,101	240.00	1,704,240.00
HERMES INTERNATIONAL	1,372	2,274.00	3,119,928.00
KERING	3,537	244.05	863,204.85
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	11,974	639.00	7,651,386.00
MONCLER SPA	10,320	51.34	529,828.80
PUMA SE	4,200	45.75	192,150.00
SEB SA	987	92.45	91,248.15
ACCOR SA	10,106	47.00	474,982.00
AMADEUS IT GROUP SA	19,870	67.40	1,339,238.00
DELIVERY HERO SE	9,610	31.63	303,964.30
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	38.04	148,356.00
SODEXO SA	3,240	80.25	260,010.00
BOLLORE SE	33,530	5.96	199,838.80
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	2,660	82.75	220,115.00

PUBLICIS GROUPE	9,305	106.80	993,774.00
SCOUT24 SE	2,970	86.95	258,241.50
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	36,410	24.46	890,588.60
D' IETEREN GROUP	1,050	165.40	173,670.00
INDITEX	45,895	50.20	2,303,929.00
PROSUS NV	62,794	40.66	2,553,518.01
ZALANDO SE	8,260	34.54	285,300.40
CARREFOUR SA	22,633	14.03	317,540.99
JERONIMO MARTINS	10,585	18.76	198,574.60
KESKO OYJ-B SHS	10,930	19.16	209,418.80
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	40,028	32.34	1,294,505.52
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	39,581	51.22	2,027,338.82
DANONE	28,534	65.24	1,861,558.16
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	30,650	6.20	190,213.90
HEINEKEN HOLDING NV	7,005	59.10	413,995.50
HEINEKEN NV	12,733	70.40	896,403.20
JDE PEET'S NV	6,290	18.80	118,252.00
KERRY GROUP PLC-A	6,460	91.40	590,444.00
LOTUS BAKERIES	20	10,920.00	218,400.00
PERNOD-RICARD SA	9,916	113.95	1,129,928.20
BEIERSDORF AG	4,375	124.70	545,562.50
HENKEL AG & CO KGAA	4,520	75.70	342,164.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,793	85.32	579,578.76
L'OREAL	10,646	343.35	3,655,304.10
AMPLIFON SPA	4,830	25.30	122,199.00
BIOMERIEUX	1,690	102.10	172,549.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	49.30	79,373.00
DIASORIN ITALIA SPA	930	102.60	95,418.00
ESSILORLUXOTTICA	12,675	231.20	2,930,460.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	9,583	45.10	432,193.30
FRESENIUS SE & CO KGAA	18,495	34.85	644,550.75
KONINKLIJKE PHILIPS NV	35,438	24.53	869,294.14
SIEMENS HEALTHINEERS AG	13,430	53.50	718,505.00
ARGENX SE	2,495	580.80	1,449,096.00
BAYER AG-REG	43,824	19.76	865,962.24
EUROFINS SCIENTIFIC	5,050	47.97	242,248.50
IPSEN	1,600	108.30	173,280.00
MERCK KGAA	5,940	141.15	838,431.00
ORION OYJ-CLASS B	4,500	41.85	188,325.00
QIAGEN N.V.	10,072	43.64	439,592.44
RECORDATI SPA	3,720	50.65	188,418.00
SANOFI	50,436	89.17	4,497,378.12
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,230	227.90	280,317.00

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	194.10	209,628.00
UCB SA	5,398	180.65	975,148.70
ABN AMRO BANK NV-CVA	23,550	14.66	345,360.75
AIB GROUP PLC	70,100	5.39	377,839.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	256,963	9.70	2,493,568.95
BANCO BPM SPA	49,000	7.84	384,454.00
BANCO DE SABADELL SA	232,000	1.92	445,440.00
BANCO SANTANDER SA	674,889	4.68	3,160,505.18
BANK OF IRELAND GROUP PLC	44,790	8.77	393,166.62
BNP PARIBAS	44,242	58.94	2,607,623.48
BPER BANCA SPA	43,200	6.22	268,876.80
CAIXABANK S.A	163,050	5.19	846,881.70
COMMERZBANK AG	46,924	15.10	708,787.02
CREDIT AGRICOLE SA	49,662	13.16	653,800.23
ERSTE GROUP BANK AG	15,328	59.08	905,578.24
FINECOBANK SPA	23,540	17.04	401,239.30
ING GROEP NV-CVA	146,925	14.83	2,180,073.15
INTESA SANPAOLO	621,793	3.92	2,441,781.11
KBC GROEP NV	11,219	73.20	821,230.80
MEDIOBANCA SPA	19,520	14.34	280,014.40
NORDEA BANK ABP	131,132	10.68	1,401,145.42
SOCIETE GENERALE	30,909	27.17	839,952.07
UNICREDIT SPA	64,276	38.93	2,502,264.68
ADYEN NV	935	1,490.20	1,393,337.00
AMUNDI SA	2,140	64.70	138,458.00
CVC CAPITAL PARTNERS PLC	9,240	21.82	201,616.80
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	80,935	17.06	1,381,074.84
DEUTSCHE BOERSE AG	8,250	222.90	1,838,925.00
EDENRED	9,626	30.70	295,518.20
EURAZEO SE	2,497	70.05	174,914.85
EURONEXT NV	3,470	107.70	373,719.00
EXOR NV	4,164	93.75	390,375.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,452	65.30	225,415.60
NEXI SPA	21,240	5.73	121,875.12
SOFINA	655	212.00	138,860.00
AEGON LTD	69,679	6.10	425,181.25
AGEAS	5,924	47.80	283,167.20
ALLIANZ SE-REG	16,943	302.10	5,118,480.30
ASR NEDERLAND NV	5,880	45.54	267,775.20
AXA SA	79,942	34.10	2,726,022.20
GENERALI	43,868	28.30	1,241,464.40
HANNOVER RUECK SE-REG	2,775	255.60	709,290.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,896	517.40	3,050,590.40

NN GROUP NV	10,270	42.49	436,372.30
POSTE ITALIANE SPA	19,560	13.84	270,808.20
SAMPO OYJ-A SHS	19,639	39.44	774,562.16
TALANX AG	2,500	85.15	212,875.00
UNIPOL GRUPPO SPA	17,100	11.86	202,806.00
BECHTLE AG	3,070	30.70	94,249.00
CAP GEMINI SA	6,509	156.00	1,015,404.00
DASSAULT SYSTEMES SE	30,390	34.97	1,062,738.30
NEMETSCHKE SE	2,350	93.80	220,430.00
SAP SE	45,962	241.05	11,079,140.10
NOKIA OYJ	251,336	4.22	1,060,763.58
CELLNEX TELECOM SA	24,690	32.32	797,980.80
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	154,166	29.80	4,594,146.80
ELISA OYJ	6,005	41.82	251,129.10
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	9.93	150,638.10
KONINKLIJKE KPN NV	204,956	3.60	739,481.24
ORANGE S.A.	83,604	9.61	803,434.44
TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.26	104,133.38
TELEFONICA SA	195,629	4.27	836,900.86
ACCIONA SA	830	113.30	94,039.00
E.ON SE	102,709	11.85	1,217,615.19
EDP RENOVAVEIS SA	11,333	9.80	111,120.06
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	126,131	3.17	399,961.40
ELIA GROUP SA/NV	1,356	79.60	107,937.60
ENDESA SA	12,050	20.64	248,712.00
ENEL SPA	344,237	6.94	2,390,037.49
ENGIE	82,214	15.22	1,251,708.15
FORTUM OYJ	16,755	13.48	225,857.40
IBERDROLA SA	268,102	13.14	3,522,860.28
REDEIA CORP SA	20,650	16.56	341,964.00
RWE AG	25,835	29.28	756,448.80
SNAM SPA	91,120	4.31	393,091.68
TERNA SPA	71,827	7.71	554,217.13
VEOLIA ENVIRONNEMENT	31,150	27.86	867,839.00
VERBUND AG	2,780	70.50	195,990.00
ASM INTERNATIONAL NV	2,105	525.80	1,106,809.00
ASML HOLDING NV	17,537	687.70	12,060,194.90
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	3,290	127.10	418,159.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	56,495	33.02	1,865,464.90
STMICROELECTRONICS NV	29,593	24.87	736,125.87
LEG IMMOBILIEN SE	3,010	83.96	252,719.60
VONOVIA SE	33,969	31.04	1,054,397.76
	8,013,522		226,630,000.18

ユーロ小計				(36,693,663,329)
英ポンド	BP PLC	722,418	3.95	2,860,414.07
	SHELL PLC-NEW	275,977	24.98	6,895,285.34
	ANGLO AMERICAN PLC	54,004	24.60	1,328,768.42
	ANTOFAGASTA PLC	17,080	16.88	288,310.40
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,131	34.40	210,906.40
	ENDEAVOUR MINING PLC	6,490	15.05	97,674.50
	GLENCORE PLC	453,603	3.71	1,683,093.93
	MONDI PLC	16,700	12.01	200,567.00
	RIO TINTO PLC	49,485	49.00	2,424,765.00
	ASHTED GROUP PLC	19,410	51.96	1,008,543.60
	BAE SYSTEMS PLC ORD	134,535	11.99	1,613,074.65
	BUNZL PLC	17,316	35.20	609,523.20
	DCC PLC	3,820	54.55	208,381.00
	MELROSE INDUSTRIES PLC	63,400	5.49	348,446.40
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	380,331	5.72	2,177,775.30
	SMITHS GROUP PLC	13,603	17.55	238,732.65
	SPIRAX GROUP PLC	2,890	71.95	207,935.50
	EXPERIAN PLC	41,518	35.99	1,494,232.82
	INTERTEK GROUP PLC	6,025	47.86	288,356.50
	RELX PLC	81,095	37.27	3,022,410.65
	RENTOKIL INITIAL PLC	115,300	4.12	476,073.70
	BARRATT REDROW PLC	76,220	4.37	333,081.40
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,356	39.90	173,804.40
	PERSIMMON PLC	12,440	12.66	157,552.60
	TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.24	154,305.91
	COMPASS GROUP PLC	72,268	26.62	1,923,774.16
	ENTAIN PLC	24,860	8.15	202,609.00
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,473	99.46	743,264.58
	PEARSON PLC	26,089	12.82	334,460.98
	WHITBREAD PLC	8,110	29.42	238,596.20
	AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	8.17	298,187.52
	INFORMA PLC	56,580	8.33	471,764.04
	WPP PLC	41,144	8.93	367,662.78
	JD SPORTS FASHION PLC	97,350	1.00	97,398.67
	KINGFISHER PLC	78,137	2.59	202,452.96
	NEXT PLC	5,667	99.04	561,259.68
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	89,100	3.97	354,350.70
	SAINSBURY (J) PLC	70,601	2.80	197,682.80
	TESCO PLC	327,158	3.72	1,217,027.76
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	15,625	21.41	334,531.25
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	84,677	29.92	2,533,535.84
	COCA-COLA HBC AG-CDI	11,230	28.02	314,664.60

DIAGEO PLC	95,292	26.18	2,495,221.02	
IMPERIAL BRANDS PLC	36,432	26.16	953,061.12	
HALEON PLC	352,151	3.81	1,343,103.91	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	30,695	48.57	1,490,856.15	
UNILEVER PLC	109,872	46.63	5,123,331.36	
NMC HEALTH PLC	8,090	-	-	
SMITH & NEPHEW PLC	33,906	9.98	338,449.69	
ASTRAZENECA PLC	68,282	104.68	7,147,759.76	
GSK PLC	182,410	13.29	2,425,140.95	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,740	19.34	111,011.60	
BARCLAYS PLC	639,751	2.69	1,723,489.19	
HSBC HOLDINGS PLC	809,191	7.66	6,200,021.44	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,769,836	0.55	1,533,935.17	
NATWEST GROUP PLC	304,835	4.05	1,236,105.92	
STANDARD CHARTERED PLC	95,420	9.96	951,146.56	
3I GROUP PLC	44,419	36.46	1,619,516.74	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	20,707	113.90	2,358,527.30	
M&G PLC	99,522	1.99	198,795.19	
SCHRODERS PLC	30,300	3.18	96,354.00	
WISE PLC - A	29,200	9.37	273,604.00	
ADMIRAL GROUP PLC	12,845	26.47	340,007.15	
AVIVA PLC	134,324	4.76	639,650.88	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	294,051	2.32	682,786.42	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,230	5.18	156,591.40	
PRUDENTIAL PLC	121,002	6.49	786,028.99	
SAGE GROUP PLC/THE	49,540	13.07	647,735.50	
HALMA PLC	14,690	27.33	401,477.70	
BT GROUP PLC	267,752	1.51	404,974.90	
VODAFONE GROUP PLC	996,528	0.69	688,600.84	
CENTRICA PLC	209,200	1.31	274,365.80	
NATIONAL GRID PLC	204,765	9.44	1,933,800.66	
SEVERN TRENT PLC	13,573	26.08	353,983.84	
SSE PLC	48,767	16.68	813,677.39	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	10.82	282,456.10	
英債券小計	11,940,209		84,920,807.50 (16,512,851,018)	
スイスフラン				
CLARIANT AG-REG	7,990	10.41	83,175.90	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	622.00	167,940.00	
GIVAUDAN-REG	423	4,021.00	1,700,883.00	
HOLCIM LTD	22,219	90.12	2,002,376.28	
SIG GROUP AG	10,900	17.87	194,783.00	
SIKA AG-REG	6,605	228.20	1,507,261.00	
ABB LTD-REG	70,005	51.60	3,612,258.00	

GEBERIT AG-REG	1,490	538.20	801,918.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,070	252.00	269,640.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	258.40	382,432.00	
VAT GROUP AG	1,295	341.60	442,372.00	
ADECCO GROUP AG-REG	6,817	22.94	156,381.98	
SGS SA-REG	5,950	90.54	538,713.00	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,480	206.60	512,368.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	23,819	136.30	3,246,529.70	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,525	164.70	251,167.50	
AVOLTA AG	3,460	37.26	128,919.60	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	130	1,285.00	167,050.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	40	9,965.00	398,600.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	99,000.00	495,000.00	
NESTLE SA-REG	114,220	75.18	8,587,059.60	
ALCON INC	22,714	75.22	1,708,547.08	
SONOVA HOLDING AG-REG	2,051	294.00	602,994.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,520	118.65	654,948.00	
BACHEM HOLDING AG	1,400	64.90	90,860.00	
GALDERMA GROUP AG	3,570	90.27	322,263.90	
LONZA GROUP AG-REG	3,243	532.80	1,727,870.40	
NOVARTIS AG-REG	86,653	87.74	7,602,934.22	
ROCHE HOLDING AG-BR	1,420	268.20	380,844.00	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	30,943	253.20	7,834,767.60	
SANDOZ GROUP AG	19,108	37.07	708,333.56	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	760	81.05	61,598.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	8,420	59.16	498,127.20	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	995	1,264.50	1,258,177.50	
UBS GROUP AG-REG	143,672	28.48	4,091,778.56	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,740	164.10	285,534.00	
HELVETIA HOLDING AG-REG	1,320	146.40	193,248.00	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,285	693.60	891,276.00	
SWISS RE AG	13,269	133.55	1,772,074.95	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,381	552.80	3,527,416.80	
TEMENOS AG	2,280	66.25	151,050.00	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	75.56	503,229.60	
SWISSCOM AG-REG	1,024	505.50	517,632.00	
BKW AG	840	150.30	126,252.00	
SWISS PRIME SITE-REG	3,441	97.35	334,981.35	
スイスフラン小計	650,902		61,493,567.28 (10,615,634,519)	
スウェーデンク ローナ				
BOLIDEN AB	10,290	326.20	3,356,598.00	
HOLMEN AB-B SHARES	3,520	417.00	1,467,840.00	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	22,680	140.70	3,191,076.00	

ADDTECH AB-B SHARES	11,400	309.60	3,529,440.00	
ALFA LAVAL AB	15,220	477.80	7,272,116.00	
ASSA ABLOY AB-B	42,940	341.70	14,672,598.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	118,720	177.05	21,019,376.00	
ATLAS COPCO AB-B SHS	67,170	156.30	10,498,671.00	
BEIJER REF AB	15,480	170.45	2,638,566.00	
EPIROC AB-A	31,565	201.00	6,344,565.00	
EPIROC AB-B	15,450	179.00	2,765,550.00	
INDUTRADE AB	10,180	283.00	2,880,940.00	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	280.30	1,906,040.00	
LIFCO AB-B SHS	8,470	336.60	2,851,002.00	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	63,000	43.74	2,755,620.00	
SAAB AB-B	11,120	231.75	2,577,060.00	
SANDVIK AB	49,820	208.50	10,387,470.00	
SKANSKA AB-B SHS	14,390	236.70	3,406,113.00	
SKF AB-B SHARES-B	14,079	218.20	3,072,037.80	
TRELLEBORG AB-B SHS	9,190	392.80	3,609,832.00	
VOLVO AB-A SHS	9,530	281.40	2,681,742.00	
VOLVO AB-B SHS-B	70,890	280.40	19,877,556.00	
SECURITAS AB-B SHS	17,788	137.85	2,452,075.80	
EVOLUTION AB	8,150	916.80	7,471,920.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,848	156.40	4,355,427.20	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	29,035	298.10	8,655,333.50	
GETINGE AB-B SHS	9,470	173.40	1,642,098.00	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	8,148	315.20	2,568,249.60	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	72,400	155.20	11,236,480.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60,120	114.10	6,859,692.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	34,550	219.10	7,569,905.00	
EQT AB	17,960	315.20	5,660,992.00	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	363.40	1,811,185.60	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	362.80	2,169,544.00	
INVESTOR AB-B SHS	75,800	296.90	22,505,020.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	3,590	514.50	1,847,055.00	
ERICSSON LM-B SHS	114,915	90.82	10,436,580.30	
HEXAGON AB-B SHS	94,990	106.90	10,154,431.00	
TELE2 AB-B SHS	23,245	113.40	2,635,983.00	
TELIA CO AB	118,530	30.61	3,628,203.30	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	23,220	77.66	1,803,265.20	
SAGAX AB-B	11,880	230.80	2,741,904.00	
スウェーデンクローナ小計	1,384,507		250,967,153.30 (3,526,088,503)	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	12,100	223.80	2,707,980.00
	EQUINOR ASA	39,014	257.55	10,048,055.70



	NORSK HYDRO A S	50,660	65.14	3,299,992.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,670	323.60	2,158,412.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,900	1,286.00	5,015,400.00	
	MOWI ASA	16,360	207.10	3,388,156.00	
	ORKLA ASA	32,290	102.30	3,303,267.00	
	SALMAR ASA	3,590	595.00	2,136,050.00	
	DNB BANK ASA	45,435	229.50	10,427,332.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,410	204.80	1,517,568.00	
	TELENOR ASA	23,915	127.30	3,044,379.50	
ノルウェークローネ小計		241,344		47,046,593.10 (650,183,916)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	16,690	417.20	6,963,068.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	315	2,598.00	818,370.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	47,690	95.62	4,560,117.80	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	115	11,560.00	1,329,400.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	195	12,050.00	2,349,750.00	
	DSV A/S	8,890	1,541.50	13,703,935.00	
	PANDORA A/S	3,310	1,275.00	4,220,250.00	
	CARLSBERG AS-B	3,910	722.60	2,825,366.00	
	COLOPLAST-B	5,685	824.40	4,686,714.00	
	DEMANT A/S	3,640	270.40	984,256.00	
	GENMAB A/S	2,920	1,438.50	4,200,420.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	141,660	754.00	106,811,640.00	
	ZEALAND PHARMA A/S	2,810	780.50	2,193,205.00	
	DANSKE BANK A/S	31,185	204.90	6,389,806.50	
	TRYG A/S	13,945	154.70	2,157,291.50	
ORSTED A/S	7,570	348.20	2,635,874.00		
デンマーククローネ小計		290,530		166,829,463.80 (3,621,867,659)	
豪ドル	SANTOS LTD	151,760	6.49	984,922.40	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	84,316	23.89	2,014,309.24	
	BHP GROUP LTD	223,457	41.17	9,199,724.69	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	20.60	377,186.00	
	FORTESCUE LTD	73,745	19.48	1,436,552.60	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	20,365	53.59	1,091,360.35	
	MINERAL RESOURCES LTD	7,320	35.80	262,056.00	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	53,090	16.44	872,799.60	
	ORICA LIMITED	17,675	17.81	314,791.75	
	RIO TINTO LTD	16,698	120.72	2,015,782.56	
	SOUTH32 LTD	207,787	3.40	706,475.80	
	REECE LTD	10,200	23.80	242,760.00	
	SGH LTD	8,410	46.07	387,448.70	
BRAMBLES LTD	54,798	19.19	1,051,573.62		

	COMPUTERSHARE LTD	20,910	33.17	693,584.70	
	QANTAS AIRWAYS LTD	35,030	8.89	311,416.70	
	TRANSURBAN GROUP	151,796	12.73	1,932,363.08	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	26,840	68.38	1,835,319.20	
	LOTTERY CORP LTD/THE	85,554	5.09	435,469.86	
	CAR GROUP LTD	14,500	38.12	552,740.00	
	REA GROUP LTD	1,820	240.06	436,909.20	
	SEEK LTD	12,860	24.56	315,841.60	
	WESFARMERS LTD	47,855	73.65	3,524,520.75	
	COLES GROUP LTD	57,925	18.70	1,083,197.50	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	82,662	4.26	352,140.12	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	54,692	30.42	1,663,730.64	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	43,206	11.74	507,238.44	
	COCHLEAR LTD	2,947	291.38	858,696.86	
	PRO MEDICUS LTD	2,450	249.63	611,593.50	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,105	36.91	262,245.55	
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	28.02	494,833.20	
	CSL LTD	21,382	277.55	5,934,574.10	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	126,149	29.13	3,674,720.37	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	73,707	158.21	11,661,184.47	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	135,333	37.57	5,084,460.81	
	WESTPAC BANKING CORP	148,101	32.17	4,764,409.17	
	ASX LTD	7,105	68.03	483,353.15	
	MACQUARIE GROUP LTD	16,084	226.22	3,638,522.48	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,370	34.80	291,276.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	8.34	793,342.50	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	108,430	3.74	405,528.20	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	70,410	18.90	1,330,749.00	
	SUNCORP GROUP LTD	55,536	19.12	1,061,848.32	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,450	121.42	904,579.00	
	XERO LTD	5,960	169.01	1,007,299.60	
	TELSTRA GROUP LTD	164,284	4.00	657,136.00	
	APA GROUP	69,418	7.31	507,445.58	
	ORIGIN ENERGY LTD	93,120	10.41	969,379.20	
	豪ドル小計	2,819,707		79,999,392.16 (7,842,340,413)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	83,065	8.20	681,133.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,130	36.80	851,184.00	
	INFRATIL LTD	39,900	12.06	481,194.00	
	MERCURY NZ LTD	34,100	5.72	195,052.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	57,830	5.72	330,787.60	
	ニュージーランドドル小計	238,025		2,539,350.60 (225,519,726)	

香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	125,708	42.45	5,336,304.60	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	17,517	69.65	1,220,059.05	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	58,500	106.80	6,247,800.00	
	MTR CORP	62,500	27.70	1,731,250.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	20.80	1,081,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	91,000	35.90	3,266,900.00	
	SANDS CHINA LTD	96,600	21.85	2,110,710.00	
	WH GROUP LTD	450,894	6.51	2,935,319.94	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	203,500	25.10	5,107,850.00	
	HANG SENG BANK LTD	36,900	95.40	3,520,260.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	52,800	303.00	15,998,400.00	
	AIA GROUP LTD	482,390	56.50	27,255,035.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	9.63	1,444,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	53.05	1,326,250.00	
	CLP HOLDINGS LTD	71,500	64.30	4,597,450.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	456,237	6.05	2,760,233.85	
	POWER ASSETS HOLDINGS	58,000	50.95	2,955,100.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	80,538	31.70	2,553,054.60	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	24.60	1,424,364.60	
	SINO LAND CO	189,050	8.00	1,512,400.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,480	75.50	4,566,240.00		
WHARF HOLDINGS LTD	43,000	23.30	1,001,900.00		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	20.10	1,282,380.00		
香港ドル小計		2,985,815		101,235,361.64 (2,003,447,806)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	68,560	6.89	472,378.40	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	63,300	4.53	286,749.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	112,200	2.88	323,136.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	6.42	346,038.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.77	162,547.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	3.05	225,578.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	84,034	43.74	3,675,647.16	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	150,740	16.76	2,526,402.40	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	57,300	37.35	2,140,155.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	12.46	529,550.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	354,480	3.14	1,113,067.20	
	SEBICORP INDUSTRIES LTD	30,200	5.56	167,912.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	105,000	2.65	278,250.00	
シンガポールドル小計		1,407,274		12,247,410.16 (1,398,409,292)	
イスラエルシェケル	ICL GROUP LTD	39,490	18.08	713,979.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,010	908.50	917,585.00	
	BANK HAPOLIM BM	50,495	42.70	2,156,136.50	

	BANK LEUMI LE-ISRAEL	62,565	42.51	2,659,638.15	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	48,330	24.57	1,187,468.10	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,900	158.50	1,093,650.00	
	NICE LTD	3,040	667.80	2,030,112.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,780	282.00	501,960.00	
イスラエルシュケル小計		213,610		11,260,528.95 (481,163,528)	
合計		48,104,129		452,009,995,831 (452,009,995,831)	

(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	709,380.60	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	12,110	452,550.70	
		AMERICAN TOWER CORP	20,649	4,071,156.84	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	18,847	372,793.66	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,790	1,310,971.80	
		BXP INC	5,717	456,959.81	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,810	578,017.70	
		CROWN CASTLE INC	18,590	1,805,274.90	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,395	2,663,650.80	
		EQUINIX INC	4,198	4,051,070.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	9,580	650,673.60	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	15,450	1,132,176.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,020	905,365.80	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	9,230	1,460,186.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,340	568,020.60	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36,875	765,525.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	33,579	623,897.82	
		INVITATION HOMES INC	25,700	849,899.00	
		IRON MOUNTAIN INC	13,365	1,495,543.50	
		KIMCO REALTY CORP	29,910	736,085.10	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,630	885,148.60	
		PROLOGIS INC	40,905	4,545,772.65	
		PUBLIC STORAGE	6,849	2,175,379.38	
		REALTY INCOME CORP	39,211	2,169,936.74	
		REGENCY CENTERS CORP	7,565	570,174.05	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,735	1,014,615.80	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	14,424	2,590,550.40	
SUN COMMUNITIES INC	5,920	723,424.00			
UDR INC	12,100	538,087.00			
VENTAS INC	17,025	1,019,967.75			

		VICI PROPERTIES INC	45,610	1,419,839.30	
		WELLTOWER INC	27,470	3,546,926.40	
		WEYERHAEUSER CO	29,998	901,739.88	
		WP CAREY INC	8,610	490,942.20	
米ドル小計			566,117	48,251,703.38 (7,426,902,184)	
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	122,892.00	
	投資証券小計		2,800	122,892.00 (13,300,601)	
加ドル小計			3,610	122,892.00 (13,300,601)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	94,979.50	
		GECINA SA	1,950	174,720.00	
		KLEPIERRE	8,402	235,256.00	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,990	368,960.60	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,730	151,044.20	
ユーロ小計			24,997	1,024,960.30 (165,951,322)	
英ポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	154,286.08	
		SEGRO PLC	65,733	469,333.62	
英ポンド小計			92,357	623,619.70 (121,262,850)	
豪ドル	投資証券	GOODMAN GROUP	70,642	2,598,212.76	
		GPT GROUP	71,335	319,580.80	
		MIRVAC GROUP	159,875	318,950.62	
		SCENTRE GROUP	280,871	974,622.37	
		STOCKLAND	102,400	509,952.00	
		VICINITY CENTRES	154,902	314,451.06	
豪ドル小計			840,025	5,035,769.61 (493,656,494)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	104,160	3,504,984.00	
香港ドル小計			104,160	3,504,984.00 (69,363,633)	
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,243	352,519.65	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	221,291	427,091.63	
シンガポールドル小計			359,534	779,611.28 (89,016,015)	
合計				8,379,453,099 (8,379,453,099)	

(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 571銘柄	97.9%			77.0%
	投資証券 34銘柄			2.1%	1.6%
加ドル	株式 83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 212銘柄	99.5%			8.0%
	投資証券 5銘柄			0.5%	0.0%
英ポンド	株式 76銘柄	99.3%			3.6%
	投資証券 2銘柄			0.7%	0.0%
スイスフラン	株式 45銘柄	100.0%			2.3%
スウェーデンクローナ	株式 42銘柄	100.0%			0.8%
ノルウェークローネ	株式 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 48銘柄	94.1%			1.7%
	投資証券 6銘柄			5.9%	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	96.7%			0.4%
	投資証券 1銘柄			3.3%	0.0%
シンガポールドル	株式 13銘柄	94.0%			0.3%
	投資証券 2銘柄			6.0%	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。

## 2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2024年12月30日現在です。

## 【世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

## 【純資産額計算書】

資産総額	38,460,393,236円
負債総額	60,790,537円
純資産総額（ - ）	38,399,602,699円
発行済口数	31,694,769,258口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2115円

（参考）

## 日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	57,562,811,230円
負債総額	円
純資産総額（ - ）	57,562,811,230円
発行済口数	23,901,817,038口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4083円

## 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	50,944,836,388円
負債総額	13,170,077円
純資産総額（ - ）	50,931,666,311円
発行済口数	13,837,262,669口
1口当たり純資産額（ / ）	3.6808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	56,201,766,416円
負債総額	309,435,429円
純資産総額（ - ）	55,892,330,987円
発行済口数	42,735,864,195口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3079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	167,198,515,018円
------	------------------

負債総額	251,904,926円
純資産総額（ - ）	166,946,610,092円
発行済口数	54,138,692,479口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0837円

## 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	64,153,777,380円
負債総額	27,677,904円
純資産総額（ - ）	64,126,099,476円
発行済口数	21,943,287,658口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9224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	471,425,418,006円
負債総額	117,901,039円
純資産総額（ - ）	471,307,516,967円
発行済口数	64,710,993,411口
1口当たり純資産額（ / ）	7.2833円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1) 名義書換

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

## (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

## (3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

## 受益権の譲渡

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

## 受益権の譲渡の対抗要件

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

## (4) 受益証券の再発行

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

## (5) 受益権の再分割

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

## (6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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



### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額

2024年12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12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12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12月末現在の投資信託などは次の通りです。

種類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	771	310,893
株式投資信託	726	271,544
単位型	265	7,083
追加型	461	264,461
公社債投資信託	45	39,348
単位型	32	987
追加型	13	38,361

#### 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)	
<b>資産の部</b>				
<b>流動資産</b>				
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
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
建物	1	245	1	233
器具備品	1	122	1	134
有形固定資産合計		367		368
<b>無形固定資産</b>				
ソフトウェア		390		438
無形固定資産合計		390		438
<b>投資その他の資産</b>				
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)	
<b>負債の部</b>				
<b>流動負債</b>				
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 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)		第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		107		4
受取配当金	2	9,255	2	4,946
有価証券評価益		-	3	1,113
金銭の信託運用益		-		399
時効成立分配金・償還金		1		2
その他		236		50
営業外収益合計		9,601		6,517
営業外費用				
支払利息		407		569
デリバティブ費用		389		3,494
有価証券償還損		6		-
時効成立後支払分配金・償還金		1		1
為替差損		342		165
その他		15		0
営業外費用合計		1,163		4,231
経常利益		17,858		10,319

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第64期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

第65期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本	
	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義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。</p>
	<p>(1) 投資信託委託業務 当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」）に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドのAUMに固定料率を乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問業務 当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドのAUMに投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。</p> <p>(3) 成功報酬 当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。</p>
5 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしてあります。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価してあります。</p>
6 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

## （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> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>1,437百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>879百万円</td> </tr> </table>	建物	1,437百万円	器具備品	879百万円	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>1,482百万円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>920百万円</td> </tr> </table>	建物	1,482百万円	器具備品	920百万円
建物	1,437百万円								
器具備品	879百万円								
建物	1,482百万円								
器具備品	920百万円								
<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) 未収収益 263百万円</p> <p>(流動負債) 未払費用 1,778百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未収入金」に含めて表示しております。</p> <p>5 保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド(旧社名「日興AMエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」)が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大448百万円(5百万豪ドル)を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。</p>	<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産) 未収収益 248百万円</p> <p>(流動負債) 未払費用 1,873百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド(旧社名「日興AMエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」)が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大493百万円(5百万豪ドル)を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。</p>
--	---

## (損益計算書関係)

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

## (株主資本等変動計算書関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

## 3 新株予約権等に関する事項

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



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

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

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

#### 4 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

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

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

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

#### 第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

##### 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

##### 2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

##### 3 新株予約権等に関する事項

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

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

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

#### 4 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

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

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

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

## (リース取引関係)

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

## (金融商品関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

## 1 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

## 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

## 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

## 2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

のない株式等は、次表には含めておりません。

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

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

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

### (1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

### (2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

#### (注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

##### 資産

##### 有価証券

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

##### デリバティブ取引

##### 株式関連

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

##### 通貨関連

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

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

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額
非上場株式	16
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

### 3 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	42,036			
未収委託者報酬	21,336			
未収収益	589			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	1,025	204	4,520	10
合計	64,987	204	4,520	10

## 1 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については金銭の信託及び短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

## 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

## 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・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			268
	米ドル		6,465	-	2
	豪ドル		84	-	17
	香港ドル		542	-	17
	人民元		2,979	-	60
	ユーロ		2,172	-	367
	合計		12,243	-	

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

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

(退職給付関係)

第64期(自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

退職給付引当金	1,424
貸借対照表に計上された負債の額	1,424

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	133
利息費用	4
数理計算上の差異の費用処理額	1



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

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

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

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

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

- 2 確定給付制度

- (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

- (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

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

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

(ストックオプション等関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

- 1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

- (1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

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

	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2018年4月27日

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

#### 単価情報

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

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

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

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

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

## 単価情報

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

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

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

## (税効果会計関係)

第64期 (2023年3月31日)	第65期 (2024年3月31日)

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

## ( 関連当事者情報 )

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

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

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

## 第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

## 1 関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

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

## (セグメント情報等)

## セグメント情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

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

## 関連情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

## 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

## 1 製品及びサービスごとの情報

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

## 2 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

## 3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

## 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

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

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

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

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

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

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

(収益認識関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

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

2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(1株当たり情報)

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

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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



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

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）  
該当事項はありません。

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
<p>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。</p>		
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
	6,989	24,613	-	31,602
デリバティブ取引( 1、2)				
株式関連	257	-	-	257
通貨関連	-	845	-	845
デリバティブ取引計	257	845	-	587

- ( 1 ) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、          で示しております。
- ( 2 ) 株式関連のデリバティブ取引のうち257百万円は、中間貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。また通貨関連のデリバティブ取引のうち890百万円は、流動資産のその他に、          45百万円は流動負債のその他に含まれております。

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

資産

金銭の信託

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

有価証券

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

#### デリバティブ取引

##### 株式関連

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

##### 通貨関連

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

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

(単位:百万円)

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

#### (有価証券関係)

第66期中間会計期間(2024年9月30日)

##### 1 子会社株式及び関連会社株式

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

##### 2 その他有価証券

(単位:百万円)

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

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

2 非上場株式(中間貸借対照表計上額2,538百万円)については、市場価格のない株式等であることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

#### (金銭の信託関係)

第66期中間会計期間(2024年9月30日)

運用目的の金銭の信託

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額	当事業年度の損益に含まれた評価差額
運用目的の金銭の信託	13,876	22

#### (デリバティブ取引関係)

第66期中間会計期間(2024年9月30日)

##### 1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

###### (1) 株式関連

種類	契約額等(百万円)	契約額等のうち1年超(百万円)	時価(百万円)	評価損益(百万円)
株価指数先物取引				



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

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

## (2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建 シンガポールドル	6,688	-	45	45
	合計	6,688	-	45	45

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

## 2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

### 通貨関連

ヘッジ会計 の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	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
アイザワ証券株式会社 1	3,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
あかつき証券株式会社	3,067百万円	
S M B C 日興証券株式会社	135,000百万円	
株式会社 S B I 証券	54,323百万円	
大和証券株式会社	100,000百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
東洋証券株式会社 1	13,494百万円	
野村証券株式会社 1	10,000百万円	
八十二証券株式会社 1	3,000百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	13,195百万円	
三菱UFJ eスマート証券株式会社	7,196百万円	
楽天証券株式会社	19,495百万円	
株式会社秋田銀行 1	14,100百万円	
株式会社香川銀行	14,105百万円	
株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	
株式会社三十三銀行 1	37,461百万円	
株式会社滋賀銀行	33,076百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社東和銀行	38,653百万円	
株式会社鳥取銀行	9,061百万円	
株式会社富山銀行 1	6,730百万円	
株式会社八十二銀行	52,243百万円	
株式会社百十四銀行	37,322百万円	
株式会社南日本銀行	13,351百万円	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。
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	
株式会社琉球銀行	56,967百万円	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。
株式会社 S M B C 信託銀行	87,550百万円	
みずほ信託銀行株式会社 1	247,369百万円	全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
農林中央金庫	4,040,198百万円	
労働金庫連合会	120,000百万円 (出資の総額)	労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

1 募集の取扱いを行いません。

名 称	資本金の額 (2024年3月末現在)	事業の内容
埼玉県信用農業協同組合連合会	165,600百万円	農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでおります。
東京都信用農業協同組合連合会	134,586百万円	
神奈川県信用農業協同組合連合会	300,478百万円	
長野県信用農業協同組合連合会	105,381百万円	

新潟県信用農業協同組合連合会	74,400百万円
石川県信用農業協同組合連合会	33,047百万円
静岡県信用農業協同組合連合会	161,300百万円
愛知県信用農業協同組合連合会	264,402百万円
三重県信用農業協同組合連合会	68,752百万円
滋賀県信用農業協同組合連合会	40,700百万円
大阪府信用農業協同組合連合会	140,600百万円
兵庫県信用農業協同組合連合会	268,319百万円
和歌山県信用農業協同組合連合会	57,883百万円
山口県信用農業協同組合連合会	35,542百万円
徳島県信用農業協同組合連合会	32,500百万円
仙台農業協同組合	3,480百万円
みやぎ亙理農業協同組合	1,469百万円
みやぎ登米農業協同組合	6,086百万円
新みやぎ農業協同組合	10,043百万円
いしのまき農業協同組合	4,684百万円
みやぎ仙南農業協同組合	3,642百万円
秋田しんせい農業協同組合	4,998百万円
山形農業協同組合	3,812百万円
さがえ西村山農業協同組合	3,550百万円
山形おきたま農業協同組合	4,358百万円
鶴岡市農業協同組合	1,424百万円
庄内たがわ農業協同組合	4,007百万円
ふくしま未来農業協同組合	16,470百万円
茨城みなみ農業協同組合	2,211百万円
北つくば農業協同組合	3,755百万円
はが野農業協同組合	3,946百万円
那須南農業協同組合	1,165百万円
高崎市農業協同組合	2,091百万円
佐波伊勢崎農業協同組合	2,491百万円
さいたま農業協同組合	8,228百万円
あさか野農業協同組合	848百万円
いるま野農業協同組合	5,419百万円
埼玉中央農業協同組合	2,277百万円
くまがや農業協同組合	2,697百万円
ほくさい農業協同組合	3,060百万円
越谷市農業協同組合	1,933百万円
南彩農業協同組合	2,888百万円
埼玉みずほ農業協同組合	1,515百万円
さいかつ農業協同組合	1,796百万円
ふかや農業協同組合	1,644百万円
横浜農業協同組合	11,538百万円
セレサ川崎農業協同組合	2,472百万円
よこすか葉山農業協同組合	1,312百万円
さがみ農業協同組合	4,954百万円
湘南農業協同組合	3,102百万円
秦野市農業協同組合	1,586百万円
かながわ西湘農業協同組合	2,337百万円
厚木市農業協同組合	2,360百万円
相模原市農業協同組合	824百万円
神奈川つくい農業協同組合	729百万円
佐久浅間農業協同組合	7,643百万円
信州うえだ農業協同組合	3,874百万円
信州諏訪農業協同組合	6,022百万円
上伊那農業協同組合	7,952百万円
みなみ信州農業協同組合	4,293百万円
松本ハイランド農業協同組合	9,275百万円

大北農業協同組合	3,012百万円
グリーン長野農業協同組合	3,791百万円
中野市農業協同組合	2,497百万円
ながの農業協同組合	13,173百万円
北新潟農業協同組合	7,050百万円 (2024年8月31日現在)
新潟かがやき農業協同組合	12,412百万円
えちご中越農業協同組合	15,322百万円
魚沼農業協同組合	7,798百万円 (2024年7月31日現在)
佐渡農業協同組合	2,202百万円
加賀農業協同組合	1,911百万円
小松市農業協同組合	2,131百万円
能美農業協同組合	1,270百万円
金沢中央農業協同組合	1,064百万円
金沢市農業協同組合	3,063百万円
はくい農業協同組合	1,357百万円
能登わかば農業協同組合	2,438百万円
能登農業協同組合	2,510百万円
ぎふ農業協同組合	7,029百万円
西美濃農業協同組合	4,365百万円
いび川農業協同組合	1,915百万円
めぐみの農業協同組合	4,843百万円
東美濃農業協同組合	2,688百万円
飛騨農業協同組合	6,532百万円
富士伊豆農業協同組合	10,904百万円
清水農業協同組合	2,830百万円
静岡市農業協同組合	1,762百万円
大井川農業協同組合	3,180百万円
ハイナン農業協同組合	795百万円
掛川市農業協同組合	788百万円
遠州夢咲農業協同組合	3,299百万円
遠州中央農業協同組合	3,145百万円
とびあ浜松農業協同組合	3,576百万円
三ヶ日町農業協同組合	288百万円
尾張中央農業協同組合	2,038百万円
西春日井農業協同組合	150百万円
あいち尾東農業協同組合	1,165百万円
愛知北農業協同組合	742百万円
愛知西農業協同組合	1,580百万円
あいち知多農業協同組合	6,524百万円
あいち中央農業協同組合	3,618百万円
西三河農業協同組合	1,292百万円
あいち三河農業協同組合	1,089百万円
あいち豊田農業協同組合	1,775百万円
愛知東農業協同組合	893百万円
豊橋農業協同組合	2,416百万円
鈴鹿農業協同組合	1,614百万円
津安芸農業協同組合	2,534百万円
伊勢農業協同組合	6,367百万円
伊賀ふるさと農業協同組合	3,987百万円
甲賀農業協同組合	2,628百万円
北大阪農業協同組合	1,761百万円
茨木市農業協同組合	1,175百万円
大阪泉州農業協同組合	1,853百万円
いずみの農業協同組合	2,685百万円
堺市農業協同組合	1,199百万円

大阪南農業協同組合	3,464百万円
グリーン大阪農業協同組合	1,349百万円
大阪中河内農業協同組合	4,030百万円
北河内農業協同組合	2,889百万円
大阪市農業協同組合	2,651百万円
兵庫南農業協同組合	3,682百万円
兵庫西農業協同組合	12,925百万円
たじま農業協同組合	4,361百万円
丹波ひかみ農業協同組合	2,097百万円
淡路日の出農業協同組合	1,793百万円
奈良県農業協同組合	9,177百万円
わかやま農業協同組合	4,906百万円
ながみね農業協同組合	2,137百万円
紀の里農業協同組合	4,063百万円
紀北川上農業協同組合	4,957百万円
ありだ農業協同組合	2,144百万円
紀州農業協同組合	3,803百万円
紀南農業協同組合	4,914百万円
みくまの農業協同組合	1,188百万円
鳥取いなば農業協同組合	5,487百万円
鳥取中央農業協同組合	3,449百万円
鳥取西部農業協同組合	4,881百万円
島根県農業協同組合	20,685百万円
広島市農業協同組合	10,682百万円
ひろしま農業協同組合	16,731百万円
山口県農業協同組合	16,172百万円
徳島市農業協同組合	4,279百万円
香川県農業協同組合	23,450百万円
越智今治農業協同組合	6,190百万円
高知市農業協同組合	5,141百万円
福岡八女農業協同組合	3,108百万円
宮崎県農業協同組合	25,271百万円 (2024年4月1日現在)
沖縄県農業協同組合	24,410百万円

## 2【関係業務の概要】

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

## 3【資本関係】

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

## 第3【その他】

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

投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。  
投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。  
「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。  
「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。  
請求目論見書の入手方法（ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど）についての記載。  
請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。  
「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。  
商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。  
投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。  
有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。  
委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。

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

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

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

ファンドは、大量の解約が発生し、短時間で解約資金の手当てをする必要が生じた場合や、主たる取引市場において市場が急変した場合などに、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがある旨。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金の申込みの受付を中止する可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性がある旨の記載。  
分配金は、投資信託の純資産から支払われるので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がる旨。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合がある旨。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合がある旨の記載。



## 独立監査人の監査報告書

2024年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

### 監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### その他の記載内容

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

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

### 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

する注記事項の妥当性を評価する。

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注)1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2025年3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

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」に掲げられている世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2024年6月18日から2024年12月16日までの特定期間の財務諸表、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、世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2024年12月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### その他の記載内容

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

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

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