【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17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】	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）
【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】

Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）（以下「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または「（８）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（５）【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社の照会先にお問い合わせください。
・販売会社における申込手数料率は2.2%（税抜2%）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18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/
※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。

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

（１２）【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】

① ファンドの目的
主として、日本を含む世界の株式、不動産投資信託（REIT）および債券などに実質的に投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

② ファンドの基本的性格

１）商品分類

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

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

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

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

２）属性区分

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。
◇その他資産（投資信託証券（資産複合　資産配分固定型（株式、債券、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ないます。
よって、商品分類の「投資対象資産（収益の源泉）」においては、「資産複合」に分類されます。
「資産配分固定型」とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。
◇年１回
目論見書または投資信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいいます。
◇グローバル（含む日本）
目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
◇ファミリーファンド
目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
◇為替ヘッジあり（部分ヘッジ）
目論見書または投資信託約款において、一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるものをいいます。
※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。
上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）をご参照ください。

③　ファンドの特色

1 10種類のマザーファンドへの投資を通じて、世界の株式、REIT、債券に分散投資します。

●各マザーファンドは、それぞれ対象とする指数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。

マザーファンド	投資対象資産	連動をめざす対象指数
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	TOPIX（東証株価指数）配当込み
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	海外先進国株式 （ヘッジなし）	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）
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	海外先進国株式 （ヘッジあり）	MSCI-KOKUSAIインデックス （税引後配当込み、円ヘッジあり・円ベース）
海外新興国株式インデックス MSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド	海外新興国株式	MSCIエマージング・マーケット・インデックス （税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）
日本リートインデックス J-REITマザーファンド	日本REIT	東証REIT指数（配当込み）
海外リートインデックス （ヘッジなし）マザーファンド	海外先進国REIT	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）
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	NOMURA-BPI総合
海外債券インデックス （ヘッジなし）マザーファンド	海外先進国債券 （ヘッジなし）	FTSE世界国債インデックス （除く日本、ヘッジなし・円ベース）
海外債券インデックス （ヘッジあり）マザーファンド	海外先進国債券 （ヘッジあり）	FTSE世界国債インデックス （除く日本、ヘッジあり・円ベース）
海外新興国債券インデックス Local（ヘッジなし）マザーファンド	海外新興国債券	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし・円ベース）

2 当ファンド設定時に定めた基本配分比率で各マザーファンドへ投資します。

●マザーファンドの合計組入比率は、原則として高位を維持します。
●基本配分比率の変更は、原則として行ないません。

当ファンドの基本配分比率	
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	5%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	5%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	5%
海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド	5%
日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	5%
海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	10%
日本債券インデックスマザーファンド	10%
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	20%
海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	25%
海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド	10%

3 年1回、決算を行ないます。

●毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。
※分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や分配を行なわない場合もあります。

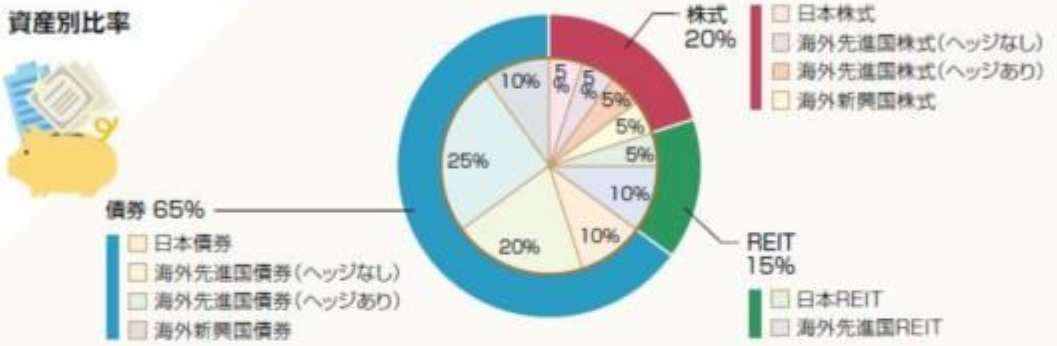
※市況動向および資金動向などにより、上記のような運用が行なえない場合があります。

当ファンドの基本配分比率について

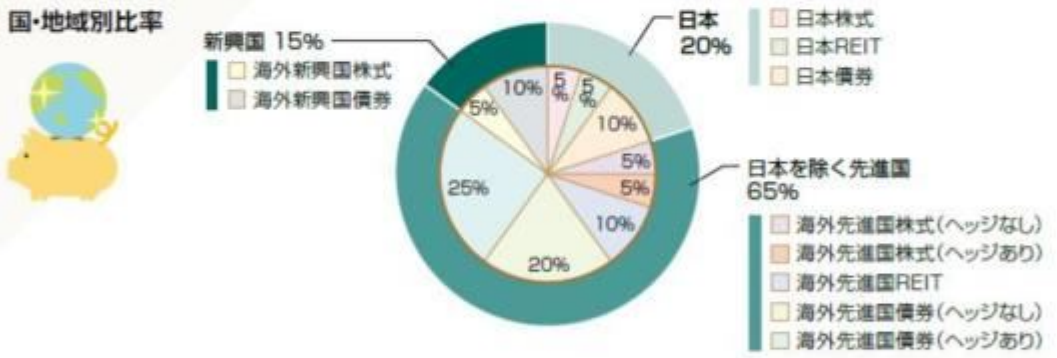
- 当ファンドでは、株式・REIT・債券の3つの資産がファンドにもたらすリスクの大きさを概ね等しくすることをめざして決定した基本配分比率を維持します。
- 基本配分比率については、ファンド設定時点における各資産の過去長期間のデータを基に算出した価格変動リスクを用いて、日興アセットマネジメントが独自に決定しました。各資産の価格変動リスクの変化に応じた基本配分比率の変更は、原則として行ないません。

基本配分比率について

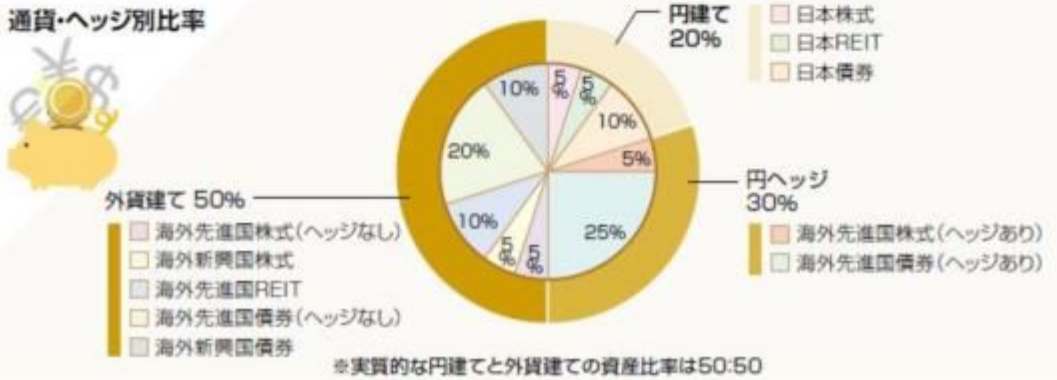
資産別比率



国・地域別比率



通貨・ヘッジ別比率



※実質的な円建てと外貨建ての資産比率は50:50

※各投資対象資産に対応するマザーファンドについては、前述の通りです。
※上記は当ファンドの基本配分比率を示したものであり、実際のファンドの資産配分比率は、時価の変化などにより変動します。

指数の権利について

各指数（インデックス）の著作権などの権利について

TOPIX（東証株価指数）

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

MSCI-KOKUSAIインデックス

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス

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

東証REIT指数

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

S&P先進国REIT指数

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

NOMURA-BPI総合

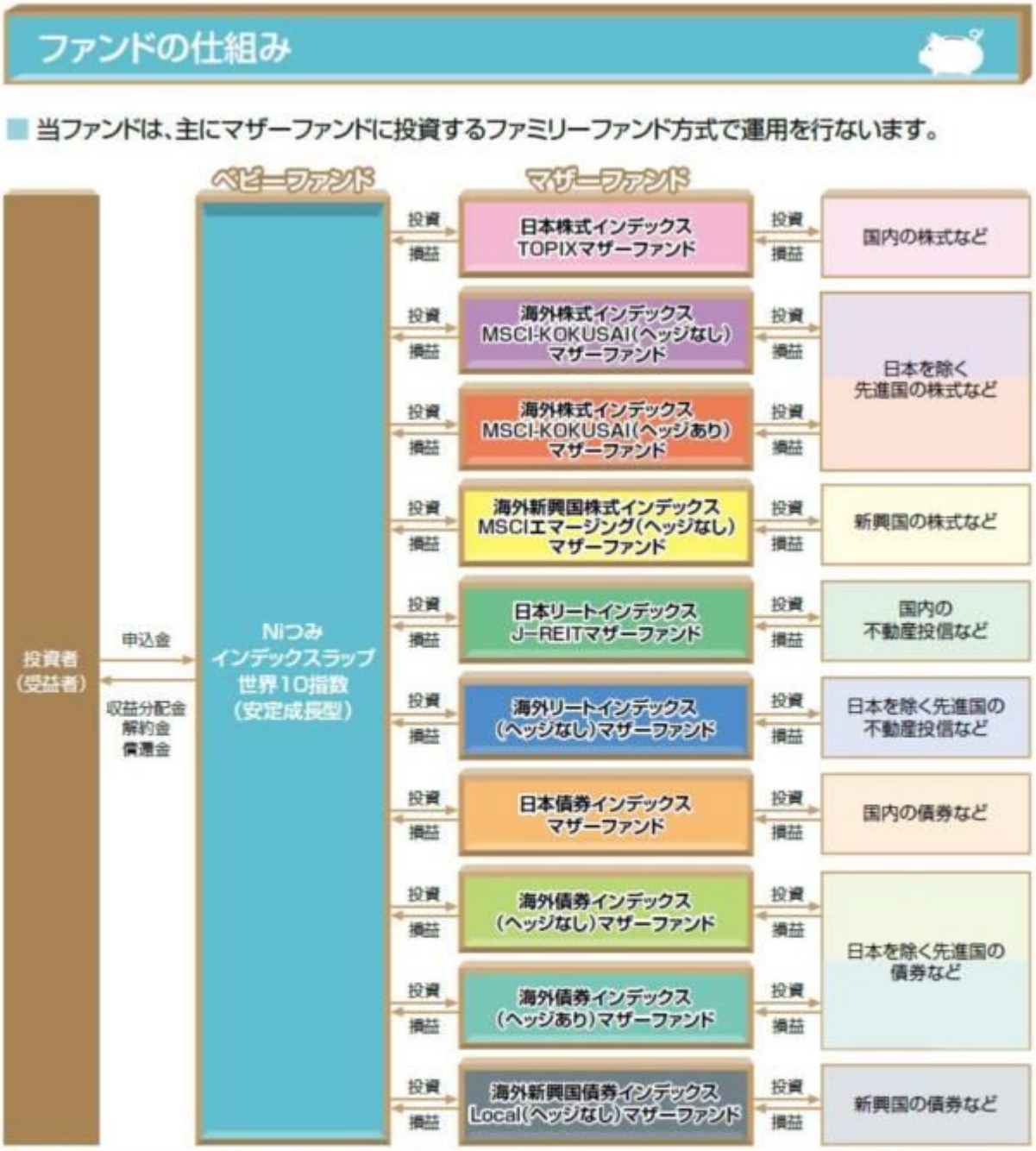
同指数は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社（以下「NFRC」）が公表している指数で、その知的財産権はNFRCに帰属します。なお、NFRCは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行なわれる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

FTSE世界国債インデックス

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

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバーシファイド

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JPMorgan Chase & Co.に帰属します。また、JPMorgan Chase & Co.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。



※「Niつみインデックスラップ世界10指数」の各ファンド間で、スイッチングを行なうことができる場合があります。ただし、販売会社によっては、一部のファンドのみの取扱いとなる場合やスイッチングを行なえない場合があります。

■ 主な投資制限

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

■ 分配方針

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

<Niつみとは>
NISA*からとった「Ni」に、中長期での積立投資や時間を積み重ねていくという意味の「つみ」を掛け合わせ、ファンド名称に「Niつみ」を冠しています。

*少額投資非課税制度（愛称：NISA（ニーサ）、Nippon Individual Savings Account）を指します。

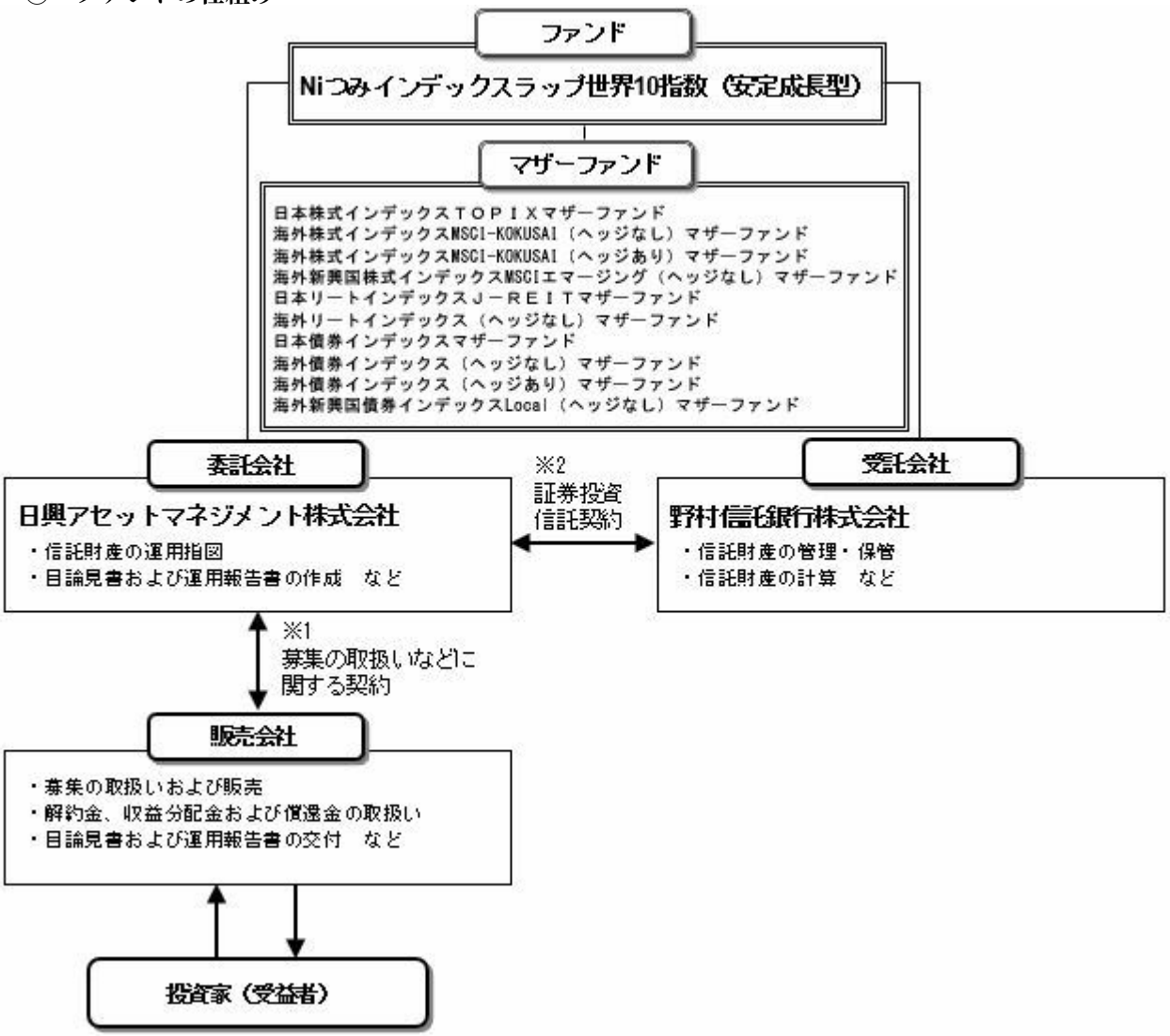
④ 信託金限度額

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

（2）【ファンドの沿革】

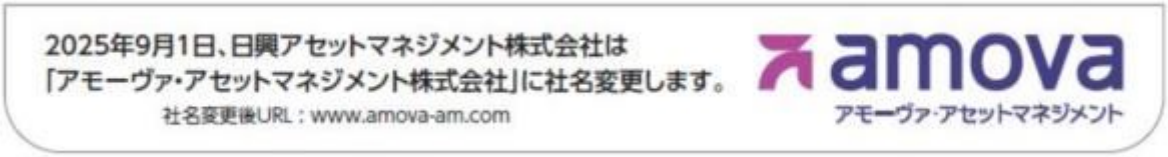
2023年 6月20日
・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

（3）【ファンドの仕組み】
① ファンドの仕組み



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

② 委託会社の概況（2024年12月末現在）
1）資本金
17,363百万円
2）沿革
1959年：日興證券投資信託委託株式会社として設立
1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
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



3）大株主の状況

名　　称	住　　所	所有株数	所有比率
三井住友トラストグループ株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目４番１号	192,211,000株	97.562%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

・主として、以下に掲げる各マザーファンド受益証券に投資を行ない、インカム収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
・各マザーファンドは、下記の指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」	…	ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）配当込み
「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」	…	MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）
「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」	…	MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジあり・円ベース）
「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド」	…	MSCI エマージング・マーケット・インデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）
「日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」	…	東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）
「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」	…	Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）
「日本債券インデックスマザーファンド」	…	NOMURA-BPI総合
「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」	…	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」	…	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）
「海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド」	…	ＪＰモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし・円ベース）

・各マザーファンドの受益証券への基本投資比率は、原則として、信託財産の純資産総額に対して下記の率とします。

証券投資信託「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」	…… 5%
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」	…… 5%
証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」	…… 5%
証券投資信託「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド」	…… 5%
証券投資信託「日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」	…… 5%
証券投資信託「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」	……10%
証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」	……10%
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」	……20%
証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」	……25%
証券投資信託「海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド」	……10%

・マザーファンド受益証券の合計組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比率を引き下げることもあります。
・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（2）【投資対象】

＜Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）＞
以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。
証券投資信託「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」
証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」
証券投資信託「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド」
証券投資信託「日本リートインデックスＪ－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「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」
証券投資信託「海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド」

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

② 主として次のマザーファンドの受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
1）証券投資信託「日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド」
2）証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
3）証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」

４）証券投資信託「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド」
５）証券投資信託「日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」
６）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」
７）証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
８）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」
９）証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」
10）証券投資信託「海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド」
11）株券または新株引受権証書
12）国債証券
13）地方債証券
14）特別の法律により法人の発行する債券
15）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。）
16）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。）
17）コマーシャル・ペーパー
18）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
19）外国または外国の者の発行する証券または証書で、11）～18）の証券または証書の性質を有するもの
20）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。）
21）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22）に定めるもの以外のもの
22）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
23）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。）
24）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。）
25）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。）
26）外国法人が発行する譲渡性預金証書
27）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。）
28）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
29）外国の者に対する権利で28）の有価証券の性質を有するもの

③　次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
１）預金
２）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３）コール・ローン
４）手形割引市場において売買される手形
５）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
６）外国の者に対する権利で５）の権利の性質を有するもの

④　次の取引ができます。
１）信用取引
２）先物取引等
３）スワップ取引
４）金利先渡取引
５）為替先渡取引
６）有価証券の貸付
７）公社債の空売
８）公社債の借入
９）外国為替予約取引
10）資金の借入

＜日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド＞

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

①　投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）有価証券
２）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限ります。）
３）金銭債権
４）約束手形
５）為替手形

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

株予約権証券
9）外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2）～8）の証券の性質を有するもの
10）投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
11）オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
12）預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
13）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
14）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

③　次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
1）預金
2）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3）コール・ローン
4）手形割引市場において売買される手形
5）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの

④　次の取引ができます。
1）信用取引
2）先物取引等
3）スワップ取引
4）金利先渡取引
5）有価証券の貸付
6）公社債の空売
7）公社債の借入

＜海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド＞
日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

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

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

③　次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
1）預金
2）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3）コール・ローン
4）手形割引市場において売買される手形
5）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
6）外国の者に対する権利で５）の権利の性質を有するもの

④　次の取引ができます。

１）信用取引
２）先物取引等
３）スワップ取引
４）金利先渡取引
５）為替先渡取引
６）有価証券の貸付
７）公社債の空売
８）公社債の借入
９）外国為替予約取引

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

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

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

③　次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
１）預金
２）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３）コール・ローン
４）手形割引市場において売買される手形
５）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
６）外国の者に対する権利で５）の権利の性質を有するもの

④　次の取引ができます。
１）信用取引
２）先物取引等
３）スワップ取引
４）金利先渡取引
５）為替先渡取引
６）有価証券の貸付
７）公社債の空売
８）公社債の借入
９）外国為替予約取引

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

新興国の株式（ＤＲ（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）を主要投資対象とします。

①　投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）有価証券
２）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第17条、第18条および第19条に定めるものに限ります。）
３）金銭債権
４）約束手形

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

＜日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド＞
わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）有価証券
２）金銭債権
３）約束手形
４）為替手形
② 主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
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。）
③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
１）預金
２）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３）コール・ローン
４）手形割引市場において売買される手形

＜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。
① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

＜海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞

内外の公社債を主要投資対象とします。
① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
２）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。）

３）金銭債権
４）約束手形
５）為替手形
② 主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
１）国債証券
２）地方債証券
３）特別の法律により法人の発行する債券
４）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限ります。）
５）特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
６）コマーシャル・ペーパー
７）外国または外国の者の発行する証券で、１）～６）の証券の性質を有するもの
８）投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
９）外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
10）外国法人が発行する譲渡性預金証書
11）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
12）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
13）外国の者に対する権利で12）の有価証券の性質を有するもの
③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
１）預金
２）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３）コール・ローン
４）手形割引市場において売買される手形
５）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
６）外国の者に対する権利で５）の権利の性質を有するもの
④ 次の取引ができます。
１）先物取引等
２）スワップ取引
３）金利先渡取引
４）為替先渡取引
５）有価証券の貸付
６）公社債の空売
７）公社債の借入
８）外国為替予約取引

＜海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド＞

内外の公社債を主要投資対象とします。
① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
１）有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
２）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。）
３）金銭債権
４）約束手形
５）為替手形
② 主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
１）国債証券
２）地方債証券
３）特別の法律により法人の発行する債券
４）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限ります。）
５）特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
６）コマーシャル・ペーパー
７）外国または外国の者の発行する証券で、１）～６）の証券の性質を有するもの
８）投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
９）外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
10）外国法人が発行する譲渡性預金証書
11）指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証

券に限ります。）
12）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
13）外国の者に対する権利で12）の有価証券の性質を有するもの
③　次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
１）預金
２）指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
３）コール・ローン
４）手形割引市場において売買される手形
５）貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
６）外国の者に対する権利で５）の権利の性質を有するもの
④　次の取引ができます。
１）先物取引等
２）スワップ取引
３）金利先渡取引
４）為替先渡取引
５）有価証券の貸付
６）公社債の空売
７）公社債の借入
８）外国為替予約取引

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

◆投資対象とするマザーファンドの概要
＜日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド＞

運用の基本方針

	基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）*配当込みの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
	主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
	投資方針	・主としてわが国の株式に投資し、ＴＯＰＩＸ（東証株価指数）配当込みの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社 ※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）

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

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

運用の基本方針		
	基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス*（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
	主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

	投資方針	・主として日本を除く世界各国の株式（ＤＲ（預託証券）およびカントリーファンド等を含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。 ・投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引や外国為替予約取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社 ※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。

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

運用の基本方針		
	基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス＊（税引後配当込み、円ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
	主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
	投資方針	・主として日本を除く世界各国の株式（ＤＲ（預託証券）およびカントリーファンドなどを含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額の合計額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないます。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社 ※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。

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

運用の基本方針		
	基本方針	主として金融商品取引所に上場されている新興国の株式に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス＊（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
	主な投資対象	新興国の株式（ＤＲ（預託証券）およびカントリーファンド等を含みます。）を主要投資対象とします。
	投資方針	・主として、新興国の株式（ＤＲ（預託証券）およびカントリーファンド等を含みます。）に投資し、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。 ・投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引や外国為替予約取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の総額の５％以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。

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

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

＜日本リートインデックスＪ－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	・主として、東京証券取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざします。 ・不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。 ・有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。 ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（１口当たり）
	その他の費用など	組入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ＪＰＸは責任を負いません。

＜海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞

運用の基本方針		
	基本方針	世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）*の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
	主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
	投資方針	・主として、日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動した投資成果をめざします。 ・不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジは行ないません。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。 ・有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。 ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社 ※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）

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

＜日本債券インデックスマザーファンド＞

運用の基本方針		
	基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、NOMURA-BPI総合*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
	主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。

	投資方針	・主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社 ※2025年9月1日より「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に変更
	受託会社	野村信託銀行株式会社
	信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
	決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

＜海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞

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

	主な投資制限	・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社 ※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。

＜海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド＞

運用の基本方針		
	基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
	主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
	投資方針	・主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないます。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（１口当たり）

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

＜海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド＞

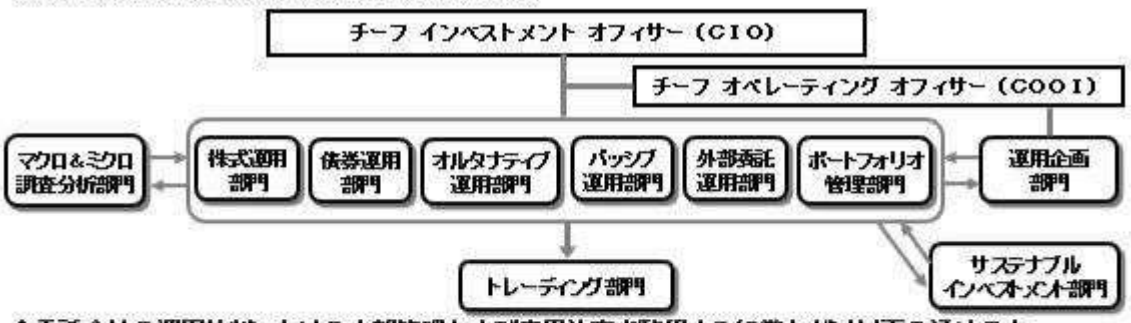
運用の基本方針		
	基本方針	主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし・円ベース）＊の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
	主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
	投資方針	・主として、新興国の現地通貨建債券に投資し、ＪＰモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバーシファイド（円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。なお、新興国の現地通貨建債券の騰落率に償還価額などが連動する債券を活用することもあります。 ・投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
	主な投資制限	・株式（新株引受権証券、新株予約権証券および新株引受権付社債券を含みます。）への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
	収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用		
	信託報酬	ありません。
	申込手数料	ありません。
	信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（１口当たり）
	その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他		
	委託会社	日興アセットマネジメント株式会社 ※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（2008年３月31日設定）
	決算日	毎年５月16日（休業日の場合は翌営業日）

＊ＪＰモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ グローバル・ディバーシファイドは、ＪＰモルガンが発表している、エマージング・カントリーの債券市場の合成パフォーマ

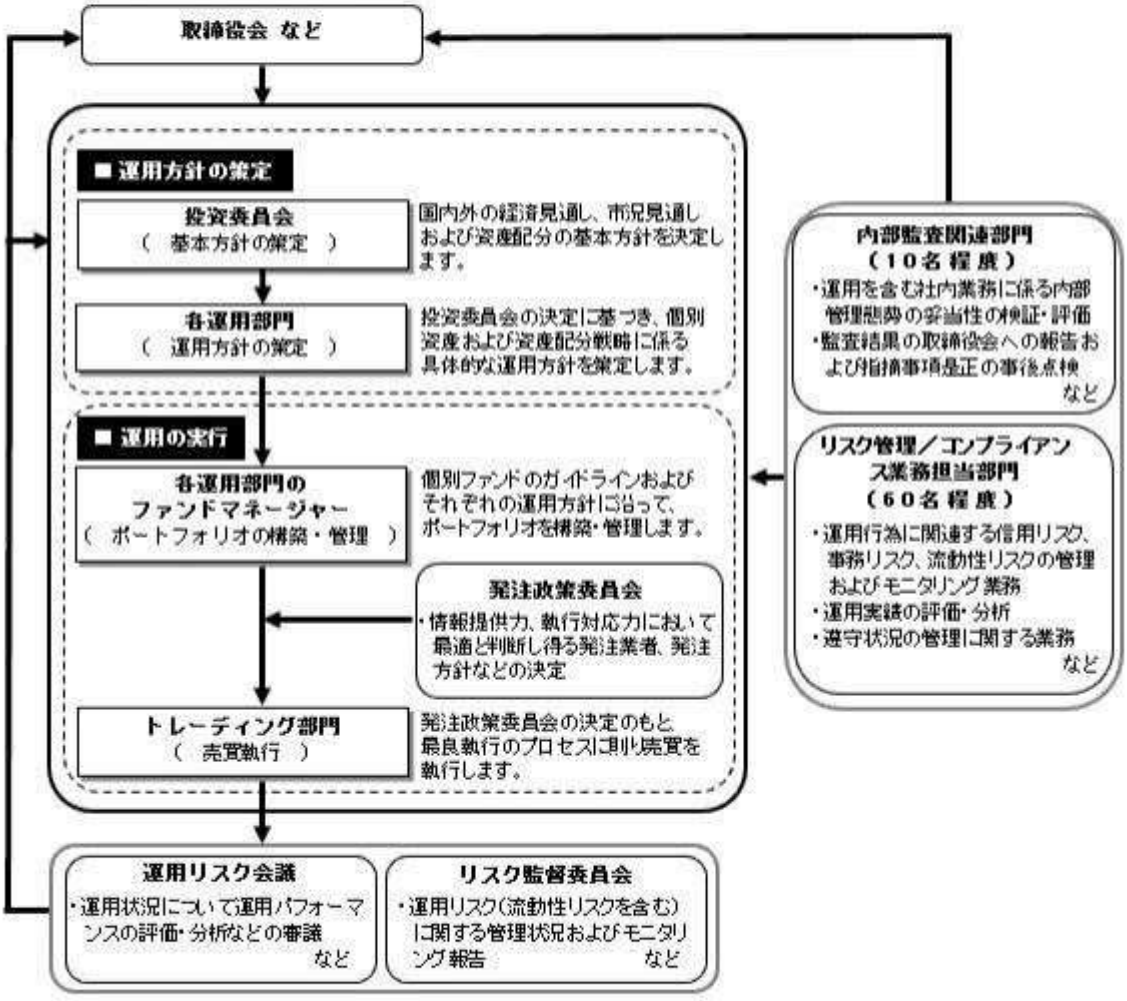
ンスを表す指数です。
同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はJPMorgan Chase & Co.に帰属します。また、JPMorgan Chase & Co.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

（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。

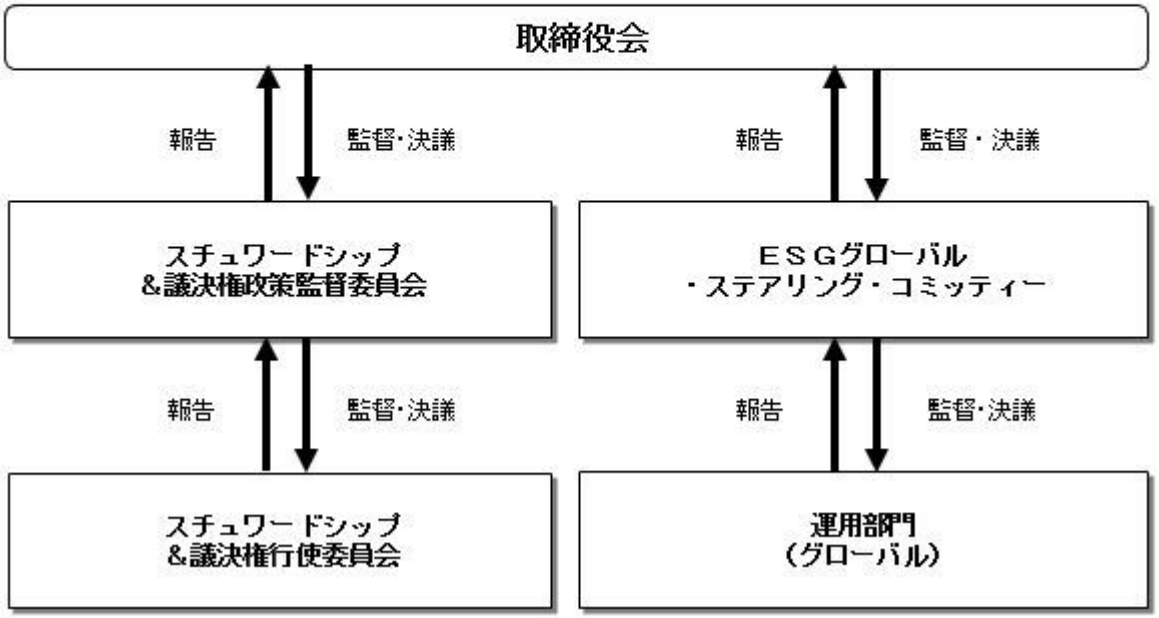


委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG／フィデューシャリー・デューティー

ＥＳＧ（環境、社会、企業統治）やフィデューシャリーは、当委託会社にとって最高位に位置する概念であるため、同原則に関連する決議、報告、議論は、当委託会社の取締役会にて行なうこととしています。
（スチュワードシップ&議決権政策監督委員会は、議長含め社外委員が過半数以上を占めるメンバーで構成されています）



※上記体制は2024年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】

① 収益分配方針
毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。
１）分配対象額の範囲
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
２）分配対象額についての分配方針
分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
３）留保益の運用方針
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。

② 収益分配金の支払い
＜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】

① 約款に定める投資制限
＜Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）＞
１）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には、制限を設けません。
２）投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。以下同じ。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。また、上場予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、投資することを指図することができるものとします。
３）投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の５％以下とします。
４）外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
５）信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
６）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げ

るものをいいます。）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係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

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

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

10）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

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

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

ハ）上場投資信託証券の貸付は、貸付時点において、貸付上場投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する上場投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。

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

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

14）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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

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

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

ハ）借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の範囲内

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

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

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

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

＜日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド＞

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

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

３）外貨建資産への投資は行ないません。

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

５）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第８項第３号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条

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

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

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

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

＜海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド＞
１）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。
２）投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。以下同じ。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社

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

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

＜海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞
1）投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第１号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
2）有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
3）投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
4）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

＜海外新興国債券インデックスLocal（ヘッジなし）マザーファンド＞
1）株式（新株引受権証券、新株予約権証券および新株引受権付社債券を含みます。）への投資は行ないません。
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を超えないものとします。

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

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

11）投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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

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

② 法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

・投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。

・当ファンドは、主に株式、不動産投信および債券を実質的な投資対象としますので、株式、不動産投信および債券の価格の下落や、株式、不動産投信および債券の発行体の財務状況や業績の悪化、不動産の市況の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 価格変動リスク

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

・一般に不動産投信は、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、自然災害などに伴なう不動産の滅失・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。

・一般に新興国の株式および債券は、先進国の株式および債券に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。

② 流動性リスク

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

・一般に新興国の株式および債券は、先進国の株式および債券に比べて市場規模や取引量が少ないため、流動性リスクが高まる場合があります。

③ 信用リスク

・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が

値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れが生じた場合や廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
・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。
・一般に新興国の債券は、先進国の債券に比べて利回りが高い反面、価格変動が大きく、デフォルトが生じるリスクが高まる場合があります。
・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

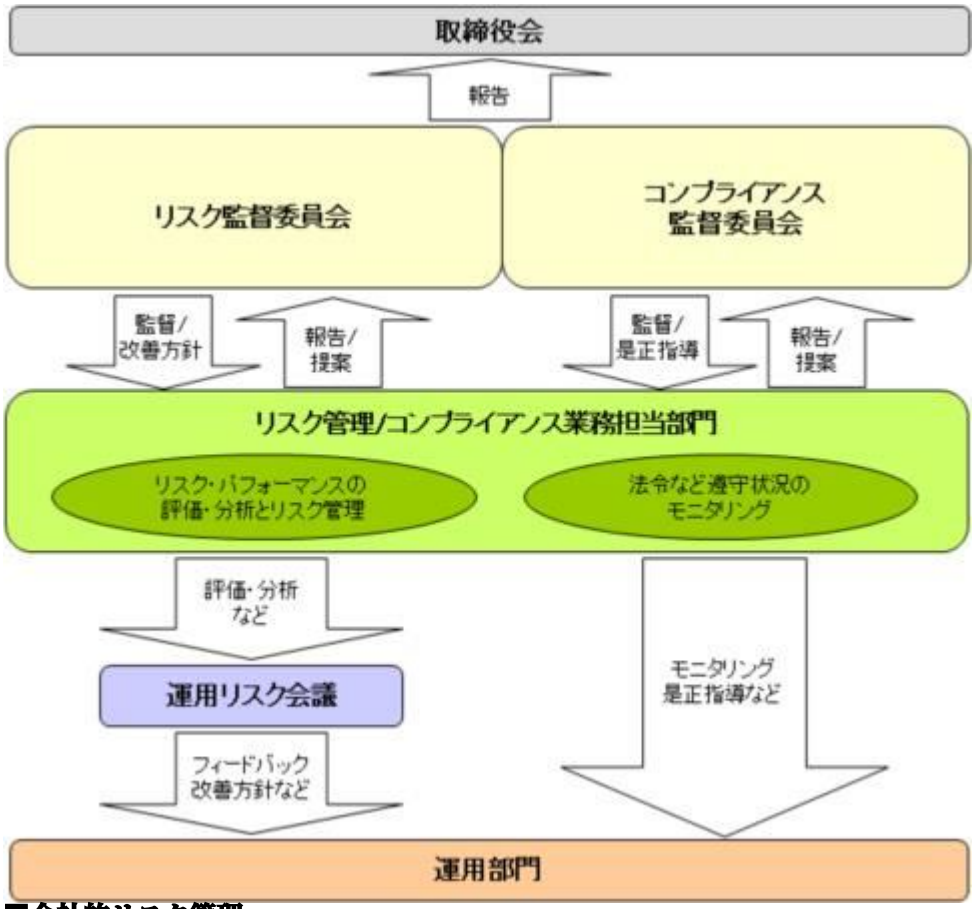
④　為替変動リスク
・外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
・「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」および「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」は原則として為替ヘッジを行ないますが、為替ヘッジを行なうにあたっては、円の金利が為替ヘッジを行なう通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替および金利の動向によっては、為替ヘッジに伴なうヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。
・一般に新興国の通貨は、先進国の通貨に比べて為替変動が大きくなる場合があります。

⑤　カントリー・リスク
・投資対象国における非常事態など（金融危機、財政上の理由による国自体のデフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）を含む市況動向や資金動向などによっては、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあり、投資方針に従った運用ができない場合があります。
・一般に新興国は、情報の開示などが先進国に比べて充分でない、あるいは正確な情報の入手が遅延する場合があります。
・ファンドの投資対象資産が上場または取引されている諸国の税制は各国によって異なります。また、それらの諸国における税制が一方的に変更されたり、新たな税制が適用されたりすることもあります。以上のような要因は、ファンドの信託財産の価値に影響を与える可能性があります。

⑥　有価証券の貸付などにおけるリスク
有価証券の貸付行為などにおいては、取引相手先リスク（取引の相手方の倒産などにより貸付契約が不履行になったり、契約が解除されたりするリスク）を伴ない、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。貸付契約が不履行や契約解除の事態を受けて、貸付契約に基づく担保金を用いて清算手続きを行なう場合においても、買戻しを行なう際に、市場の時価変動などにより調達コストが担保金を上回る可能性もあり、不足金額をファンドが負担することにより、その結果ファンドに損害が発生する恐れがあります。

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

（２）リスク管理体制



■全社的リスク管理

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

■運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

■法令など遵守状況のモニタリング

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

※上記体制は2024年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	8.4%	14.7%	21.7%	11.7%	-1.7%	5.3%	6.6%
最大値	13.1%	42.1%	59.8%	62.7%	2.3%	15.3%	21.5%
最小値	6.2%	-9.5%	-12.4%	-19.4%	-5.5%	-6.1%	-8.8%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
※上記は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して計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。ただし、当ファンドは直近1年間の騰落率が5年分ないため、設定日以降算出できる値を使用しています。

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。
※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、2023年6月末の基準価額を起点として指数化しています。
※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）は、分配金（税引前）を再投資したものとして計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

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

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

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

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

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

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

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社の照会先にお問い合わせください。
・販売会社における申込手数料率は2.2%（税抜2%）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】

① 換金手数料
ありません。
② 信託財産留保額
ありません。

（３）【信託報酬等】

① 信託報酬
信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.4785%（税抜0.435%）の率を乗じて得た額とします。
※この他に、実質的に不動産投信に投資する場合には、運用などに係る費用がかかりますが、投資する銘柄は固定されていないため、事前に料率、上限額などを表示することができません。
② 信託報酬の配分
信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.435%	0.205%	0.205%	0.025%

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

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

（４）【その他の手数料等】

以下の諸費用およびそれに付随する消費税等相当額について、委託会社は、その支払いをファンドのために行ない、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。（以下「実費方式」といいます。）なお、①から⑦までに該当する業務を委託する場合は、その委託費用を含みます。また、実際に支払う金額の支弁を受ける代わりに、その金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、見積額に基づいて見積率を算出し、かかる見積率を信託財産の純資産総額に乗じて得た額をかかる諸費用の合計額とみなして、信託財産から支弁を受けることができます。（以下「見積方式」といいます。）ただし、委託会社は、信託財産の規模などを考慮して、信託の設定時または期中に、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。
① ファンドの計理業務（設定解約処理、約定処理、基準価額算出、決算処理等）およびこれに付随する業務（法定帳簿管理、法定報告等）に係る費用。
② 振替受益権に係る費用ならびにやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合における発行および管理事務に係る費用。
③ 有価証券届出書、有価証券報告書、半期報告書および臨時報告書（これらの訂正に係る書類を含みます。）の作成、印刷および提出に係る費用。

④　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。）。
⑤　信託約款の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。
⑥　運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。
⑦　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。
⑧　格付の取得に要する費用。
⑨　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。
⑩　ファンドおよび主要投資対象である各マザーファンドの運用において利用する指数の標章使用料。
⑪　ファンドおよび主要投資対象である各マザーファンドの運用において利用する指数の指数値、構成銘柄、構成比率等の情報および投資対象市場の動向や特性等に関する情報の入手に要する費用。
⑫　ファンドおよび主要投資対象である各マザーファンドの運用において、クリアリング機構を利用した場合に生じる諸費用（当該関連費用を受託会社から請求された場合も含みます。）。

信託財産に関する以下の費用・報酬およびそれに付随する消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払います。
①　組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および先物・オプション取引などに要する費用。
②　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用、解約に伴なう支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。
③　有価証券の貸付を行なった場合に限り、その対価としての品貸料（マザーファンド（当該マザーファンドの約款において、品貸料の一部を、同マザーファンドに投資を行なっている証券投資信託の報酬として収受する規定のあるものに限ります。）における品貸料については、他の証券投資信託が同一のマザーファンドに投資を行なっている場合は、マザーファンドの純資産総額における当該各証券投資信託の時価総額に応じて、毎日按分するものとします。）に0.55（税抜0.5）を乗じて得た貸付有価証券関連報酬。委託会社と受託会社の配分は４：１とし、信託報酬と同時期に支払います。

＜投資対象とするマザーファンドに係る費用＞
・組入有価証券の売買時の売買委託手数料
・信託事務の処理に要する諸費用
・信託財産に関する租税　など

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。
・公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に少額投資非課税制度（NISA）の適用対象となります。
・当ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」および「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

①　個人受益者の場合
１）収益分配金に対する課税
収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）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ます。）と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益（譲渡益）、普通分配金および特定公社債等の利子所得（申告分離課税を選択したものに限ります。）については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。
※少額投資非課税制度（NISA）をご利用の場合、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②　法人受益者の場合
１）収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

２）益金不算入制度の適用
益金不算入制度は適用されません。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③　個別元本

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

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

④　普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

２）受益者が収益分配金を受け取る際

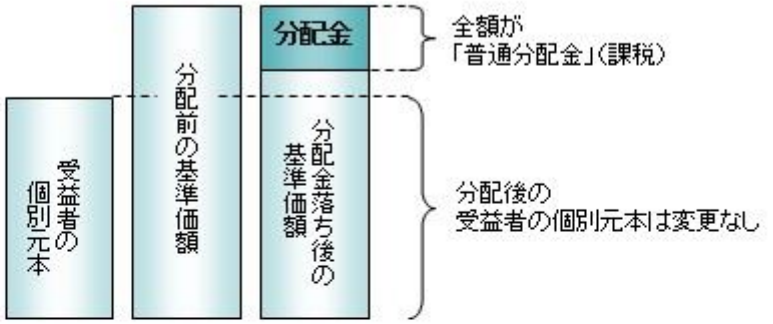
イ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

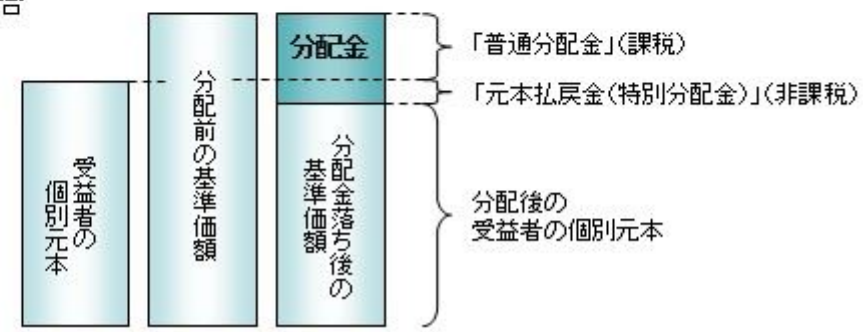
ハ）収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

＜分配金に関するイメージ図＞

イ）の場合



ロ）、ハ）の場合



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

※上記は2025年3月17日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

（参考情報）ファンドの総経費率

対象期間:2023年6月20日～2024年6月17日

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
0.62%	0.47%	0.15%

※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】

【Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）】

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	38,534,845	97.81
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	―	862,972	2.19
合計（純資産総額）		39,397,817	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	7,370,873	1.3090	9,648,798	1.2953	9,547,491	24.23
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	2,489,275	3.0437	7,576,849	3.0837	7,676,177	19.48
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	1,061,406	3.4909	3,705,281	3.6808	3,906,823	9.92
日本	親投資信託受益証券	海外新興国債券インデックスＬｏｃａｌ（ヘッジなし）マザーファンド	2,102,414	1.7826	3,747,769	1.8293	3,845,945	9.76
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	2,921,292	1.3160	3,844,463	1.3079	3,820,757	9.70
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	675,845	2.7686	1,871,155	2.9224	1,975,089	5.01
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	813,225	2.4232	1,970,664	2.4083	1,958,489	4.97
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	267,269	6.6837	1,786,363	7.2833	1,946,600	4.94
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド	649,603	2.8335	1,840,677	2.9849	1,938,999	4.92
日本	親投資信託受益証券	海外新興国株式インデックスＭＳＣＩエマージング（ヘッジなし）マザーファンド	639,428	2.9105	1,861,075	3.0003	1,918,475	4.87

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(％)
親投資信託受益証券	97.81
合　　計	97.81

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末　　(2024年 6月17日)	26	26	1.0803	1.0803
2023年12月末日	15	—	1.0309	—
2024年 1月末日	16	—	1.0385	—
2月末日	18	—	1.0486	—
3月末日	20	—	1.0670	—
4月末日	22	—	1.0663	—
5月末日	24	—	1.0691	—
6月末日	27	—	1.0930	—
7月末日	29	—	1.0781	—
8月末日	31	—	1.0732	—
9月末日	32	—	1.0833	—
10月末日	34	—	1.0994	—
11月末日	34	—	1.0901	—
12月末日	39	—	1.0992	—

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2023年 6月20日～2024年 6月17日	0.0000
当中間期	2024年 6月18日～2024年12月17日	—

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2023年 6月20日～2024年 6月17日	8.03
当中間期	2024年 6月18日～2024年12月17日	1.54

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2023年 6月20日～2024年 6月17日	27,474,160	3,152,279
当中間期	2024年 6月18日～2024年12月17日	11,582,241	2,585,578

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

（参考）

日本株式インデックス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
	バミューダ	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。

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド

以下の運用状況は2024年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	20,228,599,124	72.48
	カナダ	873,003,088	3.13
	ドイツ	610,069,478	2.19
	イタリア	145,124,837	0.52

	フランス	668,382,014	2.39
	オランダ	435,333,268	1.56
	スペイン	173,722,295	0.62
	ベルギー	40,917,939	0.15
	オーストリア	12,365,009	0.04
	ルクセンブルク	42,190,012	0.15
	フィンランド	59,906,653	0.21
	アイルランド	509,660,046	1.83
	ポルトガル	10,384,394	0.04
	イギリス	931,537,055	3.34
	スイス	690,972,494	2.48
	スウェーデン	198,161,903	0.71
	ノルウェー	38,865,200	0.14
	デンマーク	197,301,661	0.71
	ケイマン	40,427,267	0.14
	オーストラリア	449,162,029	1.61
	バミューダ	24,073,238	0.09
	ニュージーランド	15,156,997	0.05
	香港	103,281,087	0.37
	シンガポール	80,326,599	0.29
	イスラエル	61,131,301	0.22
	ジャージー	39,654,383	0.14
	マン島	2,232,584	0.01
	小計	26,681,941,955	95.61
新株予約権証券	カナダ	0	0.00
投資証券	アメリカ	438,281,531	1.57
	フランス	4,184,066	0.01
	イギリス	6,597,674	0.02
	オーストラリア	27,966,124	0.10
	香港	4,478,953	0.02
	シンガポール	4,123,906	0.01
	小計	485,632,254	1.74
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	740,629,602	2.65
合計（純資産総額）		27,908,203,811	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	667,345,602	2.39
	買建	ドイツ	99,558,905	0.36

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	—	27,571,817,507	△98.79

(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	38,990	36,608.90	1,427,381,236	40,429.22	1,576,335,530	5.65
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	62,910	22,388.79	1,408,479,232	21,672.24	1,363,400,732	4.89
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	18,100	67,724.76	1,225,818,283	68,101.23	1,232,632,361	4.42
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	24,230	29,710.94	719,896,304	35,392.77	857,566,938	3.07
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	5,600	90,676.68	507,789,435	94,877.94	531,316,496	1.90
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	7,370	42,580.47	313,818,095	68,279.97	503,223,444	1.80
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	14,980	26,142.40	391,613,280	30,490.77	456,751,836	1.64
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	11,370	27,365.14	311,141,642	38,240.01	434,788,971	1.56
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	12,940	26,414.47	341,803,348	30,693.24	397,170,619	1.42
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	7,260	35,164.99	255,297,870	38,148.27	276,956,445	0.99
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,070	141,207.28	292,299,082	123,881.83	256,435,389	0.92
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	3,380	71,815.30	242,735,720	72,210.75	244,072,341	0.87
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	4,260	44,704.45	190,440,969	50,405.63	214,728,021	0.77
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	11,330	18,900.92	214,147,517	16,843.00	190,831,263	0.68
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	2,350	89,302.10	209,859,937	80,670.21	189,575,013	0.68
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	2,110	80,254.20	169,336,373	84,183.39	177,626,966	0.64
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	1,130	140,973.17	159,299,693	148,641.74	167,965,173	0.60
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	11,240	13,051.43	146,698,094	14,498.77	162,966,274	0.58
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	5,980	26,609.03	159,122,056	26,816.25	160,361,207	0.57
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	1,100	119,375.28	131,312,811	143,556.25	157,911,885	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	2,530	63,099.58	159,641,947	62,142.59	157,220,765	0.56

アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6,120	25,447.99	155,741,750	22,944.00	140,417,335	0.50
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	2,450	45,944.96	112,565,158	53,536.02	131,163,251	0.47
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,510	29,714.11	134,010,649	28,157.62	126,990,874	0.46
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	17,740	6,626.16	117,548,082	7,013.70	124,423,059	0.45
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	1,040	109,523.37	113,904,307	112,953.70	117,471,856	0.42
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8,280	17,340.87	143,582,429	14,059.74	116,414,722	0.42
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	4,260	27,447.39	116,925,896	26,726.09	113,853,155	0.41
ドイツ	株式	SAP SE	ソフトウェア・サービス	2,690	36,455.56	98,065,473	39,498.34	106,250,535	0.38
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	10,630	10,585.40	112,522,862	9,878.34	105,006,765	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	3.71
		素材	3.10
		資本財	6.70
		商業・専門サービス	1.49
		運輸	1.42
		自動車・自動車部品	2.34
		耐久消費財・アパレル	1.16
		消費者サービス	1.97
		メディア・娯楽	6.88
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.11
		生活必需品流通・小売り	1.80
		食品・飲料・タバコ	2.66
		家庭用品・パーソナル用品	1.42
		ヘルスケア機器・サービス	3.66
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.52
		銀行	5.58
		金融サービス	7.00
		保険	2.90
		ソフトウェア・サービス	10.04
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.16
		電気通信サービス	1.08
		公益事業	2.45
		半導体・半導体製造装置	9.18

		不動産管理・開発	0.27
新株予約権証券	—	—	—
投資証券	—	—	1.74
合　　計			97.35

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	14	米ドル	4,288,200	678,307,476	4,218,900	667,345,602	2.39
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2503	買建	14	ユーロ	617,120	101,775,430	603,680	99,558,905	0.36

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	137,467,000.00	20,811,692,234	21,630,922,740	△77.51
	加ドル	売建	7,806,000.00	853,820,878	854,985,770	△3.06
	ユーロ	売建	14,055,000.00	2,296,464,772	2,312,934,740	△8.29
	英ポンド	売建	4,943,000.00	968,856,850	980,511,751	△3.51
	スイスフラン	売建	3,528,000.00	619,719,533	618,502,435	△2.22
	スウェーデンクローナ	売建	13,774,000.00	196,942,307	197,922,886	△0.71
	ノルウェークローネ	売建	2,790,000.00	38,520,022	38,796,037	△0.14
	デンマーククローネ	売建	8,945,000.00	195,020,315	197,276,059	△0.71
	豪ドル	売建	5,008,000.00	499,839,904	491,787,605	△1.76
	ニュージーランドドル	売建	93,000.00	8,423,503	8,278,029	△0.03
	香港ドル	売建	6,188,000.00	120,720,503	125,585,651	△0.45
	シンガポールドル	売建	730,000.00	83,807,145	84,872,225	△0.30
	イスラエルシュケル	売建	688,000.00	27,930,305	29,441,579	△0.11

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外新興国株式インデックスＭＳＣＩエマージング（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2024年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	434,823,720	0.34
	メキシコ	2,069,850,293	1.61
	ブラジル	4,325,831,738	3.37
	チリ	501,869,616	0.39
	コロンビア	119,879,627	0.09
	ペルー	231,947,876	0.18

	オランダ	65,344,108	0.05
	ルクセンブルク	112,444,610	0.09
	ギリシャ	586,981,911	0.46
	イギリス	176,874,154	0.14
	トルコ	818,147,985	0.64
	チェコ	166,564,275	0.13
	キプロス	0	0.00
	ハンガリー	295,733,528	0.23
	ポーランド	926,816,096	0.72
	ロシア	11,577	0.00
	ケイマン	13,523,484,733	10.52
	バミューダ	231,727,937	0.18
	香港	1,606,386,908	1.25
	シンガポール	26,487,377	0.02
	マレーシア	1,853,993,155	1.44
	タイ	1,760,086,770	1.37
	フィリピン	652,225,081	0.51
	インドネシア	1,785,475,492	1.39
	韓国	10,990,237,744	8.55
	台湾	23,827,476,789	18.54
	中国	19,349,652,348	15.06
	インド	23,792,666,717	18.51
	カタール	1,033,071,073	0.80
	エジプト	70,254,698	0.05
	南アフリカ	3,333,153,625	2.59
	アラブ首長国連邦	1,664,663,948	1.30
	クウェート	908,195,252	0.71
	サウジアラビア	4,978,952,638	3.87
	小計	122,221,313,399	95.11
投資証券	メキシコ	95,637,798	0.07
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	6,190,213,615	4.82
合計（純資産総額）		128,507,164,812	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,209,832,298	4.05

(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	—	118,530,000	0.09
	売建	—	1,003,427,000	△0.78

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,468,355	4,059.97	10,021,461,628	5,252.92	12,966,091,093	10.09
中国	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	651,750	7,779.45	5,070,258,884	8,506.61	5,544,184,371	4.31
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	477,120	8,392.16	4,004,068,301	5,778.11	2,756,856,614	2.15
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	1,628,900	1,683.57	2,742,369,868	1,678.29	2,733,771,468	2.13
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	560,743	2,939.42	1,648,262,544	3,344.74	1,875,542,346	1.46
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	497,785	2,483.09	1,236,049,535	3,152.78	1,569,409,579	1.22
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	608,354	2,637.92	1,604,793,077	2,271.15	1,381,665,012	1.08
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	9,606,920	113.31	1,088,587,005	131.85	1,266,755,022	0.99
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	520,267	2,098.91	1,091,997,250	2,432.04	1,265,311,715	0.98
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	331,838	2,662.75	883,604,090	3,565.15	1,183,053,905	0.92
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,246,212	823.16	1,025,841,281	898.78	1,120,071,418	0.87
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費財・サービス流通・小売り	69,370	21,314.75	1,478,604,554	15,414.64	1,069,313,646	0.83
ケイマン	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,535,200	407.39	625,434,646	695.97	1,068,463,890	0.83
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	151,932	5,565.69	845,607,033	6,891.45	1,047,032,693	0.81
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	54,550	19,876.89	1,084,284,755	18,776.20	1,024,241,710	0.80
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	254,275	2,518.99	640,518,216	2,975.72	756,651,457	0.59
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	194,532	3,388.11	659,096,379	3,885.15	755,787,945	0.59
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA - H	銀行	6,901,575	91.30	630,130,361	105.16	725,775,148	0.56
ケイマン	株式	TRIP.COM GROUP LTD	消費者サービス	61,290	8,745.99	536,041,937	11,392.42	698,241,422	0.54
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	89,709	7,228.35	648,448,104	7,746.62	694,941,623	0.54
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	一般消費財・サービス流通・小売り	246,823	2,591.72	639,697,241	2,769.64	683,611,347	0.53
サウジアラビア	株式	SAUDI ARABIAN OIL CO	エネルギー	575,439	1,211.14	696,942,920	1,176.10	676,776,973	0.53
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	654,000	812.75	531,541,378	944.61	617,776,902	0.48
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	17,150	34,052.87	584,006,767	35,972.93	616,935,870	0.48
中国	株式	BANK OF CHINA LTD - H	銀行	7,208,000	75.20	542,057,458	80.29	578,782,218	0.45

中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	102,000	4,536.99	462,773,551	5,575.96	568,748,736	0.44
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	192,675	3,182.94	613,274,583	2,891.92	557,201,071	0.43
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	5,494,900	93.41	513,319,392	96.04	527,730,196	0.41
インド	株式	MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	自動車・自動車部品	92,370	4,300.43	397,230,866	5,671.97	523,920,515	0.41
ケイマン	株式	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	銀行	293,650	2,366.37	694,885,373	1,633.99	479,823,924	0.37

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	4.30
		素材	5.46
		資本財	4.52
		商業・専門サービス	0.03
		運輸	1.77
		自動車・自動車部品	3.50
		耐久消費財・アパレル	1.20
		消費者サービス	2.92
		メディア・娯楽	6.32
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.91
		生活必需品流通・小売り	1.10
		食品・飲料・タバコ	2.86
		家庭用品・パーソナル用品	0.60
		ヘルスケア機器・サービス	0.84
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.41
		銀行	16.91
		金融サービス	2.71
		保険	2.91
		ソフトウェア・サービス	2.56
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.50
		電気通信サービス	2.65
		公益事業	2.57
		半導体・半導体製造装置	13.11
		不動産管理・開発	1.46
投資証券	―	―	0.07
合　　計			95.18

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（各通貨）	契約額等（円）	評価額（各通貨）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	アメリカ	ニューヨーク証券取引所	MINMSCIE2503	買建	606	米ドル	33,711,620	5,332,504,052	32,936,100	5,209,832,298	4.05

(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	750,000.00	118,462,500	118,530,000	0.09
	米ドル	売建	6,350,000.00	1,003,236,500	1,003,427,000	△0.78

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

以下の運用状況は2024年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	アクティビア・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	ＮＴＴ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

ロ.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。

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

以下の運用状況は2024年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	11,230,847,715	47.08
	カナダ	448,731,362	1.88
	メキシコ	166,313,331	0.70
	ドイツ	1,372,720,372	5.75
	イタリア	1,624,653,422	6.81
	フランス	1,710,824,415	7.17
	オランダ	306,088,859	1.28
	スペイン	1,018,505,069	4.27
	ベルギー	373,558,103	1.57
	オーストリア	232,190,495	0.97
	フィンランド	97,344,739	0.41
	アイルランド	126,552,624	0.53
	ポルトガル	120,517,896	0.51
	イギリス	1,228,923,692	5.15
	スウェーデン	57,522,823	0.24
	ノルウェー	43,809,281	0.18
	デンマーク	64,575,275	0.27
	ポーランド	114,895,813	0.48
	オーストラリア	282,761,398	1.19
	ニュージーランド	39,879,977	0.17
	シンガポール	98,036,745	0.41
	マレーシア	293,001,759	1.23
	中国	2,759,788,180	11.57
	イスラエル	51,093,761	0.21
	小計	23,863,137,106	100.04
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	△9,161,521	△0.04
合計（純資産総額）		23,853,975,585	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	—	24,352,835,856	△102.09

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	15,179.71	485,750,786	15,160.24	485,127,683	2.000	2026/11/15	2.03
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,100,000	15,224.82	319,721,325	15,256.33	320,383,024	1.625	2026/5/15	1.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,200,000	14,487.67	318,728,841	14,479.33	318,545,447	0.500	2027/4/30	1.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,100,000	13,879.66	291,472,908	13,686.88	287,424,655	1.500	2030/2/15	1.20
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,740,000	14,252.25	247,989,242	14,208.39	247,226,020	0.625	2027/11/30	1.04
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	15,306.99	244,911,992	15,356.73	245,707,701	1.625	2026/2/15	1.03
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	15,528.19	232,922,977	15,567.82	233,517,338	2.625	2025/12/31	0.98
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	14,716.90	235,470,545	14,536.48	232,583,823	2.375	2029/5/15	0.98
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	15,165.50	227,482,613	15,266.34	228,995,209	0.375	2025/11/30	0.96
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	15,176.01	227,640,160	15,119.46	226,791,920	2.375	2027/5/15	0.95
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	15,158.08	227,371,333	15,004.54	225,068,153	2.875	2028/8/15	0.94
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,450,000	15,729.38	228,076,024	15,377.73	222,977,195	4.125	2032/11/15	0.93
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,350,000	15,967.16	215,556,711	15,782.45	213,063,169	4.375	2028/11/30	0.89
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	15,991.00	191,892,018	15,525.11	186,301,367	4.375	2034/5/15	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	14,886.82	178,641,911	14,930.08	179,161,058	0.625	2026/7/31	0.75
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	15,798.22	173,780,503	15,454.67	170,001,440	4.125	2031/7/31	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	14,138.57	169,662,856	14,038.15	168,457,904	1.000	2028/7/31	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	15,189.59	167,085,582	15,155.30	166,708,354	2.250	2027/2/15	0.70
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	15,066.01	165,726,135	15,000.52	165,005,783	2.250	2027/8/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,150,000	14,308.17	164,543,977	14,210.85	163,424,885	1.250	2028/6/30	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	14,238.66	156,625,344	14,199.42	156,193,655	0.500	2027/10/31	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	15,058.60	150,586,094	15,141.10	151,411,003	0.500	2026/2/28	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	16,954.28	152,588,574	16,538.76	148,848,867	5.375	2031/2/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	14,789.83	147,898,300	14,780.86	147,808,612	1.125	2027/2/28	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	950,000	15,753.11	149,654,589	15,479.38	147,054,149	4.000	2030/2/28	0.62
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	950,000	15,322.02	145,559,233	15,215.28	144,545,239	1.500	2031/5/25	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	14,445.04	144,450,450	14,284.99	142,849,985	1.875	2029/2/28	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	14,371.50	143,715,071	14,284.38	142,843,816	1.250	2028/4/30	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,270,000	11,640.73	147,837,336	11,026.87	140,041,251	2.875	2052/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	15,108.95	135,980,624	15,119.46	136,075,152	1.500	2026/8/15	0.57

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	100.04
合　　計	100.04

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	72,619,000.00	10,876,518,394	11,380,349,688	△47.71
	加ドル	売建	4,162,000.00	443,302,194	454,131,888	△1.90
	メキシコペソ	売建	22,519,000.00	166,231,174	172,251,298	△0.72
	ユーロ	売建	43,966,000.00	6,978,046,980	7,208,130,481	△30.22
	英ポンド	売建	6,302,000.00	1,201,231,638	1,241,625,216	△5.21
	スウェーデンクローナ	売建	4,073,000.00	56,305,544	58,304,528	△0.24
	ノルウェークローネ	売建	3,283,000.00	44,341,705	45,390,943	△0.19
	デンマーククローネ	売建	2,950,000.00	64,426,002	65,051,017	△0.27
	ポーランドズロチ	売建	3,073,000.00	113,756,942	117,320,089	△0.49
	豪ドル	売建	2,908,000.00	289,271,131	285,167,946	△1.20
	ニュージーランドドル	売建	463,000.00	41,549,993	41,046,368	△0.17
	シンガポールドル	売建	891,000.00	101,085,540	103,354,601	△0.43
	マレーシアリンギット	売建	10,630,000.00	353,389,035	373,867,730	△1.57
	中国元	売建	127,360,000.00	2,679,399,504	2,752,507,988	△11.54
	イスラエルシュケル	売建	1,273,000.00	52,135,997	54,336,075	△0.23

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外新興国債券インデックスＬｏｃａｌ（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	メキシコ	1,439,883,606	9.57
	ブラジル	1,053,733,696	7.00
	チリ	245,440,813	1.63
	コロンビア	536,846,985	3.57
	ペルー	300,052,754	1.99
	ウルグアイ	19,693,631	0.13
	ドミニカ共和国	25,236,697	0.17
	トルコ	206,749,107	1.37
	チェコ	771,448,613	5.13
	ハンガリー	356,550,629	2.37
	ポーランド	1,068,510,437	7.10
	ロシア	0	0.00
	ルーマニア	513,083,849	3.41
	マレーシア	1,489,142,403	9.89
	タイ	1,365,667,261	9.07
	インドネシア	1,428,310,125	9.49
	中国	1,488,318,100	9.89
	インド	868,725,338	5.77

	南アフリカ	1,193,749,121	7.93
	セルビア	52,093,895	0.35
	小計	14,423,237,060	95.82
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	628,781,045	4.18
合計（純資産総額）		15,052,018,105	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（%）
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	9,800,000	2,049.16	200,817,718	2,045.66	200,474,828	—	2026/7/1	1.33
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	7,650,000	2,160.48	165,277,153	2,204.08	168,612,194	—	2026/1/1	1.12
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	17,500,000	873.68	152,894,087	880.88	154,154,000	10.500	2026/12/21	1.02
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	21,850,000	601.37	131,399,345	682.36	149,096,616	8.750	2048/2/28	0.99
インド	国債証券	INDIA GOVERNMENT BOND	78,000,000	189.52	147,829,638	188.99	147,419,415	7.170	2030/4/17	0.98
インド	国債証券	INDIA GOVERNMENT BOND	78,000,000	187.53	146,278,026	187.91	146,574,324	7.040	2029/6/3	0.97
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	17,730,000	761.70	135,050,668	811.79	143,931,530	8.000	2030/1/31	0.96
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	18,900,000	719.10	135,910,588	742.23	140,282,703	5.750	2026/3/5	0.93
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	6,490,000	2,439.00	158,291,388	2,154.15	139,804,685	10.000	2029/1/1	0.93
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	19,200,000	694.78	133,398,737	713.55	137,003,155	5.500	2027/3/4	0.91
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	19,050,000	701.72	133,677,705	693.14	132,043,732	7.750	2031/5/29	0.88
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	16,750,000	716.73	120,052,509	785.32	131,542,408	8.250	2032/3/31	0.87
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	17,000,000	689.20	117,164,663	772.09	131,255,884	8.875	2035/2/28	0.87
インド	国債証券	INDIA GOVERNMENT BOND	68,000,000	193.13	131,334,228	191.69	130,353,450	7.300	2053/6/19	0.87
ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	5,570,000	2,501.98	139,360,512	2,318.76	129,155,444	10.000	2027/1/1	0.86
ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	5,400,000	2,279.24	123,079,419	2,385.33	128,808,201	—	2025/7/1	0.86
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	17,130,000	729.77	125,010,073	738.59	126,520,632	7.500	2027/6/3	0.84
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	16,260,000	742.77	120,774,453	735.67	119,620,676	8.500	2029/5/31	0.79
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000	2,679.55	107,182,038	2,936.52	117,461,004	3.810	2050/9/14	0.78
マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	3,330,000	3,408.63	113,507,615	3,435.36	114,397,617	3.757	2040/5/22	0.76
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,880,000	3,959.12	114,022,700	3,896.44	112,217,758	6.000	2033/10/25	0.75
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000	727.95	109,193,449	744.42	111,663,580	7.000	2026/9/3	0.74
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	15,410,000	639.73	98,583,796	720.47	111,025,872	8.500	2037/1/31	0.74

インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	10,100,000,000	1.08	109,116,967	1.06	107,714,985	8.375	2034/3/15	0.72
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,600,000	4,147.36	107,831,537	4,117.20	107,047,422	7.500	2028/7/25	0.71
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	17,560,000	642.41	112,808,704	597.38	104,901,012	7.750	2042/11/13	0.70
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,500,000	677.53	105,018,389	657.90	101,974,889	7.500	2033/5/26	0.68
メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,600,000	738.99	100,503,110	738.10	100,382,264	8.500	2029/3/1	0.67
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,890,000	3,375.31	97,546,599	3,418.74	98,801,666	2.750	2029/10/25	0.66
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,230,000	606.11	86,249,908	687.39	97,816,086	8.750	2044/1/31	0.65

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	95.82
合　　計	95.82

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

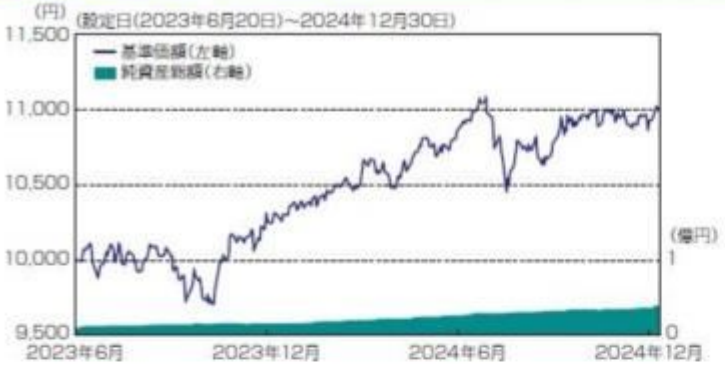
該当事項はありません。

≪参考情報≫

運用実績

2024年12月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額……10,992円
純資産総額……0.39億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2024年6月	設定来累計
0円	0円

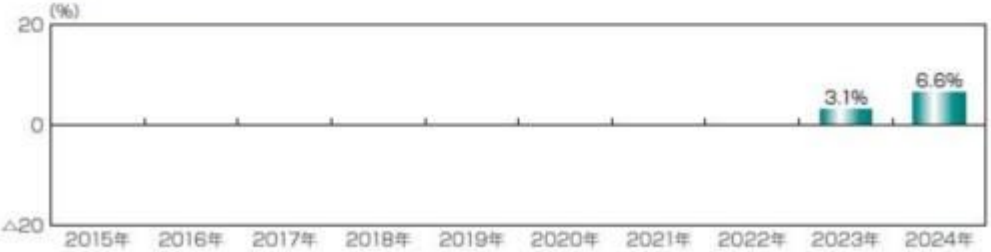
主要な資産の状況

<資産構成比>

資産		マザーファンド	
株式	19.7%	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	5.0%
		海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	4.9%
		海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	4.9%
		海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド	4.9%
REIT	14.9%	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	5.0%
		海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド	9.9%
債券	63.2%	日本債券インデックスマザーファンド	9.7%
		海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	19.5%
		海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	24.2%
		海外新興国債券インデックスLocal(ヘッジなし)マザーファンド	9.8%
現金その他	2.2%		2.2%

※比率は当ファンドの純資産総額比です。

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して計算しております。
※当ファンドには、ベンチマークはありません。
※2023年は、設定時から2023年末までの騰落率です。

※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」を結ぶことができる場合があります。
＜分配金受取りコース＞
収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。
（３）申込みの受付
販売会社の営業日に受け付けます。
（４）取扱時間
原則として、午後3時30分までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。
※販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
（５）取得申込不可日
販売会社の営業日であっても、取得申込日が下記のいずれかに該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
●ニューヨーク証券取引所の休業日
●英国証券取引所の休業日
●ニューヨークの銀行休業日
●ロンドンの銀行休業日
（６）申込金額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、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、金融商品取引所※における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少など、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。
※金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。
(10) 償還乗換
・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができる場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。
(11) 乗換優遇
受益者は、信託期間終了日の１年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができる場合があります。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
●英国証券取引所の休業日
●ニューヨークの銀行休業日
●ロンドンの銀行休業日
（４）解約制限
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
（５）解約価額
解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞
日興アセットマネジメント株式会社
※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。

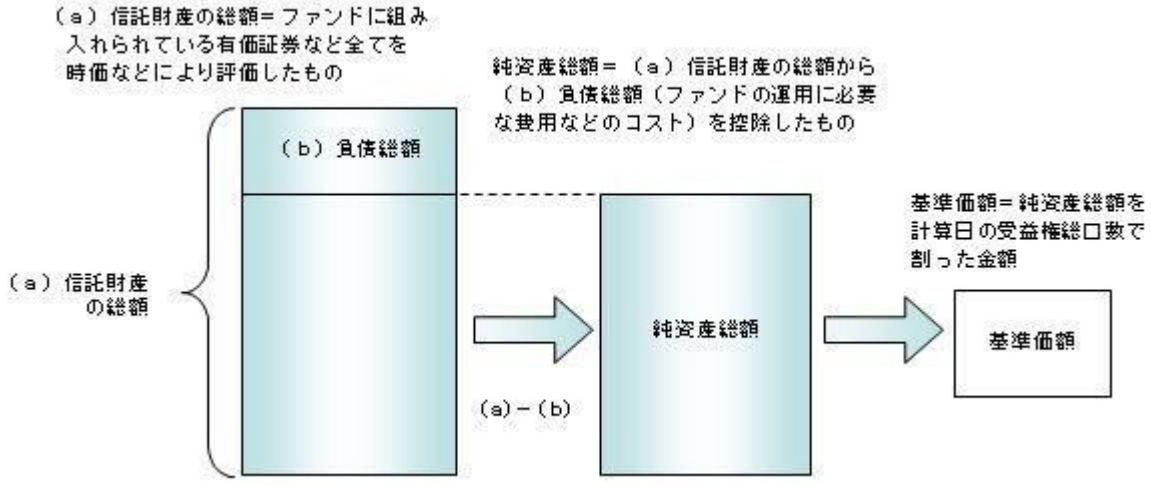
（６）手取額
１口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。
※税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。
詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。
（７）解約単位
1口単位
※販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
（８）解約代金の支払い
原則として、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。
（９）受付の中止および取消
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少など、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

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

＜基準価額算出の流れ＞



② 有価証券などの評価基準
・信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。
＜主な資産の評価方法＞
◇マザーファンド受益証券
基準価額計算日の基準価額で評価します。
◇国内上場株式
原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。
◇外国株式
原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。
◇国内上場不動産投信

原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。
◇海外上場不動産投信
原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。
◇公社債（国内・外国）
原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。
・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
・価格情報会社の提供する価額
※残存期間１年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。
＊外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。
・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

③ 基準価額の照会方法
販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

＜委託会社の照会先＞
日興アセットマネジメント株式会社
※2025年9月1日より「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に変更
ホームページ アドレス　www.nikkoam.com/
※2025年9月1日よりwww.amova-am.comに変更
コールセンター 電話番号　0120-25-1404
午前９時～午後５時　土、日、祝・休日は除きます。

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします（2023年6月20日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

毎年6月16日から翌年6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】

① 信託の終了（繰上償還）
１）委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
イ）受益者の解約により純資産総額が10億円を下回ることとなった場合
ロ）繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
ハ）やむを得ない事情が発生したとき
２）この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
３）委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
イ）信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合
ロ）監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
ハ）委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）
ニ）受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
４）繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

② 償還金について
・償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して５営業日まで）から受益者に支払います。
・償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

③ 信託約款の変更など
１）委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（以下「併合」といいます。）を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
２）この変更事項のうち、その内容が重大なものまたは併合（受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。）については、書面決議を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
３）委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「書面決

議」の規定を適用します。

④ 書面決議

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

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

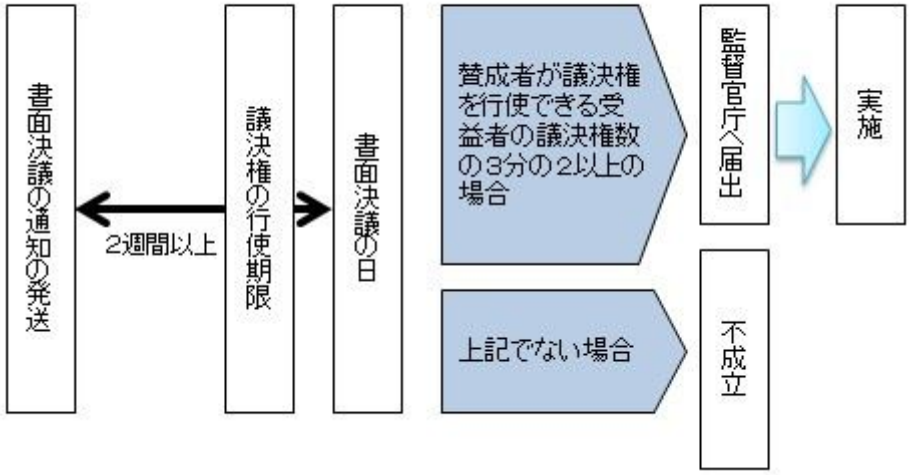
3）書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上にあたる多数をもって行ないます。

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

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

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

＜書面決議の主な流れ＞



⑤ 公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

ホームページ アドレス　www.nikkoam.com/

※2025年9月1日よりwww.amova-am.comに変更

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

⑥ 運用報告書の作成

・委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。

・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス　www.nikkoam.com/

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

⑦ 関係法人との契約について

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

⑧ 他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

１．他の受益者の氏名または名称および住所

２．他の受益者が有する受益権の内容

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

（1）収益分配金・償還金受領権

・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。

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

（2）解約請求権

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

（3）帳簿閲覧権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

（２）　当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、2023年 6月20日から2024年 6月17日までであります。

（３）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（2023年 6月20日から2024年 6月17日まで）の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2024年 6月17日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	746,754
親投資信託受益証券	25,593,043
未収利息	1
流動資産合計	26,339,798
資産合計	26,339,798
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,232
未払受託者報酬	2,692
未払委託者報酬	45,101
その他未払費用	16,527
流動負債合計	65,552
負債合計	65,552
純資産の部	
元本等	
元本	24,321,881
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,952,365
（分配準備積立金）	1,377,961
元本等合計	26,274,246
純資産合計	26,274,246
負債純資産合計	26,339,798

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　2023年 6月20日 至　2024年 6月17日
営業収益	
受取利息	97
有価証券売買等損益	1,541,495
営業収益合計	1,541,592
営業費用	
支払利息	43
受託者報酬	4,548
委託者報酬	76,775
その他費用	16,754
営業費用合計	98,120
営業利益又は営業損失（△）	1,443,472
経常利益又は経常損失（△）	1,443,472
当期純利益又は当期純損失（△）	1,443,472
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（△）	65,511
期首剰余金又は期首欠損金（△）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	588,730
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	588,730
剰余金減少額又は欠損金増加額	14,326
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	14,326
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,952,365

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		第1期 2024年 6月17日現在
１．	期首元本額	10,000,000円
	期中追加設定元本額	17,474,160円
	期中一部解約元本額	3,152,279円
２．	受益権の総数	24,321,881口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第1期 自 2023年 6月20日 至 2024年 6月17日	
分配金の計算過程	
A 計算期末における費用控除後の配当等収益	460,040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	917,921円
C 信託約款に定める収益調整金	574,404円
D 信託約款に定める分配準備積立金	0円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	1,952,365円
F 分配対象収益(1万口当たり)	802円
G 分配金額	0円
H 分配金額(1万口当たり)	0円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	第1期 自 2023年 6月20日 至 2024年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

第1期（2024年 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
親投資信託受益証券	1,489,183
合計	1,489,183

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

第1期 2024年 6月17日現在

1口当たり純資産額	1.0803円
(1万口当たり純資産額)	(10,803円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド	193,460	1,291,751	
	海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド	458,325	1,282,255	
	日本債券インデックスマザーファンド	1,939,689	2,555,152	
	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	1,681,178	5,144,572	
	海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	4,887,646	6,396,462	
	日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド	446,332	1,248,524	
	日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	523,009	1,268,767	
	海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	749,943	2,566,079	
	海外新興国株式インデックスＭＳＣＩエマージング（ヘッジなし）マザーファンド	441,976	1,298,348	
	海外新興国債券インデックスＬｏｃａｌ（ヘッジなし）マザーファンド	1,424,562	2,541,133	
合計		12,746,120	25,593,043	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

（参考）

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 6月17日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	299,696,528
株式	58,888,845,740
未収配当金	404,352,660
未収利息	676

	2024年 6月17日現在
前払金	2,920,000
流動資産合計	59,595,815,604
資産合計	59,595,815,604
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,541,000
未払金	165,983,820
未払解約金	11,544,635
流動負債合計	191,069,455
負債合計	191,069,455
純資産の部	
元本等	
元本	21,236,631,163
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	38,168,114,986
元本等合計	59,404,746,149
純資産合計	59,404,746,149
負債純資産合計	59,595,815,604

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 6月17日現在
1．	期首	2023年 6月20日
	期首元本額	21,757,908,489円
	期首からの追加設定元本額	2,017,601,008円
	期首からの一部解約元本額	2,538,878,334円
	元本の内訳　※	
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	681,338,410円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	1,947,507,760円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	4,392,023,539円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	5,655,513,527円
	インデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）	1,844,251,733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
	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
	Ｔｒａｃｅｒｓ　グローバル３分法（おとなのバランス）	1,798,631円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	992,874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
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	1,438,069,127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
	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
	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
	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
	計	21,236,631,163円
2．	受益権の総数	21,236,631,163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

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2023年 6月20日 至 2024年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

（2024年 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

(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	552,230,000	－	538,700,000	△13,530,000
合計		552,230,000	－	538,700,000	△13,530,000

（注）1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2024年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	2.7973円
(1万口当たり純資産額)	(27,973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	1,000	3,865.00	3,865,000	
ニッスイ	21,500	849.30	18,259,950	
マルハニチロ	3,200	3,102.00	9,926,400	
雪国まいたけ	2,200	982.00	2,160,400	
カネコ種苗	500	1,399.00	699,500	
サカタのタネ	2,400	3,355.00	8,052,000	
ホクト	1,700	1,863.00	3,167,100	
ホクリヨウ	200	995.00	199,000	
住石ホールディングス	3,200	1,321.00	4,227,200	
日鉄鉱業	800	5,040.00	4,032,000	
三井松島ホールディングス	1,400	4,685.00	6,559,000	
ＩＮＰＥＸ	72,800	2,268.00	165,110,400	
石油資源開発	2,500	6,350.00	15,875,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	900	4,170.00	3,753,000	
ショーボンドホールディングス	3,000	5,748.00	17,244,000	
ミライト・ワン	6,600	2,012.50	13,282,500	
日本アクア	1,100	927.00	1,019,700	
キャンディル	800	618.00	494,400	
ダイセキ環境ソリューション	600	969.00	581,400	
第一カッター興業	1,100	1,541.00	1,695,100	
安藤・間	12,600	1,091.00	13,746,600	
東急建設	6,800	752.00	5,113,600	
コムシスホールディングス	6,900	3,087.00	21,300,300	
ビーアールホールディングス	5,000	357.00	1,785,000	
高松コンストラクショングループ	1,600	2,881.00	4,609,600	
東建コーポレーション	500	12,130.00	6,065,000	
ヤマウラ	1,600	1,275.00	2,040,000	
オリエンタル白石	9,700	342.00	3,317,400	
大成建設	13,900	5,754.00	79,980,600	
大林組	54,300	1,773.00	96,273,900	
清水建設	43,000	836.00	35,948,000	
飛島建設	1,300	1,442.00	1,874,600	

長谷工コーポレーション	14,000	1,710.50	23,947,000	
松井建設	1,000	828.00	828,000	
鹿島建設	33,600	2,669.00	89,678,400	
不動テトラ	1,100	2,541.00	2,795,100	
鉄建建設	1,200	2,515.00	3,018,000	
西松建設	2,900	4,378.00	12,696,200	
三井住友建設	10,600	392.00	4,155,200	
大豊建設	400	3,375.00	1,350,000	
奥村組	2,500	4,840.00	12,100,000	
東鉄工業	2,000	3,110.00	6,220,000	
イチケン	400	2,502.00	1,000,800	
淺沼組	1,100	3,600.00	3,960,000	
戸田建設	20,400	1,041.00	21,236,400	
熊谷組	2,500	3,515.00	8,787,500	
北野建設	200	3,580.00	716,000	
植木組	300	1,614.00	484,200	
矢作建設工業	2,500	1,545.00	3,862,500	
ピーエス三菱	2,500	985.00	2,462,500	
日本ハウスホールディングス	2,100	315.00	661,500	
新日本建設	2,500	1,583.00	3,957,500	
東亜道路工業	3,100	1,200.00	3,720,000	
日本道路	1,700	1,729.00	2,939,300	
東亜建設工業	5,100	1,018.00	5,191,800	
日本国土開発	3,500	447.00	1,564,500	
若築建設	700	3,475.00	2,432,500	
東洋建設	4,100	1,382.00	5,666,200	
五洋建設	21,800	629.30	13,718,740	
福田組	600	5,530.00	3,318,000	
住友林業	13,100	5,380.00	70,478,000	
巴コーポレーション	1,100	806.00	886,600	
大和ハウス工業	42,000	4,000.00	168,000,000	
ライト工業	3,200	2,037.00	6,518,400	
積水ハウス	46,000	3,423.00	157,458,000	
日特建設	2,000	1,090.00	2,180,000	
北陸電気工事	900	1,163.00	1,046,700	
ユアテック	3,300	1,549.00	5,111,700	
日本リーテック	1,000	1,186.00	1,186,000	
四電工	600	3,540.00	2,124,000	
中電工	2,200	3,090.00	6,798,000	
関電工	9,400	1,675.00	15,745,000	
きんでん	10,500	3,350.00	35,175,000	
東京エネシス	1,200	1,334.00	1,600,800	

トーエネック	400	5,900.00	2,360,000	
住友電設	1,600	3,895.00	6,232,000	
日本電設工業	2,800	1,884.00	5,275,200	
エクシオグループ	14,800	1,569.00	23,221,200	
新日本空調	1,100	4,055.00	4,460,500	
九電工	3,300	5,780.00	19,074,000	
三機工業	3,500	2,103.00	7,360,500	
日揮ホールディングス	14,900	1,221.50	18,200,350	
中外炉工業	600	3,215.00	1,929,000	
ヤマト	300	963.00	288,900	
太平電業	1,000	5,520.00	5,520,000	
高砂熱学工業	4,100	6,150.00	25,215,000	
三晃金属工業	200	4,335.00	867,000	
朝日工業社	1,500	1,358.00	2,037,000	
明星工業	3,000	1,250.00	3,750,000	
大氣社	1,800	5,090.00	9,162,000	
ダイダン	2,100	3,190.00	6,699,000	
日比谷総合設備	1,200	3,535.00	4,242,000	
テスホールディングス	3,800	417.00	1,584,600	
インフロニア・ホールディングス	17,600	1,243.00	21,876,800	
東洋エンジニアリング	1,900	892.00	1,694,800	
レイズネクスト	2,200	1,780.00	3,916,000	
ニップン	4,600	2,248.00	10,340,800	
日清製粉グループ本社	14,100	1,791.00	25,253,100	
日東富士製粉	400	7,570.00	3,028,000	
昭和産業	1,600	3,095.00	4,952,000	
中部飼料	2,000	1,528.00	3,056,000	
フィード・ワン	2,600	936.00	2,433,600	
東洋精糖	300	1,600.00	480,000	
日本甜菜製糖	700	2,113.00	1,479,100	
DM三井製糖ホールディングス	1,600	3,370.00	5,392,000	
塩水港精糖	1,600	272.00	435,200	
ウェルネオシュガー	900	2,339.00	2,105,100	
森永製菓	6,500	2,498.00	16,237,000	
中村屋	300	3,230.00	969,000	
江崎グリコ	4,300	4,206.00	18,085,800	
名糖産業	400	1,875.00	750,000	
井村屋グループ	1,100	2,442.00	2,686,200	
不二家	800	2,564.00	2,051,200	
山崎製パン	10,200	3,440.00	35,088,000	
モロゾフ	600	4,555.00	2,733,000	
亀田製菓	800	4,105.00	3,284,000	

寿スピリッツ	7,400	1,877.50	13,893,500	
カルビー	7,000	3,075.00	21,525,000	
森永乳業	5,400	3,248.00	17,539,200	
六甲バター	800	1,485.00	1,188,000	
ヤクルト本社	21,800	2,815.00	61,367,000	
明治ホールディングス	18,700	3,472.00	64,926,400	
雪印メグミルク	3,600	2,478.00	8,920,800	
プリマハム	2,000	2,378.00	4,756,000	
日本ハム	6,500	4,634.00	30,121,000	
林兼産業	400	530.00	212,000	
丸大食品	1,200	1,680.00	2,016,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1,700	2,853.00	4,850,100	
柿安本店	400	2,545.00	1,018,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	2,300	4,160.00	9,568,000	
サッポロホールディングス	5,000	5,615.00	28,075,000	
アサヒグループホールディングス	35,200	5,630.00	198,176,000	
キリンホールディングス	63,400	2,068.00	131,111,200	
宝ホールディングス	10,300	1,063.00	10,948,900	
オエノンホールディングス	6,000	367.00	2,202,000	
養命酒製造	300	2,276.00	682,800	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	11,900	1,927.50	22,937,250	
ライフドリンク　カンパニー	400	6,680.00	2,672,000	
サントリー食品インターナショナル	10,700	5,684.00	60,818,800	
ダイドーグループホールディングス	1,700	2,675.00	4,547,500	
伊藤園	5,200	3,419.00	17,778,800	
キーコーヒー	1,600	2,054.00	3,286,400	
ユニカフェ	400	918.00	367,200	
ジャパンフーズ	300	1,992.00	597,600	
日清オイリオグループ	2,100	4,765.00	10,006,500	
不二製油グループ本社	3,500	2,832.50	9,913,750	
Ｊ－オイルミルズ	1,700	1,937.00	3,292,900	
キッコーマン	50,400	1,811.00	91,274,400	
味の素	36,200	5,744.00	207,932,800	
ブルドックソース	600	1,947.00	1,168,200	
キユーピー	8,200	3,156.00	25,879,200	
ハウス食品グループ本社	5,300	2,887.00	15,301,100	
カゴメ	6,500	3,340.00	21,710,000	
アリアケジャパン	1,500	5,170.00	7,755,000	
エバラ食品工業	400	2,898.00	1,159,200	
やまみ	200	3,390.00	678,000	
ニチレイ	7,000	3,616.00	25,312,000	
東洋水産	7,700	9,638.00	74,212,600	

イートアンドホールディングス	700	2,105.00	1,473,500	
大冷	200	1,912.00	382,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	400	1,797.00	718,800	
日清食品ホールディングス	16,100	4,183.00	67,346,300	
永谷園ホールディングス	900	3,095.00	2,785,500	
フジッコ	1,500	1,850.00	2,775,000	
ロック・フィールド	1,800	1,416.00	2,548,800	
日本たばこ産業	92,600	4,481.00	414,940,600	
ケンコーマヨネーズ	1,000	1,947.00	1,947,000	
わらべや日洋ホールディングス	900	2,282.00	2,053,800	
なとり	1,100	2,121.00	2,333,100	
イフジ産業	300	1,382.00	414,600	
ファーマフーズ	2,600	975.00	2,535,000	
ユーグレナ	9,200	544.00	5,004,800	
紀文食品	1,000	1,258.00	1,258,000	
ピックルスホールディングス	900	1,160.00	1,044,000	
理研ビタミン	1,400	2,574.00	3,603,600	
片倉工業	1,400	2,056.00	2,878,400	
グンゼ	1,100	5,710.00	6,281,000	
東洋紡	6,400	1,030.00	6,592,000	
ユニチカ	4,300	275.00	1,182,500	
富士紡ホールディングス	600	4,845.00	2,907,000	
倉敷紡績	1,100	4,855.00	5,340,500	
シキボウ	800	1,084.00	867,200	
日本毛織	4,100	1,314.00	5,387,400	
ダイドーリミテッド	2,500	728.00	1,820,000	
帝国繊維	1,700	2,348.00	3,991,600	
帝人	14,800	1,397.50	20,683,000	
東レ	103,800	731.80	75,960,840	
住江織物	100	2,490.00	249,000	
セーレン	3,100	2,442.00	7,570,200	
小松マテーレ	2,100	724.00	1,520,400	
ワコールホールディングス	3,200	4,391.00	14,051,200	
ホギメディカル	2,000	3,925.00	7,850,000	
クラウディアホールディングス	1,800	426.00	766,800	
ＴＳＩホールディングス	4,400	920.00	4,048,000	
マツオカコーポレーション	100	1,657.00	165,700	
ワールド	2,300	2,004.00	4,609,200	
三陽商会	600	2,432.00	1,459,200	
オンワードホールディングス	9,500	609.00	5,785,500	
ルックホールディングス	500	2,715.00	1,357,500	
ゴールドウイン	2,800	8,545.00	23,926,000	

デサント	2,700	3,345.00	9,031,500	
特種東海製紙	900	3,595.00	3,235,500	
王子ホールディングス	64,400	611.00	39,348,400	
日本製紙	8,500	954.00	8,109,000	
三菱製紙	500	807.00	403,500	
北越コーポレーション	7,400	1,133.00	8,384,200	
中越パルプ工業	600	1,529.00	917,400	
大王製紙	6,400	866.40	5,544,960	
レンゴー	14,300	999.50	14,292,850	
トーモク	900	2,707.00	2,436,300	
ザ・パック	1,200	3,560.00	4,272,000	
北の達人コーポレーション	7,900	182.00	1,437,800	
クラレ	22,500	1,816.00	40,860,000	
旭化成	104,800	998.50	104,642,800	
レゾナック・ホールディングス	14,900	3,450.00	51,405,000	
住友化学	114,700	308.90	35,430,830	
住友精化	700	5,100.00	3,570,000	
日産化学	7,300	4,597.00	33,558,100	
ラサ工業	500	2,993.00	1,496,500	
クレハ	3,300	2,731.00	9,012,300	
多木化学	500	4,150.00	2,075,000	
テイカ	1,100	1,661.00	1,827,100	
石原産業	2,400	1,530.00	3,672,000	
日本曹達	1,800	5,010.00	9,018,000	
東ソー	20,600	2,034.50	41,910,700	
トクヤマ	5,000	2,920.50	14,602,500	
セントラル硝子	1,900	3,525.00	6,697,500	
東亞合成	7,500	1,479.50	11,096,250	
大阪ソーダ	1,100	10,670.00	11,737,000	
関東電化工業	2,600	929.00	2,415,400	
デンカ	5,600	2,087.00	11,687,200	
信越化学工業	139,000	5,943.00	826,077,000	代用有価証券 24,000株
日本カーバイド工業	600	1,928.00	1,156,800	
堺化学工業	1,100	2,731.00	3,004,100	
第一稀元素化学工業	1,400	799.00	1,118,600	
エア・ウォーター	14,600	2,144.50	31,309,700	
日本酸素ホールディングス	15,000	4,543.00	68,145,000	
日本化学工業	500	2,519.00	1,259,500	
東邦アセチレン	1,200	362.00	434,400	
日本パーカライジング	6,900	1,223.00	8,438,700	
高圧ガス工業	2,400	940.00	2,256,000	
四国化成ホールディングス	1,900	2,041.00	3,877,900	

戸田工業	700	2,033.00	1,423,100	
ステラ　ケミファ	800	4,185.00	3,348,000	
保土谷化学工業	400	5,530.00	2,212,000	
日本触媒	9,000	1,537.50	13,837,500	
大日精化工業	1,000	3,185.00	3,185,000	
カネカ	3,800	4,183.00	15,895,400	
三菱瓦斯化学	11,300	3,039.00	34,340,700	
三井化学	12,800	4,337.00	55,513,600	
東京応化工業	7,400	4,475.00	33,115,000	
大阪有機化学工業	1,200	3,545.00	4,254,000	
三菱ケミカルグループ	113,200	804.80	91,103,360	
ＫＨネオケム	2,600	2,215.00	5,759,000	
ダイセル	20,200	1,539.50	31,097,900	
住友ベークライト	4,300	4,696.00	20,192,800	
積水化学工業	31,100	2,211.00	68,762,100	
日本ゼオン	10,600	1,383.50	14,665,100	
アイカ工業	3,900	3,459.00	13,490,100	
ＵＢＥ	7,300	2,684.50	19,596,850	
積水樹脂	2,300	2,320.00	5,336,000	
タキロンシーアイ	3,400	679.00	2,308,600	
旭有機材	1,100	4,815.00	5,296,500	
ニチバン	1,000	1,880.00	1,880,000	
リケンテクノス	3,100	979.00	3,034,900	
大倉工業	800	2,786.00	2,228,800	
積水化成品工業	1,500	451.00	676,500	
群栄化学工業	300	3,175.00	952,500	
タイガースポリマー	500	831.00	415,500	
ダイキョーニシカワ	3,600	670.00	2,412,000	
森六ホールディングス	700	2,731.00	1,911,700	
恵和	1,400	1,668.00	2,335,200	
日本化薬	11,800	1,206.50	14,236,700	
カーリットホールディングス	1,400	1,310.00	1,834,000	
日本精化	1,100	2,534.00	2,787,400	
扶桑化学工業	1,700	3,800.00	6,460,000	
トリケミカル研究所	1,800	3,905.00	7,029,000	
ＡＤＥＫＡ	5,300	3,179.00	16,848,700	
日油	14,100	2,040.00	28,764,000	
ハリマ化成グループ	700	887.00	620,900	
花王	35,000	6,756.00	236,460,000	
第一工業製薬	500	3,690.00	1,845,000	
石原ケミカル	600	2,035.00	1,221,000	
三洋化成工業	900	3,905.00	3,514,500	

大日本塗料	1,900	1,266.00	2,405,400	
日本ペイントホールディングス	82,200	1,043.00	85,734,600	
関西ペイント	13,600	2,563.00	34,856,800	
中国塗料	3,400	1,989.00	6,762,600	
日本特殊塗料	300	1,211.00	363,300	
藤倉化成	1,300	574.00	746,200	
太陽ホールディングス	2,700	3,210.00	8,667,000	
ＤＩＣ	6,000	3,162.00	18,972,000	
サカタインクス	3,100	1,828.00	5,666,800	
ａｒｔｉｅｎｃｅ	3,400	3,360.00	11,424,000	
富士フイルムホールディングス	86,300	3,640.00	314,132,000	
資生堂	32,400	5,003.00	162,097,200	
ライオン	19,700	1,277.50	25,166,750	
高砂香料工業	1,100	3,665.00	4,031,500	
マンダム	3,100	1,209.00	3,747,900	
ミルボン	2,300	3,384.00	7,783,200	
ファンケル	7,000	2,774.50	19,421,500	
コーセー	3,100	11,115.00	34,456,500	
コタ	2,100	1,469.00	3,084,900	
ポーラ・オルビスホールディングス	8,000	1,355.00	10,840,000	
ノエビアホールディングス	1,500	5,400.00	8,100,000	
新日本製薬	1,400	1,670.00	2,338,000	
Ｉ－ｎｅ	1,000	1,733.00	1,733,000	
アクシージア	2,100	1,013.00	2,127,300	
エステー	1,600	1,543.00	2,468,800	
アグロ　カネショウ	500	1,188.00	594,000	
コニシ	4,500	1,212.00	5,454,000	
長谷川香料	2,900	3,085.00	8,946,500	
小林製薬	4,600	5,609.00	25,801,400	
荒川化学工業	1,100	1,130.00	1,243,000	
メック	1,300	4,425.00	5,752,500	
日本高純度化学	300	3,155.00	946,500	
タカラバイオ	3,900	1,016.00	3,962,400	
ＪＣＵ	1,900	3,710.00	7,049,000	
ＯＡＴアグリオ	1,000	1,585.00	1,585,000	
デクセリアルズ	3,900	7,332.00	28,594,800	
アース製薬	1,500	4,765.00	7,147,500	
北興化学工業	1,700	1,498.00	2,546,600	
大成ラミック	400	2,812.00	1,124,800	
クミアイ化学工業	6,700	776.00	5,199,200	
日本農薬	2,400	778.00	1,867,200	
アキレス	700	1,591.00	1,113,700	

有沢製作所	2,500	1,555.00	3,887,500	
日東電工	10,000	12,265.00	122,650,000	
レック	1,700	1,473.00	2,504,100	
三光合成	1,600	674.00	1,078,400	
藤森工業	1,200	4,200.00	5,040,000	
前澤化成工業	900	1,800.00	1,620,000	
未来工業	600	4,230.00	2,538,000	
ＪＳＰ	1,100	2,209.00	2,429,900	
エフピコ	3,100	2,302.00	7,136,200	
天馬	1,100	2,683.00	2,951,300	
信越ポリマー	3,200	1,429.00	4,572,800	
東リ	2,100	389.00	816,900	
ニフコ	4,600	3,697.00	17,006,200	
バルカー	1,400	3,565.00	4,991,000	
ユニ・チャーム	32,300	5,232.00	168,993,600	
協和キリン	18,700	2,717.50	50,817,250	
武田薬品工業	137,300	4,167.00	572,129,100	
アステラス製薬	136,100	1,509.50	205,442,950	
住友ファーマ	10,600	349.00	3,699,400	
塩野義製薬	18,900	6,147.00	116,178,300	
日本新薬	4,100	3,212.00	13,169,200	
中外製薬	48,600	4,942.00	240,181,200	
科研製薬	2,600	3,756.00	9,765,600	
エーザイ	18,900	6,375.00	120,487,500	
ロート製薬	15,000	3,132.00	46,980,000	
小野薬品工業	31,700	2,142.50	67,917,250	
久光製薬	3,500	3,728.00	13,048,000	
持田製薬	1,700	2,972.00	5,052,400	
参天製薬	27,300	1,587.00	43,325,100	
扶桑薬品工業	400	2,277.00	910,800	
ツムラ	4,900	4,063.00	19,908,700	
キッセイ薬品工業	2,500	3,145.00	7,862,500	
生化学工業	2,000	841.00	1,682,000	
栄研化学	2,700	2,084.00	5,626,800	
鳥居薬品	800	3,580.00	2,864,000	
ＪＣＲファーマ	5,100	587.00	2,993,700	
東和薬品	2,500	3,025.00	7,562,500	
富士製薬工業	1,500	1,463.00	2,194,500	
ゼリア新薬工業	2,300	2,058.00	4,733,400	
ネクセラファーマ	6,800	1,532.00	10,417,600	
第一三共	135,200	5,400.00	730,080,000	
杏林製薬	3,300	1,695.00	5,593,500	

大幸薬品	2,100	398.00	835,800	
ダイト	1,200	2,241.00	2,689,200	
大塚ホールディングス	32,300	6,257.00	202,101,100	
ペプチドリーム	7,500	2,257.00	16,927,500	
セルソース	1,000	1,345.00	1,345,000	
あすか製薬ホールディングス	1,800	2,399.00	4,318,200	
サワイグループホールディングス	3,600	5,650.00	20,340,000	
日本コークス工業	12,000	126.00	1,512,000	
ニチレキ	2,000	2,427.00	4,854,000	
ユシロ化学工業	600	1,834.00	1,100,400	
ビーピー・カストロール	600	978.00	586,800	
富士石油	5,600	541.00	3,029,600	
ＭＯＲＥＳＣＯ	300	1,341.00	402,300	
出光興産	80,500	1,059.00	85,249,500	
ＥＮＥＯＳホールディングス	245,600	807.00	198,199,200	
コスモエネルギーホールディングス	4,600	7,779.00	35,783,400	
横浜ゴム	7,800	3,544.00	27,643,200	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	9,000	2,564.50	23,080,500	
ブリヂストン	45,400	6,448.00	292,739,200	
住友ゴム工業	15,200	1,618.50	24,601,200	
藤倉コンポジット	1,400	1,388.00	1,943,200	
オカモト	800	4,845.00	3,876,000	
フコク	600	2,430.00	1,458,000	
ニッタ	1,600	3,845.00	6,152,000	
住友理工	2,500	1,328.00	3,320,000	
三ツ星ベルト	1,800	4,360.00	7,848,000	
バンドー化学	2,200	1,835.00	4,037,000	
日東紡績	1,900	6,530.00	12,407,000	
ＡＧＣ	13,800	5,204.00	71,815,200	
日本板硝子	8,600	418.00	3,594,800	
石塚硝子	300	2,856.00	856,800	
日本山村硝子	700	1,668.00	1,167,600	
日本電気硝子	6,200	3,636.00	22,543,200	
オハラ	400	1,305.00	522,000	
住友大阪セメント	2,500	3,988.00	9,970,000	
太平洋セメント	9,100	3,988.00	36,290,800	
日本ヒューム	1,000	1,265.00	1,265,000	
日本コンクリート工業	2,000	361.00	722,000	
三谷セキサン	700	5,870.00	4,109,000	
アジアパイルホールディングス	2,400	1,002.00	2,404,800	
東海カーボン	14,100	918.00	12,943,800	
日本カーボン	800	5,370.00	4,296,000	

東洋炭素	1,000	6,960.00	6,960,000	
ノリタケカンパニーリミテド	1,700	3,860.00	6,562,000	
ＴＯＴＯ	10,200	3,678.00	37,515,600	
日本碍子	17,900	1,993.50	35,683,650	
日本特殊陶業	12,900	4,610.00	59,469,000	
ＭＡＲＵＷＡ	600	37,800.00	22,680,000	
品川リフラクトリーズ	2,300	1,988.00	4,572,400	
黒崎播磨	1,400	2,827.00	3,957,800	
ヨータイ	1,400	1,800.00	2,520,000	
フジミインコーポレーテッド	4,100	2,858.00	11,717,800	
エーアンドエーマテリアル	500	1,320.00	660,000	
ニチアス	4,000	4,720.00	18,880,000	
ニチハ	1,900	3,375.00	6,412,500	
日本製鉄	71,600	3,304.00	236,566,400	
神戸製鋼所	32,100	1,946.50	62,482,650	
合同製鐵	1,000	5,200.00	5,200,000	
ＪＦＥホールディングス	44,400	2,256.00	100,166,400	
東京製鐵	4,800	1,661.00	7,972,800	
共英製鋼	1,800	2,047.00	3,684,600	
大和工業	3,000	7,609.00	22,827,000	
東京鐵鋼	900	5,260.00	4,734,000	
大阪製鐵	600	2,361.00	1,416,600	
淀川製鋼所	1,800	5,420.00	9,756,000	
中部鋼鈑	1,300	2,945.00	3,828,500	
丸一鋼管	4,900	3,717.00	18,213,300	
モリ工業	400	5,040.00	2,016,000	
大同特殊鋼	10,100	1,461.50	14,761,150	
日本高周波鋼業	1,500	453.00	679,500	
日本冶金工業	1,300	4,540.00	5,902,000	
山陽特殊製鋼	1,600	2,081.00	3,329,600	
愛知製鋼	900	3,615.00	3,253,500	
大平洋金属	1,100	1,257.00	1,382,700	
新日本電工	7,000	282.00	1,974,000	
栗本鐵工所	800	4,655.00	3,724,000	
三菱製鋼	1,000	1,483.00	1,483,000	
日本精線	1,500	1,196.00	1,794,000	
エンビプロ・ホールディングス	1,300	530.00	689,000	
新家工業	200	5,270.00	1,054,000	
大紀アルミニウム工業所	1,800	1,252.00	2,253,600	
日本軽金属ホールディングス	4,500	1,791.00	8,059,500	
三井金属鉱業	4,600	4,783.00	22,001,800	
三菱マテリアル	11,300	2,853.00	32,238,900	

住友金属鉱山	18,500	4,688.00	86,728,000	
ＤＯＷＡホールディングス	3,900	5,398.00	21,052,200	
古河機械金属	2,500	1,826.00	4,565,000	
エス・サイエンス	35,100	23.00	807,300	
大阪チタニウムテクノロジーズ	3,100	2,804.00	8,692,400	
東邦チタニウム	3,000	1,323.00	3,969,000	
ＵＡＣＪ	2,100	3,925.00	8,242,500	
ＣＫサンエツ	500	3,655.00	1,827,500	
古河電気工業	5,200	4,183.00	21,751,600	
住友電気工業	59,700	2,549.00	152,175,300	
フジクラ	18,800	3,273.00	61,532,400	
ＳＷＣＣ	1,900	4,775.00	9,072,500	
タツタ電線	3,200	769.00	2,460,800	
カナレ電気	200	1,544.00	308,800	
平河ヒューテック	1,000	1,451.00	1,451,000	
リョービ	1,600	2,295.00	3,672,000	
アーレスティ	400	690.00	276,000	
ＡＲＥホールディングス	6,100	1,997.00	12,181,700	
稲葉製作所	1,000	1,944.00	1,944,000	
宮地エンジニアリンググループ	1,000	4,705.00	4,705,000	
トーカロ	4,900	1,909.00	9,354,100	
ＳＵＭＣＯ	28,300	2,346.50	66,405,950	
川田テクノロジーズ	1,200	2,645.00	3,174,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	1,300	3,530.00	4,589,000	
信和	100	741.00	74,100	
東洋製罐グループホールディングス	9,000	2,477.50	22,297,500	
ホッカンホールディングス	700	1,716.00	1,201,200	
コロナ	800	929.00	743,200	
横河ブリッジホールディングス	2,700	2,609.00	7,044,300	
三和ホールディングス	16,100	2,851.00	45,901,100	
文化シヤッター	4,500	1,670.00	7,515,000	
三協立山	1,600	787.00	1,259,200	
アルインコ	1,500	1,070.00	1,605,000	
東洋シヤッター	900	943.00	848,700	
ＬＩＸＩＬ	24,800	1,658.50	41,130,800	
ノーリツ	2,300	1,786.00	4,107,800	
長府製作所	1,400	2,150.00	3,010,000	
リンナイ	7,600	3,725.00	28,310,000	
日東精工	2,100	574.00	1,205,400	
三洋工業	300	3,255.00	976,500	
岡部	2,400	755.00	1,812,000	
ジーテクト	1,900	1,873.00	3,558,700	

東プレ	2,700	2,165.00	5,845,500	
高周波熱錬	2,000	1,090.00	2,180,000	
東京製綱	1,300	1,292.00	1,679,600	
サンコール	1,200	450.00	540,000	
パイオラックス	1,800	2,225.00	4,005,000	
エイチワン	1,200	920.00	1,104,000	
日本発條	13,900	1,540.50	21,412,950	
中央発條	900	1,328.00	1,195,200	
立川ブラインド工業	600	1,324.00	794,400	
三益半導体工業	1,500	3,675.00	5,512,500	
日本ドライケミカル	400	2,577.00	1,030,800	
日本製鋼所	4,300	4,297.00	18,477,100	
三浦工業	6,600	3,167.00	20,902,200	
タクマ	5,300	1,615.00	8,559,500	
ツガミ	3,500	1,542.00	5,397,000	
オークマ	1,400	6,624.00	9,273,600	
芝浦機械	1,700	3,610.00	6,137,000	
アマダ	23,600	1,704.50	40,226,200	
アイダエンジニアリング	3,300	859.00	2,834,700	
ＦＵＪＩ	7,300	2,460.00	17,958,000	
牧野フライス製作所	1,700	6,450.00	10,965,000	
オーエスジー	6,900	1,881.50	12,982,350	
旭ダイヤモンド工業	3,300	903.00	2,979,900	
DMG森精機	10,700	4,157.00	44,479,900	
ソディック	3,100	710.00	2,201,000	
ディスコ	7,500	63,880.00	479,100,000	
日東工器	600	2,325.00	1,395,000	
日進工具	1,800	958.00	1,724,400	
冨士ダイス	800	787.00	629,600	
リケンＮＰＲ	1,500	2,666.00	3,999,000	
島精機製作所	2,200	1,671.00	3,676,200	
オプトラン	2,500	2,028.00	5,070,000	
イワキポンプ	1,300	2,498.00	3,247,400	
フリュー	2,000	1,075.00	2,150,000	
ヤマシンフィルタ	2,800	363.00	1,016,400	
日阪製作所	1,300	1,023.00	1,329,900	
やまびこ	2,800	2,170.00	6,076,000	
野村マイクロ・サイエンス	2,200	4,385.00	9,647,000	
平田機工	700	6,570.00	4,599,000	
ＰＥＧＡＳＵＳ	1,300	554.00	720,200	
マルマエ	500	2,103.00	1,051,500	
タツモ	1,000	3,560.00	3,560,000	

ナブテスコ	9,800	2,693.00	26,391,400	
三井海洋開発	2,000	2,642.00	5,284,000	
レオン自動機	2,200	1,552.00	3,414,400	
ＳＭＣ	4,700	76,500.00	359,550,000	
ホソカワミクロン	1,100	3,970.00	4,367,000	
ユニオンツール	600	5,980.00	3,588,000	
瑞光	900	1,055.00	949,500	
オイレス工業	2,100	2,290.00	4,809,000	
日精エー・エス・ビー機械	600	5,320.00	3,192,000	
サトーホールディングス	2,100	2,066.00	4,338,600	
技研製作所	1,300	1,916.00	2,490,800	
日本エアーテック	600	1,181.00	708,600	
日精樹脂工業	900	1,011.00	909,900	
オカダアイヨン	400	2,385.00	954,000	
ワイエイシイホールディングス	500	2,461.00	1,230,500	
小松製作所	73,200	4,379.00	320,542,800	
住友重機械工業	9,200	4,109.00	37,802,800	
日立建機	6,200	3,995.00	24,769,000	
日工	1,900	738.00	1,402,200	
巴工業	600	4,615.00	2,769,000	
井関農機	1,100	1,032.00	1,135,200	
ＴＯＷＡ	1,700	11,220.00	19,074,000	
北川鉄工所	400	1,415.00	566,000	
ローツェ	800	30,650.00	24,520,000	
タカキタ	900	458.00	412,200	
クボタ	81,600	2,202.50	179,724,000	
荏原実業	1,000	3,645.00	3,645,000	
三菱化工機	700	4,165.00	2,915,500	
月島ホールディングス	1,900	1,382.00	2,625,800	
帝国電機製作所	1,300	2,406.00	3,127,800	
新東工業	2,900	1,043.00	3,024,700	
澁谷工業	1,400	3,820.00	5,348,000	
アイチ　コーポレーション	2,200	1,178.00	2,591,600	
小森コーポレーション	3,700	1,288.00	4,765,600	
鶴見製作所	1,200	4,135.00	4,962,000	
酒井重工業	300	5,800.00	1,740,000	
荏原製作所	6,400	11,910.00	76,224,000	
石井鐵工所	200	2,821.00	564,200	
酉島製作所	1,400	3,375.00	4,725,000	
北越工業	1,700	2,450.00	4,165,000	
ダイキン工業	18,700	22,960.00	429,352,000	
オルガノ	1,900	8,390.00	15,941,000	

トーヨーカネツ	500	3,810.00	1,905,000	
栗田工業	8,700	6,700.00	58,290,000	
椿本チエイン	2,100	6,070.00	12,747,000	
木村化工機	1,600	703.00	1,124,800	
アネスト岩田	2,900	1,476.00	4,280,400	
ダイフク	26,300	2,900.00	76,270,000	
サムコ	400	3,785.00	1,514,000	
加藤製作所	100	1,260.00	126,000	
タダノ	8,700	1,087.00	9,456,900	
フジテック	3,800	4,167.00	15,834,600	
ＣＫＤ	4,300	3,230.00	13,889,000	
平和	4,600	2,026.00	9,319,600	
理想科学工業	1,300	3,190.00	4,147,000	
ＳＡＮＫＹＯ	15,300	1,668.00	25,520,400	
日本金銭機械	2,300	1,328.00	3,054,400	
マースグループホールディングス	1,000	3,740.00	3,740,000	
フクシマガリレイ	1,100	6,390.00	7,029,000	
オーイズミ	200	357.00	71,400	
ダイコク電機	1,000	4,005.00	4,005,000	
竹内製作所	2,900	5,620.00	16,298,000	
アマノ	4,500	3,990.00	17,955,000	
ＪＵＫＩ	1,900	501.00	951,900	
ジャノメ	1,100	674.00	741,400	
マックス	2,200	3,850.00	8,470,000	
グローリー	3,700	2,711.50	10,032,550	
新晃工業	1,700	3,775.00	6,417,500	
大和冷機工業	2,400	1,487.00	3,568,800	
セガサミーホールディングス	14,100	2,390.00	33,699,000	
ＴＰＲ	1,900	2,442.00	4,639,800	
ツバキ・ナカシマ	2,500	758.00	1,895,000	
ホシザキ	9,200	5,064.00	46,588,800	
大豊工業	1,000	770.00	770,000	
日本精工	28,600	749.20	21,427,120	
ＮＴＮ	33,700	294.30	9,917,910	
ジェイテクト	13,900	1,055.00	14,664,500	
不二越	1,000	3,425.00	3,425,000	
日本トムソン	3,700	595.00	2,201,500	
ＴＨＫ	9,000	2,845.00	25,605,000	
ユーシン精機	1,000	714.00	714,000	
前澤給装工業	1,000	1,323.00	1,323,000	
イーグル工業	1,600	1,879.00	3,006,400	
前澤工業	600	1,435.00	861,000	

日本ピラー工業	1,500	5,270.00	7,905,000	
キッツ	5,600	1,115.00	6,244,000	
マキタ	17,800	4,413.00	78,551,400	
三井Ｅ＆Ｓ	8,100	1,373.00	11,121,300	
日立造船	14,000	1,028.00	14,392,000	
三菱重工業	273,200	1,488.00	406,521,600	
ＩＨＩ	11,600	3,758.00	43,592,800	
スター精密	3,100	2,126.00	6,590,600	
日清紡ホールディングス	11,800	1,092.00	12,885,600	
イビデン	8,200	6,630.00	54,366,000	
コニカミノルタ	34,700	443.30	15,382,510	
ブラザー工業	20,900	2,777.50	58,049,750	
ミネベアミツミ	27,200	3,179.00	86,468,800	
日立製作所	75,100	16,725.00	1,256,047,500	代用有価証券 12,000株
三菱電機	173,900	2,530.00	439,967,000	
富士電機	9,500	8,957.00	85,091,500	
安川電機	17,000	5,850.00	99,450,000	
シンフォニアテクノロジー	1,800	3,405.00	6,129,000	
明電舎	2,900	4,065.00	11,788,500	
山洋電気	700	6,780.00	4,746,000	
デンヨー	1,200	2,721.00	3,265,200	
ＰＨＣホールディングス	2,800	1,143.00	3,200,400	
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	8,200	5,000.00	41,000,000	
ソシオネクスト	11,400	4,030.00	45,942,000	
東芝テック	1,900	3,170.00	6,023,000	
芝浦メカトロニクス	1,000	7,820.00	7,820,000	
マブチモーター	7,700	2,410.50	18,560,850	
ニデック	34,500	7,255.00	250,297,500	
トレックス・セミコンダクター	600	1,850.00	1,110,000	
東光高岳	800	1,996.00	1,596,800	
ダブル・スコープ	3,600	534.00	1,922,400	
ダイヘン	1,500	8,150.00	12,225,000	
ヤーマン	3,200	909.00	2,908,800	
ＪＶＣケンウッド	12,400	888.00	11,011,200	
ミマキエンジニアリング	2,000	2,138.00	4,276,000	
Ｉ－ＰＥＸ	800	1,972.00	1,577,600	
大崎電気工業	2,900	654.00	1,896,600	
オムロン	11,900	5,126.00	60,999,400	
日東工業	2,100	3,340.00	7,014,000	
ＩＤＥＣ	2,300	2,892.00	6,651,600	
正興電機製作所	300	1,558.00	467,400	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	6,100	3,231.00	19,709,100	

サクサホールディングス	200	2,604.00	520,800	
メルコホールディングス	500	3,485.00	1,742,500	
テクノメディカ	800	1,782.00	1,425,600	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	500	695.00	347,500	
日本電気	20,500	12,345.00	253,072,500	
富士通	143,800	2,376.50	341,740,700	
沖電気工業	7,100	984.00	6,986,400	
電気興業	500	2,075.00	1,037,500	
サンケン電気	1,400	6,529.00	9,140,600	
アイホン	900	2,991.00	2,691,900	
ルネサスエレクトロニクス	97,400	3,143.00	306,128,200	
セイコーエプソン	20,100	2,401.00	48,260,100	
ワコム	11,200	711.00	7,963,200	
アルバック	3,400	10,555.00	35,887,000	
アクセル	1,100	1,542.00	1,696,200	
ＥＩＺＯ	1,100	4,715.00	5,186,500	
日本信号	3,500	994.00	3,479,000	
京三製作所	2,700	662.00	1,787,400	
能美防災	2,100	2,243.00	4,710,300	
ホーチキ	1,400	2,223.00	3,112,200	
星和電機	200	555.00	111,000	
エレコム	4,000	1,562.00	6,248,000	
パナソニック　ホールディングス	184,600	1,259.00	232,411,400	
シャープ	26,400	983.10	25,953,840	
アンリツ	11,100	1,143.50	12,692,850	
富士通ゼネラル	4,300	2,098.50	9,023,550	
ソニーグループ	108,400	12,695.00	1,376,138,000	
ＴＤＫ	24,700	8,863.00	218,916,100	
帝国通信工業	600	1,965.00	1,179,000	
タムラ製作所	5,900	714.00	4,212,600	
アルプスアルパイン	13,900	1,527.50	21,232,250	
日本電波工業	2,000	1,108.00	2,216,000	
鈴木	600	1,497.00	898,200	
メイコー	1,600	7,440.00	11,904,000	
日本トリム	600	3,380.00	2,028,000	
ローランド　ディー．ジー．	400	5,340.00	2,136,000	
フォスター電機	1,000	1,784.00	1,784,000	
ＳＭＫ	300	2,385.00	715,500	
ヨコオ	1,100	2,106.00	2,316,600	
ホシデン	3,500	2,025.00	7,087,500	
ヒロセ電機	2,300	17,910.00	41,193,000	
日本航空電子工業	3,700	2,475.00	9,157,500	

ＴＯＡ	1,500	1,080.00	1,620,000	
マクセル	3,100	1,859.00	5,762,900	
古野電気	2,300	1,999.00	4,597,700	
スミダコーポレーション	2,100	1,161.00	2,438,100	
アイコム	600	3,015.00	1,809,000	
リオン	700	2,799.00	1,959,300	
横河電機	17,100	3,780.00	64,638,000	
新電元工業	500	2,970.00	1,485,000	
アズビル	10,600	4,127.00	43,746,200	
東亜ディーケーケー	500	852.00	426,000	
日本光電工業	6,700	4,678.00	31,342,600	
チノー	900	2,460.00	2,214,000	
日本電子材料	900	3,545.00	3,190,500	
堀場製作所	3,000	11,750.00	35,250,000	
アドバンテスト	44,300	5,337.00	236,429,100	
エスペック	1,300	3,135.00	4,075,500	
キーエンス	15,500	67,790.00	1,050,745,000	
日置電機	800	6,750.00	5,400,000	
シスメックス	40,100	2,529.00	101,412,900	
日本マイクロニクス	2,800	5,890.00	16,492,000	
メガチップス	1,200	4,235.00	5,082,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	1,000	4,200.00	4,200,000	
原田工業	1,100	576.00	633,600	
コーセル	2,000	1,332.00	2,664,000	
イリソ電子工業	1,400	2,944.00	4,121,600	
オプテックスグループ	3,100	1,558.00	4,829,800	
千代田インテグレ	700	3,230.00	2,261,000	
レーザーテック	7,100	36,170.00	256,807,000	
スタンレー電気	9,900	2,789.50	27,616,050	
ウシオ電機	6,900	2,042.50	14,093,250	
岡谷電機産業	400	245.00	98,000	
日本セラミック	1,300	2,532.00	3,291,600	
遠藤照明	700	1,502.00	1,051,400	
古河電池	1,300	1,316.00	1,710,800	
山一電機	1,400	3,465.00	4,851,000	
図研	1,300	3,855.00	5,011,500	
日本電子	3,900	6,507.00	25,377,300	
カシオ計算機	11,300	1,171.00	13,232,300	
ファナック	75,500	4,265.00	322,007,500	
日本シイエムケイ	2,900	604.00	1,751,600	
エンプラス	400	8,020.00	3,208,000	
大真空	1,800	692.00	1,245,600	

ローム	28,600	2,123.50	60,732,100	
浜松ホトニクス	12,400	4,444.00	55,105,600	
三井ハイテック	1,400	6,278.00	8,789,200	
新光電気工業	5,500	5,689.00	31,289,500	
京セラ	96,100	1,811.50	174,085,150	
太陽誘電	7,500	4,057.00	30,427,500	
村田製作所	140,800	3,238.00	455,910,400	
双葉電子工業	2,300	600.00	1,380,000	
ニチコン	4,000	1,156.00	4,624,000	
日本ケミコン	1,300	1,579.00	2,052,700	
ＫＯＡ	2,300	1,464.00	3,367,200	
市光工業	4,200	541.00	2,272,200	
小糸製作所	16,000	2,146.50	34,344,000	
ミツバ	3,300	1,086.00	3,583,800	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	5,300	14,725.00	78,042,500	
キヤノン電子	1,600	2,279.00	3,646,400	
キヤノン	77,200	4,359.00	336,514,800	
リコー	38,800	1,358.00	52,690,400	
象印マホービン	3,900	1,466.00	5,717,400	
東京エレクトロン	32,700	34,080.00	1,114,416,000	
イノテック	900	1,711.00	1,539,900	
トヨタ紡織	6,600	2,073.00	13,681,800	
芦森工業	200	2,426.00	485,200	
ユニプレス	2,600	1,354.00	3,520,400	
豊田自動織機	13,200	12,940.00	170,808,000	
モリタホールディングス	2,700	1,843.00	4,976,100	
三櫻工業	2,100	980.00	2,058,000	
デンソー	127,700	2,341.00	298,945,700	
東海理化電機製作所	4,400	2,066.00	9,090,400	
川崎重工業	12,600	5,641.00	71,076,600	
名村造船所	4,700	2,103.00	9,884,100	
日本車輌製造	700	2,350.00	1,645,000	
三菱ロジスネクスト	3,000	1,367.00	4,101,000	
日産自動車	203,700	519.80	105,883,260	
いすゞ自動車	43,500	1,979.00	86,086,500	
トヨタ自動車	849,600	3,036.00	2,579,385,600	代用有価証券 45,000株
日野自動車	23,000	415.90	9,565,700	
三菱自動車工業	61,000	411.60	25,107,600	
レシップホールディングス	1,400	656.00	918,400	
武蔵精密工業	3,600	1,863.00	6,706,800	
日産車体	1,300	990.00	1,287,000	
新明和工業	4,100	1,371.00	5,621,100	

極東開発工業	2,400	2,435.00	5,844,000	
トピー工業	1,200	2,378.00	2,853,600	
ティラド	300	3,465.00	1,039,500	
タチエス	2,900	1,894.00	5,492,600	
ＮＯＫ	6,100	2,100.00	12,810,000	
フタバ産業	4,900	841.00	4,120,900	
カヤバ	1,600	5,310.00	8,496,000	
大同メタル工業	2,500	597.00	1,492,500	
プレス工業	6,300	626.00	3,943,800	
ミクニ	100	397.00	39,700	
太平洋工業	3,500	1,486.00	5,201,000	
アイシン	11,900	5,397.00	64,224,300	
マツダ	51,200	1,441.00	73,779,200	
本田技研工業	366,700	1,642.50	602,304,750	
スズキ	113,700	1,787.50	203,238,750	
ＳＵＢＡＲＵ	48,000	3,262.00	156,576,000	
安永	400	595.00	238,000	
ヤマハ発動機	66,900	1,470.00	98,343,000	
エクセディ	2,400	2,865.00	6,876,000	
豊田合成	4,500	2,702.00	12,159,000	
愛三工業	2,700	1,309.00	3,534,300	
ヨロズ	1,300	1,116.00	1,450,800	
エフ・シー・シー	2,800	2,266.00	6,344,800	
シマノ	6,200	25,155.00	155,961,000	
テイ・エス　テック	5,500	1,849.50	10,172,250	
ジャムコ	1,500	1,425.00	2,137,500	
テルモ	86,200	2,574.50	221,921,900	
日機装	3,500	1,151.00	4,028,500	
日本エム・ディ・エム	900	627.00	564,300	
島津製作所	20,500	3,917.00	80,298,500	
ＪＭＳ	1,100	531.00	584,100	
長野計器	1,300	3,065.00	3,984,500	
ブイ・テクノロジー	600	3,120.00	1,872,000	
東京計器	1,100	3,395.00	3,734,500	
愛知時計電機	900	2,249.00	2,024,100	
インターアクション	800	1,589.00	1,271,200	
東京精密	3,200	11,825.00	37,840,000	
マニー	6,400	1,881.00	12,038,400	
ニコン	22,300	1,519.50	33,884,850	
トプコン	7,500	1,705.00	12,787,500	
オリンパス	88,600	2,600.00	230,360,000	
理研計器	2,200	3,805.00	8,371,000	

タムロン	1,000	8,460.00	8,460,000	
ＨＯＹＡ	30,500	18,080.00	551,440,000	
ノーリツ鋼機	1,300	4,480.00	5,824,000	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	2,500	2,773.00	6,932,500	
朝日インテック	18,800	2,185.00	41,078,000	
シチズン時計	14,200	1,004.00	14,256,800	
大研医器	1,800	532.00	957,600	
メニコン	5,100	1,266.00	6,456,600	
シンシア	1,100	453.00	498,300	
松風	700	4,235.00	2,964,500	
セイコーグループ	2,100	4,855.00	10,195,500	
ニプロ	12,700	1,211.50	15,386,050	
スノーピーク	500	1,245.00	622,500	
パラマウントベッドホールディングス	3,200	2,733.00	8,745,600	
トランザクション	1,300	1,935.00	2,515,500	
粧美堂	500	555.00	277,500	
ニホンフラッシュ	1,100	901.00	991,100	
前田工繊	1,400	3,160.00	4,424,000	
アートネイチャー	2,100	814.00	1,709,400	
フルヤ金属	500	13,060.00	6,530,000	
バンダイナムコホールディングス	42,400	2,989.00	126,733,600	
アイフィスジャパン	500	594.00	297,000	
ＳＨＯＥＩ	4,500	2,024.00	9,108,000	
フランスベッドホールディングス	1,900	1,168.00	2,219,200	
パイロットコーポレーション	2,200	4,330.00	9,526,000	
萩原工業	800	1,502.00	1,201,600	
フジシールインターナショナル	3,300	2,423.00	7,995,900	
タカラトミー	7,100	3,079.00	21,860,900	
広済堂ホールディングス	5,200	590.00	3,068,000	
プロネクサス	1,600	1,253.00	2,004,800	
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	19,000	4,416.00	83,904,000	
大日本印刷	16,000	5,246.00	83,936,000	
共同印刷	300	3,555.00	1,066,500	
ＮＩＳＳＨＡ	2,500	2,050.00	5,125,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	1,100	2,961.00	3,257,100	
アシックス	13,200	9,071.00	119,737,200	
ツツミ	300	2,104.00	631,200	
ローランド	1,200	4,085.00	4,902,000	
小松ウオール工業	600	3,165.00	1,899,000	
ヤマハ	9,700	3,682.00	35,715,400	
河合楽器製作所	500	3,235.00	1,617,500	
クリナップ	1,000	715.00	715,000	

ピジョン	10,000	1,507.00	15,070,000	
キングジム	900	896.00	806,400	
リンテック	3,000	3,260.00	9,780,000	
イトーキ	2,800	1,679.00	4,701,200	
任天堂	97,700	8,411.00	821,754,700	代用有価証券 18,000株
三菱鉛筆	2,300	2,504.00	5,759,200	
タカラスタンダード	3,100	1,677.00	5,198,700	
コクヨ	6,300	2,620.00	16,506,000	
ナカバヤシ	1,300	536.00	696,800	
グローブライド	1,600	2,136.00	3,417,600	
オカムラ	4,800	2,155.00	10,344,000	
美津濃	1,500	8,180.00	12,270,000	
東京電力ホールディングス	139,500	855.00	119,272,500	
中部電力	57,000	1,910.00	108,870,000	
関西電力	59,800	2,752.50	164,599,500	
中国電力	26,900	1,066.50	28,688,850	
北陸電力	16,000	1,058.50	16,936,000	
東北電力	40,800	1,460.00	59,568,000	
四国電力	14,400	1,426.00	20,534,400	
九州電力	35,700	1,723.50	61,528,950	
北海道電力	15,000	1,415.50	21,232,500	
沖縄電力	3,700	1,101.00	4,073,700	
電源開発	12,700	2,505.00	31,813,500	
イーレックス	2,200	675.00	1,485,000	
レノバ	3,900	1,008.00	3,931,200	
東京瓦斯	30,100	3,548.00	106,794,800	
大阪瓦斯	30,800	3,515.00	108,262,000	
東邦瓦斯	6,700	4,035.00	27,034,500	
北海道瓦斯	1,000	3,415.00	3,415,000	
広島ガス	3,000	380.00	1,140,000	
西部ガスホールディングス	1,800	1,981.00	3,565,800	
静岡ガス	3,500	935.00	3,272,500	
メタウォーター	1,900	1,902.00	3,613,800	
ＳＢＳホールディングス	1,500	2,679.00	4,018,500	
東武鉄道	17,000	2,612.00	44,404,000	
相鉄ホールディングス	5,600	2,331.00	13,053,600	
東急	43,400	1,753.50	76,101,900	
京浜急行電鉄	19,100	1,130.50	21,592,550	
小田急電鉄	25,600	1,508.00	38,604,800	
京王電鉄	7,400	3,541.00	26,203,400	
京成電鉄	10,000	5,342.00	53,420,000	
富士急行	2,000	2,770.00	5,540,000	

東日本旅客鉄道	85,300	2,505.50	213,719,150	
西日本旅客鉄道	36,700	2,890.00	106,063,000	
東海旅客鉄道	59,600	3,289.00	196,024,400	
西武ホールディングス	18,700	2,188.50	40,924,950	
鴻池運輸	2,700	2,365.00	6,385,500	
西日本鉄道	4,200	2,511.50	10,548,300	
ハマキョウレックス	1,300	4,190.00	5,447,000	
サカイ引越センター	1,800	2,449.00	4,408,200	
近鉄グループホールディングス	15,500	3,257.00	50,483,500	
阪急阪神ホールディングス	20,600	3,952.00	81,411,200	
南海電気鉄道	6,900	2,533.50	17,481,150	
京阪ホールディングス	8,500	2,776.00	23,596,000	
神戸電鉄	300	2,724.00	817,200	
名古屋鉄道	16,000	1,683.50	26,936,000	
山陽電気鉄道	1,100	2,046.00	2,250,600	
アルプス物流	1,200	5,710.00	6,852,000	
ヤマトホールディングス	18,800	1,669.00	31,377,200	
山九	3,700	5,378.00	19,898,600	
丸全昭和運輸	1,000	5,080.00	5,080,000	
センコーグループホールディングス	8,300	1,108.00	9,196,400	
トナミホールディングス	300	5,490.00	1,647,000	
ニッコンホールディングス	4,800	2,988.00	14,342,400	
福山通運	1,600	4,060.00	6,496,000	
セイノーホールディングス	8,700	2,062.50	17,943,750	
神奈川中央交通	400	3,025.00	1,210,000	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	4,100	1,173.00	4,809,300	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	1,500	5,730.00	8,595,000	
九州旅客鉄道	10,900	3,326.00	36,253,400	
ＳＧホールディングス	26,000	1,461.50	37,999,000	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	5,200	7,275.00	37,830,000	
日本郵船	40,000	4,677.00	187,080,000	
商船三井	33,600	4,850.00	162,960,000	
川崎汽船	37,300	2,270.00	84,671,000	
ＮＳユナイテッド海運	900	4,780.00	4,302,000	
飯野海運	5,900	1,269.00	7,487,100	
乾汽船	1,400	1,105.00	1,547,000	
日本航空	37,900	2,462.00	93,309,800	
ＡＮＡホールディングス	42,000	2,888.50	121,317,000	
パスコ	200	1,757.00	351,400	
トランコム	400	6,330.00	2,532,000	
日新	1,200	4,505.00	5,406,000	
三菱倉庫	3,700	5,163.00	19,103,100	

三井倉庫ホールディングス	1,500	4,485.00	6,727,500	
住友倉庫	4,100	2,534.00	10,389,400	
澁澤倉庫	500	3,020.00	1,510,000	
日本トランスシティ	2,400	959.00	2,301,600	
中央倉庫	900	1,210.00	1,089,000	
川西倉庫	300	1,190.00	357,000	
安田倉庫	800	1,623.00	1,298,400	
ファイズホールディングス	400	1,047.00	418,800	
上組	7,100	3,283.00	23,309,300	
キムラユニティー	600	1,705.00	1,023,000	
キユーソー流通システム	500	1,644.00	822,000	
エーアイテイー	1,300	1,815.00	2,359,500	
内外トランスライン	800	2,702.00	2,161,600	
日本コンセプト	900	1,901.00	1,710,900	
ＮＥＣネッツエスアイ	6,000	2,309.00	13,854,000	
クロスキャット	1,300	1,366.00	1,775,800	
システナ	24,300	294.00	7,144,200	
デジタルアーツ	1,000	3,845.00	3,845,000	
日鉄ソリューションズ	2,600	5,130.00	13,338,000	
キューブシステム	1,100	1,127.00	1,239,700	
コア	900	1,873.00	1,685,700	
手間いらず	100	3,000.00	300,000	
ラクーンホールディングス	600	560.00	336,000	
ソリトンシステムズ	1,100	1,139.00	1,252,900	
ソフトクリエイトホールディングス	1,400	2,002.00	2,802,800	
ＴＩＳ	16,300	2,840.50	46,300,150	
グリー	5,500	530.00	2,915,000	
コーエーテクモホールディングス	9,800	1,368.00	13,406,400	
三菱総合研究所	800	4,740.00	3,792,000	
電算	200	1,482.00	296,400	
ＡＧＳ	500	996.00	498,000	
ファインデックス	1,700	1,060.00	1,802,000	
ＫＬａｂ	1,300	228.00	296,400	
ポールトゥウィンホールディングス	1,300	494.00	642,200	
ネクソン	34,000	2,906.00	98,804,000	
アイスタイル	4,600	504.00	2,318,400	
エムアップホールディングス	2,200	1,340.00	2,948,000	
エニグモ	1,800	320.00	576,000	
テクノスジャパン	1,200	636.00	763,200	
コロプラ	4,700	621.00	2,918,700	
ブロードリーフ	6,400	536.00	3,430,400	
クロス・マーケティンググループ	300	611.00	183,300	

デジタルハーツホールディングス	400	1,065.00	426,000	
メディアドゥ	600	1,459.00	875,400	
じげん	5,000	617.00	3,085,000	
フィックスターズ	1,800	1,895.00	3,411,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	300	1,591.00	477,300	
オプティム	2,100	640.00	1,344,000	
セレス	300	1,952.00	585,600	
ＳＨＩＦＴ	1,000	15,245.00	15,245,000	
ティーガイア	1,700	1,969.00	3,347,300	
セック	300	4,480.00	1,344,000	
テクマトリックス	2,900	1,914.00	5,550,600	
プロシップ	1,000	1,399.00	1,399,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,100	2,764.00	11,332,400	
GMOペイメントゲートウェイ	3,500	8,026.00	28,091,000	
システムリサーチ	1,300	1,537.00	1,998,100	
インターネットイニシアティブ	7,400	2,174.50	16,091,300	
さくらインターネット	1,700	4,950.00	8,415,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	400	3,010.00	1,204,000	
ＳＲＡホールディングス	700	3,995.00	2,796,500	
システムインテグレータ	700	371.00	259,700	
朝日ネット	2,100	642.00	1,348,200	
ｅＢＡＳＥ	2,900	703.00	2,038,700	
アバントグループ	2,200	1,337.00	2,941,400	
アドソル日進	900	1,801.00	1,620,900	
フリービット	1,000	1,187.00	1,187,000	
コムチュア	2,400	1,788.00	4,291,200	
アステリア	600	532.00	319,200	
アイル	1,000	2,441.00	2,441,000	
マークラインズ	900	2,961.00	2,664,900	
メディカル・データ・ビジョン	2,600	572.00	1,487,200	
ｇｕｍｉ	1,500	322.00	483,000	
テラスカイ	400	1,950.00	780,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,100	1,836.00	2,019,600	
ＰＣＩホールディングス	300	967.00	290,100	
ネオジャパン	900	1,646.00	1,481,400	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	600	1,839.00	1,103,400	
ラクス	7,400	1,894.50	14,019,300	
ランドコンピュータ	500	805.00	402,500	
ダブルスタンダード	800	1,681.00	1,344,800	
アカツキ	500	2,302.00	1,151,000	
ベネフィットジャパン	200	1,203.00	240,600	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	800	1,261.00	1,008,800	

カナミックネットワーク	2,700	579.00	1,563,300	
ノムラシステムコーポレーション	1,200	131.00	157,200	
チェンジホールディングス	3,600	1,157.00	4,165,200	
シンクロ・フード	700	507.00	354,900	
オークネット	800	2,580.00	2,064,000	
エイトレッド	200	1,565.00	313,000	
マクロミル	3,500	876.00	3,066,000	
ビーグリー	100	1,066.00	106,600	
オロ	800	2,462.00	1,969,600	
ユーザーローカル	900	1,969.00	1,772,100	
マネーフォワード	3,400	5,128.00	17,435,200	
Ｓｕｎ　Ａｓｔｅｒｉｓｋ	1,600	866.00	1,385,600	
プラスアルファ・コンサルティング	2,100	1,788.00	3,754,800	
電算システムホールディングス	800	2,649.00	2,119,200	
Ａｐｐｉｅｒ　Ｇｒｏｕｐ	4,800	1,268.00	6,086,400	
ビジョナル	1,800	7,150.00	12,870,000	
ソルクシーズ	700	322.00	225,400	
プロトコーポレーション	1,900	1,400.00	2,660,000	
ハイマックス	800	1,342.00	1,073,600	
野村総合研究所	33,500	4,221.00	141,403,500	
ＣＥホールディングス	400	580.00	232,000	
日本システム技術	1,500	1,571.00	2,356,500	
インテージホールディングス	1,500	1,411.00	2,116,500	
東邦システムサイエンス	1,000	1,605.00	1,605,000	
ソースネクスト	3,400	194.00	659,600	
インフォコム	2,100	5,740.00	12,054,000	
シンプレクス・ホールディングス	2,400	2,791.00	6,698,400	
ＨＥＲＯＺ	400	1,222.00	488,800	
ラクスル	4,000	960.00	3,840,000	
メルカリ	7,600	2,094.00	15,914,400	
ＩＰＳ	600	2,187.00	1,312,200	
システムサポート	800	1,713.00	1,370,400	
イーソル	700	910.00	637,000	
東海ソフト	200	1,290.00	258,000	
ウイングアーク１ｓｔ	1,700	2,721.00	4,625,700	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	881.00	352,400	
サーバーワークス	100	3,215.00	321,500	
東名	100	2,388.00	238,800	
トビラシステムズ	300	785.00	235,500	
Ｓａｎｓａｎ	4,800	1,683.00	8,078,400	
Ｌｉｎｋ－Ｕグループ	200	596.00	119,200	
ギフティ	800	1,109.00	887,200	

メドレー	2,100	3,650.00	7,665,000	
ベース	700	2,764.00	1,934,800	
ＪＭＤＣ	2,500	3,374.00	8,435,000	
フォーカスシステムズ	1,000	1,141.00	1,141,000	
クレスコ	1,400	2,330.00	3,262,000	
フジ・メディア・ホールディングス	14,800	1,809.00	26,773,200	
オービック	5,200	20,355.00	105,846,000	
ジャストシステム	2,300	2,900.00	6,670,000	
ＴＤＣソフト	3,200	1,040.00	3,328,000	
ＬＩＮＥヤフー	220,300	364.60	80,321,380	
トレンドマイクロ	7,300	6,567.00	47,939,100	
ＩＤホールディングス	1,300	1,418.00	1,843,400	
日本オラクル	3,000	11,750.00	35,250,000	
アルファシステムズ	400	3,000.00	1,200,000	
フューチャー	3,400	1,497.00	5,089,800	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,000	1,932.00	1,932,000	
ＳＢテクノロジー	900	2,943.00	2,648,700	
オービックビジネスコンサルタント	2,200	6,221.00	13,686,200	
アイティフォー	2,200	1,400.00	3,080,000	
東計電算	500	3,715.00	1,857,500	
エックスネット	100	1,488.00	148,800	
大塚商会	15,300	2,885.50	44,148,150	
サイボウズ	2,400	1,828.00	4,387,200	
電通総研	1,900	5,330.00	10,127,000	
ＡＣＣＥＳＳ	1,100	1,394.00	1,533,400	
デジタルガレージ	2,300	2,181.00	5,016,300	
ＥＭシステムズ	3,000	627.00	1,881,000	
ウェザーニューズ	600	4,480.00	2,688,000	
ＣＩＪ	3,400	452.00	1,536,800	
ビジネスエンジニアリング	400	3,480.00	1,392,000	
ＷＯＷＯＷ	700	1,075.00	752,500	
スカラ	600	715.00	429,000	
インテリジェント　ウェイブ	500	1,022.00	511,000	
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	2,300	2,812.00	6,467,600	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	1,300	538.00	699,400	
ネットワンシステムズ	6,000	2,624.00	15,744,000	
アルゴグラフィックス	1,500	4,525.00	6,787,500	
マーベラス	1,500	631.00	946,500	
エイベックス	2,400	1,200.00	2,880,000	
ＢＩＰＲＯＧＹ	5,100	4,175.00	21,292,500	
都築電気	1,000	2,303.00	2,303,000	
ＴＢＳホールディングス	7,700	3,954.00	30,445,800	

日本テレビホールディングス	13,600	2,215.00	30,124,000	
朝日放送グループホールディングス	500	660.00	330,000	
テレビ朝日ホールディングス	3,500	2,069.00	7,241,500	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	11,900	858.00	10,210,200	
テレビ東京ホールディングス	1,100	3,375.00	3,712,500	
ビジョン	2,600	1,170.00	3,042,000	
Ｕ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	1,800	4,700.00	8,460,000	
日本通信	17,200	187.00	3,216,400	
クロップス	100	1,141.00	114,100	
日本電信電話	4,614,400	144.90	668,626,560	代用有価証券 700,000株
ＫＤＤＩ	119,900	4,175.00	500,582,500	
ソフトバンク	247,700	1,945.50	481,900,350	
光通信	1,600	27,850.00	44,560,000	
エムティーアイ	1,800	824.00	1,483,200	
GMOインターネットグループ	5,700	2,386.00	13,600,200	
ファイバーゲート	1,300	1,047.00	1,361,100	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	8,100	2,851.50	23,097,150	
学研ホールディングス	2,500	980.00	2,450,000	
ゼンリン	1,800	906.00	1,630,800	
アイネット	800	2,116.00	1,692,800	
松竹	700	9,368.00	6,557,600	
東宝	8,600	4,589.00	39,465,400	
東映	2,500	3,670.00	9,175,000	
ＮＴＴデータグループ	40,500	2,211.00	89,545,500	
ピー・シー・エー	800	2,246.00	1,796,800	
ビジネスブレイン太田昭和	800	2,149.00	1,719,200	
ＤＴＳ	3,300	4,135.00	13,645,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,000	4,511.00	31,577,000	
シーイーシー	1,800	2,135.00	3,843,000	
カプコン	27,700	2,857.50	79,152,750	
アイ・エス・ビー	1,000	1,385.00	1,385,000	
ジャステック	1,100	1,934.00	2,127,400	
ＳＣＳＫ	10,800	3,068.00	33,134,400	
ＮＳＷ	800	3,135.00	2,508,000	
アイネス	800	1,673.00	1,338,400	
ＴＫＣ	2,800	3,245.00	9,086,000	
富士ソフト	3,100	6,870.00	21,297,000	
ＮＳＤ	5,500	3,045.00	16,747,500	
コナミグループ	5,800	10,770.00	62,466,000	
福井コンピュータホールディングス	1,100	2,364.00	2,600,400	
ＪＢＣＣホールディングス	1,100	3,235.00	3,558,500	
ミロク情報サービス	1,500	1,837.00	2,755,500	

ソフトバンクグループ	76,500	10,120.00	774,180,000	
リョーサン菱洋ホールディングス	3,000	3,070.00	9,210,000	
高千穂交易	500	3,800.00	1,900,000	
オルバヘルスケアホールディングス	300	2,135.00	640,500	
伊藤忠食品	300	7,240.00	2,172,000	
エレマテック	1,400	1,984.00	2,777,600	
あらた	2,600	3,375.00	8,775,000	
トーメンデバイス	200	7,680.00	1,536,000	
東京エレクトロン　デバイス	1,700	4,140.00	7,038,000	
円谷フィールズホールディングス	3,000	1,720.00	5,160,000	
双日	18,200	3,838.00	69,851,600	
アルフレッサ　ホールディングス	16,400	2,120.00	34,768,000	
横浜冷凍	3,800	1,016.00	3,860,800	
神栄	300	1,827.00	548,100	
ラサ商事	800	1,741.00	1,392,800	
アルコニックス	2,000	1,475.00	2,950,000	
神戸物産	12,600	3,459.00	43,583,400	
あい　ホールディングス	2,700	2,402.00	6,485,400	
ダイワボウホールディングス	7,200	2,679.00	19,288,800	
マクニカホールディングス	3,900	6,422.00	25,045,800	
ラクト・ジャパン	800	2,926.00	2,340,800	
グリムス	1,000	2,515.00	2,515,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,400	1,331.00	3,194,400	
八洲電機	1,500	1,593.00	2,389,500	
メディアスホールディングス	800	967.00	773,600	
レスター	1,300	3,130.00	4,069,000	
ジオリーブグループ	400	1,190.00	476,000	
大光	800	609.00	487,200	
ＯＣＨＩホールディングス	300	1,441.00	432,300	
ＴＯＫＡＩホールディングス	9,200	956.00	8,795,200	
三洋貿易	1,900	1,524.00	2,895,600	
ビューティガレージ	800	1,592.00	1,273,600	
ウイン・パートナーズ	1,100	1,182.00	1,300,200	
シップヘルスケアホールディングス	5,900	2,281.50	13,460,850	
明治電機工業	600	1,719.00	1,031,400	
デリカフーズホールディングス	600	569.00	341,400	
スターティアホールディングス	500	2,103.00	1,051,500	
コメダホールディングス	4,100	2,718.00	11,143,800	
アセンテック	1,600	559.00	894,400	
フルサト・マルカホールディングス	1,400	2,124.00	2,973,600	
ヤマエグループホールディングス	1,500	2,394.00	3,591,000	
小野建	1,600	1,583.00	2,532,800	

南陽	200	1,096.00	219,200	
佐鳥電機	800	2,022.00	1,617,600	
エコートレーディング	200	1,313.00	262,600	
伯東	900	5,120.00	4,608,000	
コンドーテック	1,500	1,363.00	2,044,500	
ナガイレーベン	2,000	2,482.00	4,964,000	
三菱食品	1,500	5,370.00	8,055,000	
松田産業	1,200	2,765.00	3,318,000	
第一興商	6,400	1,616.50	10,345,600	
メディパルホールディングス	16,600	2,344.50	38,918,700	
ＳＰＫ	700	2,197.00	1,537,900	
萩原電気ホールディングス	700	4,100.00	2,870,000	
アズワン	5,100	2,613.00	13,326,300	
スズデン	800	1,935.00	1,548,000	
シモジマ	1,100	1,288.00	1,416,800	
ドウシシャ	1,500	2,235.00	3,352,500	
高速	1,100	2,241.00	2,465,100	
たけびし	600	2,145.00	1,287,000	
リックス	500	2,970.00	1,485,000	
丸文	1,100	1,258.00	1,383,800	
ハピネット	1,500	3,760.00	5,640,000	
橋本総業ホールディングス	700	1,349.00	944,300	
日本ライフライン	4,600	1,067.00	4,908,200	
タカショー	1,100	510.00	561,000	
ＩＤＯＭ	4,600	1,376.00	6,329,600	
進和	800	2,789.00	2,231,200	
エスケイジャパン	400	870.00	348,000	
ダイトロン	700	2,982.00	2,087,400	
シークス	2,200	1,302.00	2,864,400	
オーハシテクニカ	500	1,713.00	856,500	
白銅	500	2,915.00	1,457,500	
ダイコー通産	200	1,182.00	236,400	
伊藤忠商事	110,000	7,379.00	811,690,000	
丸紅	135,800	2,982.00	404,955,600	
高島	400	1,038.00	415,200	
長瀬産業	7,400	2,997.00	22,177,800	
蝶理	1,100	3,475.00	3,822,500	
豊田通商	14,300	8,812.00	126,011,600	
三共生興	1,700	723.00	1,229,100	
兼松	6,800	2,588.00	17,598,400	
三井物産	122,600	7,430.00	910,918,000	
日本紙パルプ商事	800	5,910.00	4,728,000	

カメイ	1,600	2,159.00	3,454,400	
東都水産	100	6,460.00	646,000	
ＯＵＧホールディングス	200	2,723.00	544,600	
スターゼン	1,300	2,755.00	3,581,500	
山善	4,800	1,432.00	6,873,600	
椿本興業	1,200	2,148.00	2,577,600	
住友商事	99,100	3,899.00	386,390,900	
内田洋行	700	7,540.00	5,278,000	
三菱商事	314,300	3,080.00	968,044,000	
第一実業	1,500	2,331.00	3,496,500	
キヤノンマーケティングジャパン	3,800	4,411.00	16,761,800	
西華産業	700	4,435.00	3,104,500	
佐藤商事	1,300	1,624.00	2,111,200	
東京産業	800	666.00	532,800	
ユアサ商事	1,300	5,480.00	7,124,000	
神鋼商事	400	7,270.00	2,908,000	
阪和興業	2,900	5,930.00	17,197,000	
正栄食品工業	1,100	4,615.00	5,076,500	
カナデン	1,100	1,571.00	1,728,100	
ＲＹＯＤＥＮ	1,300	2,609.00	3,391,700	
岩谷産業	3,700	9,243.00	34,199,100	
ナイス	400	1,860.00	744,000	
ニチモウ	200	2,104.00	420,800	
極東貿易	700	1,711.00	1,197,700	
アステナホールディングス	1,900	485.00	921,500	
三愛オブリ	3,900	2,113.00	8,240,700	
稲畑産業	3,300	3,380.00	11,154,000	
ＧＳＩクレオス	700	2,156.00	1,509,200	
明和産業	1,300	712.00	925,600	
ワキタ	2,600	1,702.00	4,425,200	
東邦ホールディングス	4,400	3,842.00	16,904,800	
サンゲツ	3,800	3,040.00	11,552,000	
ミツウロコグループホールディングス	2,400	1,573.00	3,775,200	
シナネンホールディングス	300	4,730.00	1,419,000	
伊藤忠エネクス	4,200	1,505.00	6,321,000	
サンリオ	13,300	2,771.50	36,860,950	
サンワテクノス	1,000	2,264.00	2,264,000	
新光商事	2,000	955.00	1,910,000	
トーホー	700	3,740.00	2,618,000	
三信電気	700	2,105.00	1,473,500	
東陽テクニカ	1,400	1,596.00	2,234,400	
モスフードサービス	2,300	3,600.00	8,280,000	

加賀電子	1,500	5,560.00	8,340,000	
ソーダニッカ	1,200	1,101.00	1,321,200	
立花エレテック	1,100	3,080.00	3,388,000	
フォーバル	1,200	1,429.00	1,714,800	
ＰＡＬＴＡＣ	2,200	4,341.00	9,550,200	
三谷産業	2,700	350.00	945,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	400	4,355.00	1,742,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	2,633.00	263,300	
コーア商事ホールディングス	1,800	690.00	1,242,000	
ＫＰＰグループホールディングス	4,100	797.00	3,267,700	
ヤマタネ	700	2,855.00	1,998,500	
泉州電業	1,000	5,230.00	5,230,000	
トラスコ中山	3,300	2,377.00	7,844,100	
オートバックスセブン	5,800	1,514.50	8,784,100	
モリト	900	1,414.00	1,272,600	
加藤産業	2,100	4,220.00	8,862,000	
イエローハット	2,700	2,121.00	5,726,700	
ＪＫホールディングス	1,300	1,003.00	1,303,900	
日伝	1,000	3,630.00	3,630,000	
杉本商事	600	2,393.00	1,435,800	
因幡電機産業	4,300	3,800.00	16,340,000	
東テク	1,700	2,495.00	4,241,500	
ミスミグループ本社	24,700	2,627.00	64,886,900	
蔵王産業	100	2,564.00	256,400	
スズケン	5,800	4,629.00	26,848,200	
ジェコス	900	977.00	879,300	
サンエー	1,300	4,840.00	6,292,000	
カワチ薬品	1,200	2,810.00	3,372,000	
エービーシー・マート	7,200	2,809.50	20,228,400	
ハードオフコーポレーション	900	2,143.00	1,928,700	
アスクル	4,100	2,175.00	8,917,500	
ゲオホールディングス	1,700	1,563.00	2,657,100	
アダストリア	2,100	3,480.00	7,308,000	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	500	635.00	317,500	
くら寿司	1,900	4,300.00	8,170,000	
キャンドゥ	500	3,165.00	1,582,500	
パルグループホールディングス	3,300	1,782.00	5,880,600	
エディオン	6,500	1,578.00	10,257,000	
サーラコーポレーション	3,100	800.00	2,480,000	
ハローズ	800	4,250.00	3,400,000	
フジオフードグループ本社	1,400	1,479.00	2,070,600	
あみやき亭	400	6,080.00	2,432,000	

大黒天物産	500	8,410.00	4,205,000	
ハニーズホールディングス	1,600	1,582.00	2,531,200	
ファーマライズホールディングス	300	640.00	192,000	
アルペン	1,300	2,048.00	2,662,400	
ハブ	500	869.00	434,500	
クオールホールディングス	2,400	1,431.00	3,434,400	
ジンズホールディングス	1,300	3,885.00	5,050,500	
ビックカメラ	10,000	1,613.00	16,130,000	
ＤＣＭホールディングス	8,700	1,468.00	12,771,600	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	23,300	1,859.00	43,314,700	
東京一番フーズ	300	512.00	153,600	
Ｊ．フロント　リテイリング	18,900	1,640.50	31,005,450	
ドトール・日レスホールディングス	2,800	2,179.00	6,101,200	
マツキヨココカラ＆カンパニー	29,900	2,150.50	64,299,950	
ブロンコビリー	900	3,920.00	3,528,000	
ＺＯＺＯ	10,500	3,816.00	40,068,000	
トレジャー・ファクトリー	1,300	1,771.00	2,302,300	
物語コーポレーション	2,800	3,430.00	9,604,000	
三越伊勢丹ホールディングス	27,300	3,138.00	85,667,400	
Ｈａｍｅｅ	1,000	1,130.00	1,130,000	
ウエルシアホールディングス	8,500	1,993.50	16,944,750	
クリエイトＳＤホールディングス	2,400	3,545.00	8,508,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	400	338.00	135,200	
ティーライフ	200	1,427.00	285,400	
シュッピン	1,800	1,335.00	2,403,000	
オイシックス・ラ・大地	2,400	1,183.00	2,839,200	
ネクステージ	3,800	2,417.00	9,184,600	
ジョイフル本田	4,800	2,129.00	10,219,200	
エターナルホスピタリティグループ	700	3,675.00	2,572,500	
ホットランド	1,400	2,531.00	3,543,400	
すかいらーくホールディングス	22,500	2,271.00	51,097,500	
ＳＦＰホールディングス	700	2,094.00	1,465,800	
綿半ホールディングス	1,400	1,661.00	2,325,400	
ヨシックスホールディングス	600	2,835.00	1,701,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,500	872.00	3,924,000	
ＢＥＥＮＯＳ	1,100	2,300.00	2,530,000	
あさひ	1,700	1,480.00	2,516,000	
日本調剤	1,000	1,405.00	1,405,000	
コスモス薬品	1,400	12,720.00	17,808,000	
トーエル	600	814.00	488,400	
セブン＆アイ・ホールディングス	167,700	1,997.50	334,980,750	

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	11,300	1,118.00	12,633,400	
ツルハホールディングス	3,500	9,049.00	31,671,500	
サンマルクホールディングス	1,000	2,149.00	2,149,000	
トリドールホールディングス	4,600	3,577.00	16,454,200	
ウイルプラスホールディングス	300	1,135.00	340,500	
ＪＭホールディングス	1,400	2,769.00	3,876,600	
アレンザホールディングス	1,200	1,098.00	1,317,600	
串カツ田中ホールディングス	800	1,665.00	1,332,000	
バロックジャパンリミテッド	1,200	797.00	956,400	
クスリのアオキホールディングス	5,000	3,095.00	15,475,000	
力の源ホールディングス	1,200	1,461.00	1,753,200	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥ	8,800	2,599.50	22,875,600	
メディカルシステムネットワーク	2,500	579.00	1,447,500	
一家ホールディングス	400	682.00	272,800	
ノジマ	4,800	1,569.00	7,531,200	
カッパ・クリエイト	2,500	1,700.00	4,250,000	
良品計画	19,600	2,704.00	52,998,400	
アドヴァングループ	1,900	955.00	1,814,500	
アルビス	500	2,602.00	1,301,000	
ハウス　オブ　ローゼ	200	1,588.00	317,600	
Ｇ－７ホールディングス	2,000	1,506.00	3,012,000	
イオン北海道	5,000	909.00	4,545,000	
コジマ	2,900	914.00	2,650,600	
コーナン商事	2,000	4,080.00	8,160,000	
エコス	800	2,234.00	1,787,200	
ワタミ	2,200	897.00	1,973,400	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	33,100	3,708.00	122,734,800	
西松屋チェーン	3,300	2,176.00	7,180,800	
ゼンショーホールディングス	8,400	6,076.00	51,038,400	
サイゼリヤ	2,500	5,240.00	13,100,000	
ＶＴホールディングス	7,000	486.00	3,402,000	
魚力	700	2,438.00	1,706,600	
フジ・コーポレーション	1,100	2,095.00	2,304,500	
ユナイテッドアローズ	2,100	1,903.00	3,996,300	
ハイデイ日高	2,500	3,060.00	7,650,000	
コロワイド	7,200	2,013.00	14,493,600	
壱番屋	6,600	1,131.00	7,464,600	
スギホールディングス	9,900	2,335.50	23,121,450	
薬王堂ホールディングス	900	2,803.00	2,522,700	
スクロール	2,700	1,056.00	2,851,200	
ヨンドシーホールディングス	1,400	1,908.00	2,671,200	

木曽路	2,400	2,538.00	6,091,200	
ＳＲＳホールディングス	2,800	1,273.00	3,564,400	
千趣会	2,500	321.00	802,500	
リテールパートナーズ	2,400	1,595.00	3,828,000	
上新電機	1,600	2,559.00	4,094,400	
日本瓦斯	8,700	2,363.50	20,562,450	
ロイヤルホールディングス	2,900	2,595.00	7,525,500	
いなげや	1,100	1,242.00	1,366,200	
チヨダ	1,000	894.00	894,000	
ライフコーポレーション	1,800	3,950.00	7,110,000	
リンガーハット	2,200	2,366.00	5,205,200	
ＭｒＭａｘＨＤ	2,700	657.00	1,773,900	
ＡＯＫＩホールディングス	3,400	1,232.00	4,188,800	
オークワ	1,800	938.00	1,688,400	
コメリ	2,600	3,490.00	9,074,000	
青山商事	3,600	1,456.00	5,241,600	
しまむら	3,900	7,167.00	27,951,300	
はせがわ	800	357.00	285,600	
高島屋	10,500	2,602.00	27,321,000	
松屋	2,500	1,046.00	2,615,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	7,300	2,279.00	16,636,700	
近鉄百貨店	800	2,295.00	1,836,000	
丸井グループ	11,000	2,235.50	24,590,500	
アクシアル　リテイリング	4,600	1,004.00	4,618,400	
イオン	55,600	3,424.00	190,374,400	
イズミ	2,900	3,133.00	9,085,700	
平和堂	2,600	2,268.00	5,896,800	
フジ	2,600	2,011.00	5,228,600	
ヤオコー	1,900	9,765.00	18,553,500	
ゼビオホールディングス	1,700	1,200.00	2,040,000	
ケーズホールディングス	11,200	1,409.50	15,786,400	
日産東京販売ホールディングス	1,700	494.00	839,800	
シルバーライフ	900	969.00	872,100	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	800	5,650.00	4,520,000	
ナルミヤ・インターナショナル	200	1,321.00	264,200	
ブックオフグループホールディングス	1,300	1,586.00	2,061,800	
ギフトホールディングス	800	2,626.00	2,100,800	
アインホールディングス	2,300	5,723.00	13,162,900	
元気寿司	1,100	3,205.00	3,525,500	
ヤマダホールディングス	50,600	424.30	21,469,580	
アークランズ	4,900	1,895.00	9,285,500	
ニトリホールディングス	6,000	16,760.00	100,560,000	

ケーユーホールディングス	1,200	1,254.00	1,504,800	
吉野家ホールディングス	6,100	3,018.00	18,409,800	
松屋フーズホールディングス	800	5,730.00	4,584,000	
サガミホールディングス	2,400	1,613.00	3,871,200	
関西フードマーケット	1,300	2,373.00	3,084,900	
王将フードサービス	1,200	8,700.00	10,440,000	
ミニストップ	800	1,718.00	1,374,400	
アークス	3,000	2,862.00	8,586,000	
バローホールディングス	3,000	2,367.00	7,101,000	
ベルク	800	7,280.00	5,824,000	
大庄	700	1,230.00	861,000	
ファーストリテイリング	9,200	39,460.00	363,032,000	
サンドラッグ	5,500	3,923.00	21,576,500	
サックスバー　ホールディングス	1,300	772.00	1,003,600	
やまや	300	3,075.00	922,500	
ベルーナ	3,500	742.00	2,597,000	
いよぎんホールディングス	18,100	1,389.00	25,140,900	
しずおかフィナンシャルグループ	33,900	1,429.50	48,460,050	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	12,800	1,589.50	20,345,600	
楽天銀行	7,200	2,706.00	19,483,200	
京都フィナンシャルグループ	19,200	2,557.50	49,104,000	
じもとホールディングス	700	350.00	245,000	
めぶきフィナンシャルグループ	70,600	585.90	41,364,540	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	4,500.00	9,000,000	
九州フィナンシャルグループ	29,500	930.70	27,455,650	
ゆうちょ銀行	167,500	1,464.50	245,303,750	
富山第一銀行	4,800	1,149.00	5,515,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	81,100	881.20	71,465,320	
西日本フィナンシャルホールディングス	8,500	1,877.00	15,954,500	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	2,035.00	2,849,000	
第四北越フィナンシャルグループ	2,400	4,900.00	11,760,000	
ひろぎんホールディングス	21,700	1,182.50	25,660,250	
おきなわフィナンシャルグループ	1,300	2,456.00	3,192,800	
十六フィナンシャルグループ	2,000	4,415.00	8,830,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,600	5,240.00	8,384,000	
プロクレアホールディングス	1,700	1,806.00	3,070,200	
あいちフィナンシャルグループ	3,400	2,708.00	9,207,200	
あおぞら銀行	10,900	2,595.00	28,285,500	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	928,100	1,544.50	1,433,450,450	代用有価証券 90,000株
りそなホールディングス	176,200	971.60	171,195,920	
三井住友トラスト・ホールディングス	54,800	3,522.00	193,005,600	
三井住友フィナンシャルグループ	106,700	9,860.00	1,052,062,000	

千葉銀行	42,500	1,359.50	57,778,750	
群馬銀行	29,600	967.00	28,623,200	
武蔵野銀行	2,100	3,130.00	6,573,000	
千葉興業銀行	3,200	977.00	3,126,400	
筑波銀行	6,500	304.00	1,976,000	
七十七銀行	4,400	4,235.00	18,634,000	
秋田銀行	1,000	2,590.00	2,590,000	
山形銀行	1,600	1,139.00	1,822,400	
岩手銀行	900	2,788.00	2,509,200	
東邦銀行	12,000	316.00	3,792,000	
東北銀行	400	1,179.00	471,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	13,300	4,050.00	53,865,000	
スルガ銀行	11,500	1,032.00	11,868,000	
八十二銀行	32,700	994.90	32,533,230	
山梨中央銀行	1,700	1,875.00	3,187,500	
大垣共立銀行	2,800	2,134.00	5,975,200	
福井銀行	1,300	2,007.00	2,609,100	
清水銀行	600	1,620.00	972,000	
滋賀銀行	2,600	4,245.00	11,037,000	
南都銀行	2,200	3,370.00	7,414,000	
百五銀行	14,100	656.00	9,249,600	
紀陽銀行	5,400	1,870.00	10,098,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	9,400	2,044.50	19,218,300	
山陰合同銀行	9,600	1,347.00	12,931,200	
鳥取銀行	200	1,370.00	274,000	
百十四銀行	1,500	3,270.00	4,905,000	
四国銀行	2,200	1,099.00	2,417,800	
阿波銀行	2,100	2,667.00	5,600,700	
大分銀行	900	3,330.00	2,997,000	
宮崎銀行	900	3,355.00	3,019,500	
佐賀銀行	900	2,533.00	2,279,700	
琉球銀行	3,200	1,194.00	3,820,800	
セブン銀行	50,900	259.30	13,198,370	
みずほフィナンシャルグループ	205,700	3,024.00	622,036,800	
山口フィナンシャルグループ	14,900	1,710.00	25,479,000	
名古屋銀行	900	7,230.00	6,507,000	
北洋銀行	23,300	529.00	12,325,700	
大光銀行	200	1,578.00	315,600	
愛媛銀行	2,000	1,232.00	2,464,000	
トマト銀行	300	1,224.00	367,200	
京葉銀行	6,200	854.00	5,294,800	
栃木銀行	7,400	354.00	2,619,600	

北日本銀行	500	2,539.00	1,269,500	
東和銀行	2,700	685.00	1,849,500	
大東銀行	300	743.00	222,900	
トモニホールディングス	14,300	397.00	5,677,100	
フィデアホールディングス	1,500	1,574.00	2,361,000	
池田泉州ホールディングス	21,000	388.00	8,148,000	
ＦＰＧ	6,000	2,094.00	12,564,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	2,300	1,457.00	3,351,100	
マーキュリアホールディングス	200	919.00	183,800	
ＳＢＩホールディングス	24,400	3,932.00	95,940,800	
ジャフコ　グループ	4,400	1,877.50	8,261,000	
大和証券グループ本社	118,000	1,169.00	137,942,000	
野村ホールディングス	256,100	898.00	229,977,800	
岡三証券グループ	13,000	772.00	10,036,000	
丸三証券	4,900	991.00	4,855,900	
東洋証券	3,600	376.00	1,353,600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,000	569.00	10,242,000	
水戸証券	4,000	535.00	2,140,000	
いちよし証券	2,600	817.00	2,124,200	
松井証券	8,400	797.00	6,694,800	
マネックスグループ	14,900	715.00	10,653,500	
極東証券	2,100	1,417.00	2,975,700	
岩井コスモホールディングス	1,900	2,160.00	4,104,000	
アイザワ証券グループ	2,100	2,216.00	4,653,600	
スパークス・グループ	2,300	1,642.00	3,776,600	
かんぽ生命保険	15,500	2,922.50	45,298,750	
ＦＰパートナー	500	3,265.00	1,632,500	
ＳＯＭＰＯホールディングス	68,800	3,163.00	217,614,400	
アニコム　ホールディングス	5,300	640.00	3,392,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	102,400	3,059.00	313,241,600	
第一生命ホールディングス	71,600	3,864.00	276,662,400	
東京海上ホールディングス	148,800	5,263.00	783,134,400	
Ｔ＆Ｄホールディングス	40,900	2,590.00	105,931,000	
アドバンスクリエイト	800	1,056.00	844,800	
ＮＥＸＹＺ．Ｇｒｏｕｐ	700	604.00	422,800	
全国保証	4,000	5,678.00	22,712,000	
あんしん保証	2,000	219.00	438,000	
ジェイリース	1,600	1,263.00	2,020,800	
イントラスト	700	800.00	560,000	
日本モーゲージサービス	900	416.00	374,400	
ＳＢＩアルヒ	1,000	861.00	861,000	
プレミアグループ	2,800	2,048.00	5,734,400	

ネットプロテクションズホールディングス	2,800	199.00	557,200	
クレディセゾン	9,600	3,316.00	31,833,600	
芙蓉総合リース	1,400	11,780.00	16,492,000	
みずほリース	13,000	1,104.00	14,352,000	
東京センチュリー	11,200	1,434.50	16,066,400	
日本証券金融	5,400	1,588.00	8,575,200	
アイフル	23,000	376.00	8,648,000	
リコーリース	1,300	5,020.00	6,526,000	
イオンフィナンシャルサービス	8,700	1,290.00	11,223,000	
アコム	27,800	379.00	10,536,200	
ジャックス	1,700	4,725.00	8,032,500	
オリエントコーポレーション	4,700	1,014.00	4,765,800	
オリックス	91,300	3,364.00	307,133,200	
三菱ＨＣキャピタル	67,800	1,018.00	69,020,400	
日本取引所グループ	39,300	3,573.00	140,418,900	
イー・ギャランティ	2,700	1,358.00	3,666,600	
ＮＥＣキャピタルソリューション	600	3,835.00	2,301,000	
大東建託	5,600	16,435.00	92,036,000	
サムティホールディングス	2,500	2,473.00	6,182,500	
いちご	15,800	378.00	5,972,400	
日本駐車場開発	19,800	198.00	3,920,400	
スター・マイカ・ホールディングス	2,400	607.00	1,456,800	
ＳＲＥホールディングス	600	4,640.00	2,784,000	
ヒューリック	35,300	1,447.00	51,079,100	
野村不動産ホールディングス	8,400	3,940.00	33,096,000	
三重交通グループホールディングス	3,700	589.00	2,179,300	
ディア・ライフ	2,900	892.00	2,586,800	
コーセーアールイー	300	720.00	216,000	
地主	1,300	2,290.00	2,977,000	
プレサンスコーポレーション	2,100	1,881.00	3,950,100	
ＴＨＥグローバル社	1,000	562.00	562,000	
ＪＰＭＣ	1,200	1,200.00	1,440,000	
サンセイランディック	300	1,007.00	302,100	
エストラスト	300	707.00	212,100	
フージャースホールディングス	2,500	1,143.00	2,857,500	
オープンハウスグループ	5,600	4,717.00	26,415,200	
東急不動産ホールディングス	45,500	1,051.00	47,820,500	
飯田グループホールディングス	14,500	2,101.50	30,471,750	
イーグランド	100	1,543.00	154,300	
ムゲンエステート	700	1,222.00	855,400	
ビーロット	900	901.00	810,900	
ファーストブラザーズ	200	1,185.00	237,000	

Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	1,300	1,144.00	1,487,200	
シーアールイー	900	1,452.00	1,306,800	
ケイアイスター不動産	900	3,365.00	3,028,500	
アグレ都市デザイン	300	1,567.00	470,100	
グッドコムアセット	700	759.00	531,300	
ジェイ・エス・ビー	900	2,929.00	2,636,100	
ロードスターキャピタル	1,100	2,769.00	3,045,900	
テンポイノベーション	500	873.00	436,500	
グローバル・リンク・マネジメント	300	2,148.00	644,400	
霞ヶ関キャピタル	600	14,020.00	8,412,000	
パーク２４	9,900	1,498.00	14,830,200	
パラカ	700	2,012.00	1,408,400	
ミガロホールディングス	200	4,960.00	992,000	
三井不動産	211,200	1,416.00	299,059,200	
三菱地所	99,500	2,480.00	246,760,000	
平和不動産	2,400	3,895.00	9,348,000	
東京建物	13,200	2,401.00	31,693,200	
京阪神ビルディング	2,600	1,713.00	4,453,800	
住友不動産	22,000	4,664.00	102,608,000	
テーオーシー	2,500	681.00	1,702,500	
レオパレス２１	15,800	507.00	8,010,600	
スターツコーポレーション	2,300	3,390.00	7,797,000	
フジ住宅	1,900	738.00	1,402,200	
空港施設	1,200	596.00	715,200	
明和地所	1,500	920.00	1,380,000	
ゴールドクレスト	1,100	2,624.00	2,886,400	
エスリード	800	4,415.00	3,532,000	
日神グループホールディングス	1,500	519.00	778,500	
日本エスコン	3,300	1,043.00	3,441,900	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	6,700	489.00	3,276,300	
イオンモール	7,800	1,946.00	15,178,800	
毎日コムネット	400	741.00	296,400	
カチタス	4,200	1,678.00	7,047,600	
トーセイ	2,600	2,291.00	5,956,600	
サンフロンティア不動産	2,400	1,920.00	4,608,000	
ＦＪネクストホールディングス	1,800	1,220.00	2,196,000	
グランディハウス	600	588.00	352,800	
日本空港ビルデング	5,300	5,404.00	28,641,200	
明豊ファシリティワークス	700	880.00	616,000	
ＭＩＸＩ	3,200	2,862.00	9,158,400	
ジェイエイシーリクルートメント	6,000	645.00	3,870,000	
日本M&Aセンターホールディングス	25,200	795.90	20,056,680	

中広	100	486.00	48,600	
ＵＴグループ	2,100	2,839.00	5,961,900	
アイティメディア	800	1,907.00	1,525,600	
ケアネット	3,500	538.00	1,883,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	1,000	1,790.00	1,790,000	
オープンアップグループ	4,800	1,946.00	9,340,800	
コシダカホールディングス	5,000	851.00	4,255,000	
アルトナー	400	1,907.00	762,800	
パソナグループ	1,700	2,180.00	3,706,000	
ＣＤＳ	300	1,807.00	542,100	
リンクアンドモチベーション	5,100	460.00	2,346,000	
エス・エム・エス	5,600	2,043.00	11,440,800	
サニーサイドアップグループ	300	656.00	196,800	
パーソルホールディングス	160,600	210.30	33,774,180	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	700	785.00	549,500	
学情	1,000	1,869.00	1,869,000	
スタジオアリス	700	2,135.00	1,494,500	
エプコ	200	818.00	163,600	
ＮＪＳ	300	3,900.00	1,170,000	
綜合警備保障	26,300	941.80	24,769,340	
カカクコム	10,300	2,008.50	20,687,550	
アイロムグループ	800	2,789.00	2,231,200	
セントケア・ホールディング	1,600	827.00	1,323,200	
ルネサンス	600	960.00	576,000	
ディップ	2,500	2,614.00	6,535,000	
デジタルホールディングス	500	1,043.00	521,500	
新日本科学	1,600	1,354.00	2,166,400	
キャリアデザインセンター	200	1,757.00	351,400	
エムスリー	31,200	1,476.50	46,066,800	
ツカダ・グローバルホールディング	700	462.00	323,400	
ウェルネット	100	635.00	63,500	
ワールドホールディングス	900	2,129.00	1,916,100	
ディー・エヌ・エー	5,400	1,535.50	8,291,700	
博報堂ＤＹホールディングス	20,000	1,094.00	21,880,000	
ぐるなび	1,800	322.00	579,600	
タカミヤ	1,700	487.00	827,900	
ファンコミュニケーションズ	2,800	412.00	1,153,600	
ライク	800	1,505.00	1,204,000	
エスプール	5,900	314.00	1,852,600	
ＷＤＢホールディングス	1,000	1,841.00	1,841,000	
ティア	500	459.00	229,500	
アドウェイズ	1,700	388.00	659,600	

バリューコマース	1,800	1,215.00	2,187,000	
インフォマート	15,300	309.00	4,727,700	
ＪＰホールディングス	4,600	540.00	2,484,000	
プレステージ・インターナショナル	7,400	652.00	4,824,800	
アミューズ	600	1,625.00	975,000	
ドリームインキュベータ	700	2,177.00	1,523,900	
クイック	1,200	2,095.00	2,514,000	
電通グループ	15,600	3,916.00	61,089,600	
ぴあ	600	3,040.00	1,824,000	
イオンファンタジー	200	2,300.00	460,000	
シーティーエス	2,400	790.00	1,896,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	4,600	2,492.00	11,463,200	
アルプス技研	1,600	2,491.00	3,985,600	
日本空調サービス	1,900	1,046.00	1,987,400	
オリエンタルランド	84,100	4,385.00	368,778,500	
ダスキン	3,400	3,679.00	12,508,600	
明光ネットワークジャパン	2,400	736.00	1,766,400	
ファルコホールディングス	600	2,295.00	1,377,000	
ラウンドワン	15,100	793.00	11,974,300	
リゾートトラスト	6,800	2,351.00	15,986,800	
ビー・エム・エル	1,800	2,767.00	4,980,600	
リソー教育	9,100	252.00	2,293,200	
早稲田アカデミー	1,200	1,585.00	1,902,000	
ユー・エス・エス	35,500	1,258.00	44,659,000	
東京個別指導学院	3,000	408.00	1,224,000	
サイバーエージェント	34,900	974.30	34,003,070	
楽天グループ	136,200	786.00	107,053,200	
クリーク・アンド・リバー社	1,100	1,756.00	1,931,600	
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	3,500	647.00	2,264,500	
テー・オー・ダブリュー	4,100	363.00	1,488,300	
山田コンサルティンググループ	900	1,929.00	1,736,100	
セントラルスポーツ	700	2,484.00	1,738,800	
フルキャストホールディングス	1,700	1,500.00	2,550,000	
エン・ジャパン	2,300	2,570.00	5,911,000	
リソルホールディングス	100	4,720.00	472,000	
テクノプロ・ホールディングス	9,300	2,570.00	23,901,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	1,000	1,230.00	1,230,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	1,000	4,070.00	4,070,000	
ファーストロジック	300	516.00	154,800	
三機サービス	100	1,112.00	111,200	
Ｇｕｎｏｓｙ	700	773.00	541,100	
イー・ガーディアン	900	1,932.00	1,738,800	

リブセンス	900	217.00	195,300	
ジャパンマテリアル	4,900	1,948.00	9,545,200	
ベクトル	2,100	1,239.00	2,601,900	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,500	1,599.00	2,398,500	
キャリアリンク	800	2,460.00	1,968,000	
ＩＢＪ	2,100	585.00	1,228,500	
アサンテ	700	1,714.00	1,199,800	
バリューＨＲ	1,600	1,491.00	2,385,600	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,300	2,099.00	2,728,700	
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	1,034.00	517,000	
ＥＲＩホールディングス	300	2,271.00	681,300	
シグマクシス・ホールディングス	2,300	1,518.00	3,491,400	
ウィルグループ	1,700	948.00	1,611,600	
メドピア	1,100	598.00	657,800	
レアジョブ	300	425.00	127,500	
リクルートホールディングス	114,500	7,885.00	902,832,500	
エラン	2,400	894.00	2,145,600	
日本郵政	166,100	1,475.00	244,997,500	
ベルシステム２４ホールディングス	1,800	1,438.00	2,588,400	
鎌倉新書	2,200	445.00	979,000	
一蔵	100	572.00	57,200	
エアトリ	1,300	1,337.00	1,738,100	
ストライク	800	4,215.00	3,372,000	
ソラスト	4,900	452.00	2,214,800	
セラク	900	1,167.00	1,050,300	
インソース	3,700	891.00	3,296,700	
ベイカレント・コンサルティング	11,600	3,121.00	36,203,600	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	100	1,462.00	146,200	
アイモバイル	3,200	509.00	1,628,800	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	900	1,047.00	942,300	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,200	2,424.00	12,604,800	
グリーンズ	400	1,905.00	762,000	
エル・ティー・エス	300	2,086.00	625,800	
ミダックホールディングス	1,300	1,520.00	1,976,000	
キュービーネットホールディングス	1,100	1,058.00	1,163,800	
マネジメントソリューションズ	900	1,405.00	1,264,500	
プロレド・パートナーズ	700	721.00	504,700	
フロンティア・マネジメント	700	1,272.00	890,400	
コプロ・ホールディングス	400	1,655.00	662,000	
アンビスホールディングス	3,500	2,365.00	8,277,500	
カーブスホールディングス	4,800	749.00	3,595,200	
フォーラムエンジニアリング	2,400	832.00	1,996,800	

Ｆａｓｔ　Ｆｉｔｎｅｓｓ　Ｊａｐａｎ	1,000	1,377.00	1,377,000	
ポピンズ	100	1,204.00	120,400	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	1,300	1,802.00	2,342,600	
コンフィデンス・インターワークス	100	1,838.00	183,800	
アドバンテッジリスクマネジメント	200	503.00	100,600	
リログループ	8,000	1,677.00	13,416,000	
東祥	600	703.00	421,800	
ＩＤ＆Ｅホールディングス	800	4,250.00	3,400,000	
ビーウィズ	600	1,829.00	1,097,400	
ＴＲＥホールディングス	2,700	1,174.00	3,169,800	
人・夢・技術グループ	300	1,696.00	508,800	
ＮＩＳＳＯホールディングス	1,700	816.00	1,387,200	
大栄環境	2,900	2,501.00	7,252,900	
日本管財ホールディングス	1,700	2,599.00	4,418,300	
Ｍ＆Ａ総研ホールディングス	1,700	3,325.00	5,652,500	
エイチ・アイ・エス	4,400	1,685.00	7,414,000	
ラックランド	300	2,094.00	628,200	
共立メンテナンス	4,900	2,983.00	14,616,700	
イチネンホールディングス	1,900	1,619.00	3,076,100	
建設技術研究所	900	4,850.00	4,365,000	
スペース	800	1,129.00	903,200	
燦ホールディングス	1,700	1,153.00	1,960,100	
スバル興業	600	2,531.00	1,518,600	
ナガワ	400	7,760.00	3,104,000	
東京都競馬	1,300	4,010.00	5,213,000	
カナモト	2,200	2,982.00	6,560,400	
ニシオホールディングス	1,200	4,055.00	4,866,000	
トランス・コスモス	2,000	3,280.00	6,560,000	
乃村工藝社	6,500	825.00	5,362,500	
藤田観光	700	6,120.00	4,284,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	1,200	1,331.00	1,597,200	
トーカイ	1,500	2,149.00	3,223,500	
白洋舎	200	2,447.00	489,400	
セコム	16,200	9,260.00	150,012,000	
セントラル警備保障	900	2,949.00	2,654,100	
丹青社	3,200	949.00	3,036,800	
メイテックグループホールディングス	5,400	3,028.00	16,351,200	
応用地質	1,300	2,627.00	3,415,100	
船井総研ホールディングス	3,200	2,245.00	7,184,000	
オオバ	700	1,070.00	749,000	
学究社	800	2,077.00	1,661,600	
イオンディライト	1,700	3,815.00	6,485,500	

ナック	2,000	567.00	1,134,000	
ダイセキ	3,300	3,280.00	10,824,000	
ステップ	700	1,891.00	1,323,700	
合　　計	24,765,900		58,888,845,740	

(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
資産の部	
流動資産	
預金	2,287,799,228
コール・ローン	4,669,439,542
株式	412,973,561,923
投資証券	7,633,035,032
派生商品評価勘定	136,347,249
未収入金	5,687,657
未収配当金	445,848,034
未収利息	10,538
差入委託証拠金	697,047,301
流動資産合計	428,848,776,504
資産合計	428,848,776,504
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,091,535
未払金	2,119,499,366
未払解約金	115,627,728
流動負債合計	2,247,218,629
負債合計	2,247,218,629
純資産の部	
元本等	
元本	63,890,308,192
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	362,711,249,683
元本等合計	426,601,557,875
純資産合計	426,601,557,875
負債純資産合計	428,848,776,504

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 6月17日現在
１．	期首	2023年 6月20日
	期首元本額	60,695,048,185円
	期首からの追加設定元本額	10,256,311,431円
	期首からの一部解約元本額	7,061,051,424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
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	97,765,501円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	284,851,081円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	640,667,893円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	828,232,393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
	日興五大陸株式ファンド	3,401,444,973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
	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
	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
	Ｔｒａｃｅｒｓ　グローバル３分法（おとなのバランス）	14,488,505円
	インデックスファンドＭＳＣＩオール・カントリー（全世界株式）	3,052,926,149円
	Ｔｒａｃｅｒｓ　ＭＳＣＩオール・カントリー・インデックス（全世界株式）	515,065,720円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	432,130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
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	1,059,413,705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
	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
	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
	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
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,128,670,699円
	計	63,890,308,192円
２．	受益権の総数	63,890,308,192口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2023年 6月20日 至 2024年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2024年 6月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引

	2024年 6月17日現在
	「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

（2024年 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

(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

（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

（注）1.時価の算定方法

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

①同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2024年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	6.6771円
(1万口当たり純資産額)	(66,771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	27.82	525,519.80	
	BAKER HUGHES CO	40,615	31.09	1,262,720.35	
	CHENIERE ENERGY INC	9,880	155.88	1,540,094.40	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	4,720	85.14	401,860.80	
	CHEVRON CORP	76,331	152.57	11,645,820.67	
	CHORD ENERGY CORP	2,600	162.42	422,292.00	
	CONOCOPHILLIPS	50,966	109.39	5,575,170.74	
	COTERRA ENERGY INC	32,460	26.73	867,655.80	
	DEVON ENERGY CORPORATION	25,260	45.56	1,150,845.60	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	6,980	185.97	1,298,070.60	
	EOG RESOURCES INC	24,042	118.24	2,842,726.08	
	EQT CORP	17,050	39.34	670,747.00	
	EXXON MOBIL CORP	193,159	109.11	21,075,578.49	
	HALLIBURTON CO	37,607	32.92	1,238,022.44	
	HESS CORP	11,210	143.45	1,608,074.50	
	HF SINCLAIR CORP	5,940	52.23	310,246.20	
	KINDER MORGAN INC	81,490	19.59	1,596,389.10	
	MARATHON OIL CORP	28,380	27.30	774,774.00	

MARATHON PETROLEUM CORP	15,742	170.07	2,677,241.94	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	28,351	59.84	1,696,523.84	
ONEOK INC	24,500	78.10	1,913,450.00	
OVINTIV INC	13,280	45.81	608,356.80	
PHILLIPS 66	18,855	136.76	2,578,609.80	
SCHLUMBERGER LTD	60,961	43.00	2,621,323.00	
TARGA RESOURCES CORP	8,180	119.00	973,420.00	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	735	750.00	551,250.00	
VALERO ENERGY CORP	14,682	150.07	2,203,327.74	
WILLIAMS COS INC	50,624	41.17	2,084,190.08	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,115	275.14	2,507,901.10	
ALBEMARLE CORP	4,750	103.51	491,672.50	
AMCOR PLC	65,600	9.96	653,376.00	
AVERY DENNISON CORP	3,040	226.53	688,651.20	
BALL CORP	14,380	66.01	949,223.80	
CELANESE CORP	4,090	139.39	570,105.10	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,820	73.26	572,893.20	
CLEVELAND-CLIFFS INC	21,150	14.91	315,346.50	
CORTEVA INC	29,832	51.18	1,526,801.76	
CRH PLC	29,300	76.55	2,242,915.00	
CROWN HOLDINGS INC	4,565	78.18	356,891.70	
DOW INC	31,205	55.02	1,716,899.10	
DUPONT DE NEMOURS INC	19,162	79.66	1,526,444.92	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,815	99.51	479,140.65	
ECOLAB INC	11,060	240.05	2,654,953.00	
FREEPORT-MCMORAN INC	61,328	48.11	2,950,490.08	
INTERNATIONAL PAPER CO	13,670	44.89	613,646.30	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,675	94.54	1,009,214.50	
LINDE PLC	20,710	436.95	9,049,234.50	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,570	93.54	988,717.80	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,720	566.85	1,541,832.00	
MOSAIC CO/THE	13,580	27.16	368,832.80	
NEWMONT CORP	49,002	40.82	2,000,261.64	
NUCOR CORP	9,959	154.69	1,540,557.71	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	182.68	653,994.40	
PPG INDUSTRIES INC	10,334	127.32	1,315,724.88	
RELIANCE INC	2,770	277.09	767,539.30	
RPM INTERNATIONAL INC	4,960	111.29	551,998.40	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,316	296.99	3,063,748.84	
STEEL DYNAMICS INC	7,090	120.69	855,692.10	
VULCAN MATERIALS CO	5,563	252.64	1,405,436.32	
WESTLAKE CORP	1,360	149.83	203,768.80	
WESTROCK CO	9,989	49.66	496,053.74	

3M CO	23,576	100.90	2,378,818.40	
AECOM	7,170	86.59	620,850.30	
AERCAP HOLDINGS NV	9,760	89.03	868,932.80	
ALLEGION PLC	3,340	116.36	388,642.40	
AMETEK INC	10,233	167.02	1,709,115.66	
AXON ENTERPRISE INC	3,320	292.33	970,535.60	
BOEING CO/THE	25,082	177.27	4,446,286.14	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	5,240	149.55	783,642.00	
CARLISLE COS INC	2,250	405.30	911,925.00	
CARRIER GLOBAL CORP	33,088	64.35	2,129,212.80	
CATERPILLAR INC	21,826	321.47	7,016,404.22	
CNH INDUSTRIAL NV	40,400	10.40	420,160.00	
CUMMINS INC	6,355	266.48	1,693,480.40	
DEERE & CO	11,455	378.00	4,329,990.00	
DOVER CORP	6,680	177.25	1,184,030.00	
EATON CORP PLC	17,276	319.02	5,511,389.52	
EMCOR GROUP INC	2,010	377.20	758,172.00	
EMERSON ELECTRIC CO	24,700	106.46	2,629,562.00	
FASTENAL CO	24,326	63.05	1,533,754.30	
FERGUSON PLC	8,440	201.47	1,700,406.80	
FORTIVE CORP	14,854	72.73	1,080,331.42	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	5,050	67.33	340,016.50	
GE VERNOVA INC	11,386	170.17	1,937,555.62	
GENERAL DYNAMICS CORP	9,757	291.78	2,846,897.46	
GENERAL ELECTRIC CO	47,177	155.88	7,353,950.76	
GRACO INC	8,120	79.29	643,834.80	
HEICO CORP	1,800	225.17	405,306.00	
HEICO CORP-CLASS A	3,120	177.21	552,895.20	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	28,306	208.53	5,902,650.18	
HOWMET AEROSPACE INC	17,943	78.94	1,416,420.42	
HUBBELL INC	2,320	374.74	869,396.80	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,530	238.46	364,843.80	
IDEX CORP	3,640	198.23	721,557.20	
ILLINOIS TOOL WORKS	12,835	235.17	3,018,406.95	
INGERSOLL-RAND INC	16,398	91.46	1,499,761.08	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,570	36.66	240,856.20	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	29,834	69.43	2,071,374.62	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,750	217.47	1,685,392.50	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,385	534.00	739,590.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	9,511	458.34	4,359,271.74	
MASCO CORP	9,849	69.14	680,959.86	
NORDSON CORP	2,345	228.72	536,348.40	
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,954	424.09	2,525,031.86	

OTIS WORLDWIDE CORP	17,124	97.13	1,663,254.12	
OWENS CORNING	3,550	176.58	626,859.00	
PACCAR INC	21,896	106.72	2,336,741.12	
PARKER HANNIFIN CORP	5,775	503.30	2,906,557.50	
PENTAIR PLC	6,918	77.33	534,968.94	
QUANTA SERVICES INC	6,700	273.29	1,831,043.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,618	254.39	1,174,773.02	
RTX CORP	58,166	104.23	6,062,642.18	
SMITH (A.O.) CORP	5,020	82.46	413,949.20	
SNAP-ON INC	2,525	262.24	662,156.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,226	83.55	603,732.30	
TEXTRON INC	7,956	85.25	678,249.00	
TORO CO	3,890	96.61	375,812.90	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,666	329.64	3,186,300.24	
TRANSDIGM GROUP INC	2,350	1,294.76	3,042,686.00	
UNITED RENTALS INC	2,805	616.21	1,728,469.05	
VERTIV HOLDINGS CO	17,190	91.48	1,572,541.20	
WABTEC CORP	7,130	160.32	1,143,081.60	
WATSCO INC	1,540	477.99	736,104.60	
WW GRAINGER INC	1,847	906.79	1,674,841.13	
XYLEM INC	10,898	138.02	1,504,141.96	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	17,771	242.62	4,311,600.02	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,910	150.42	888,982.20	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	5,230	195.13	1,020,529.90	
CINTAS CORP	3,882	695.69	2,700,668.58	
COPART INC	37,560	53.21	1,998,567.60	
DAYFORCE INC	7,010	50.49	353,934.90	
EQUIFAX INC	5,024	241.61	1,213,848.64	
JACOBS SOLUTIONS INC	6,200	138.20	856,840.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	5,950	143.70	855,015.00	
PAYCHEX INC	14,002	121.99	1,708,103.98	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,765	142.78	394,786.70	
PAYLOCITY HOLDING CORP	1,730	139.23	240,867.90	
REPUBLIC SERVICES INC	8,920	188.64	1,682,668.80	
ROLLINS INC	14,385	48.50	697,672.50	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	60.69	514,044.30	
TRANSUNION	7,940	71.79	570,012.60	
VERALTO CORP	9,343	100.75	941,307.25	
VERISK ANALYTICS INC	6,310	264.37	1,668,174.70	
WASTE CONNECTIONS INC	10,606	168.61	1,788,277.66	
WASTE MANAGEMENT INC	17,174	203.64	3,497,313.36	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,930	83.60	412,148.00	
CSX CORP	84,959	32.18	2,733,980.62	

DELTA AIR LINES INC	8,345	48.72	406,568.40	
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,467	123.39	797,963.13	
FEDEX CORP	10,298	246.43	2,537,736.14	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	77,000	3.60	277,200.00	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,750	157.26	589,725.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,140	46.76	287,106.40	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,745	219.90	2,142,925.50	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,450	172.74	1,459,653.00	
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	28.38	155,238.60	
U-HAUL HOLDING CO	3,375	60.60	204,525.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	80,980	70.06	5,673,458.80	
UNION PACIFIC CORP	26,336	222.10	5,849,225.60	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	31,497	135.65	4,272,568.05	
APTIV PLC	12,290	70.30	863,987.00	
FORD MOTOR COMPANY	177,905	11.71	2,083,267.55	
GENERAL MOTORS CORP	52,355	46.77	2,448,643.35	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	39,110	10.88	425,516.80	
TESLA INC	123,425	178.01	21,970,884.25	
DECKERS OUTDOOR CORP	1,220	1,023.75	1,248,975.00	
DR HORTON INC	12,896	142.78	1,841,290.88	
GARMIN LTD	7,025	159.53	1,120,698.25	
LENNAR CORP-CL A	10,040	155.10	1,557,204.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	4,710	306.01	1,441,307.10	
NIKE INC -CL B	52,378	93.39	4,891,581.42	
NVR INC	148	7,602.33	1,125,144.84	
PULTE GROUP INC	8,850	114.09	1,009,696.50	
AIRBNB INC-CLASS A	18,550	145.97	2,707,743.50	
BOOKING HOLDINGS INC	1,483	3,859.10	5,723,045.30	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,970	36.03	287,159.10	
CARNIVAL CORP	43,817	15.34	672,152.78	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,180	3,271.71	3,860,617.80	
DARDEN RESTAURANTS INC	4,853	148.78	722,029.34	
DOMINO'S PIZZA INC	1,375	521.41	716,938.75	
DOORDASH INC - A	11,010	112.05	1,233,670.50	
DRAFTKINGS INC-CL A	20,420	38.91	794,542.20	
EXPEDIA GROUP INC	6,032	124.61	751,647.52	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,650	210.32	2,239,908.00	
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,680	147.47	247,749.60	
LAS VEGAS SANDS CORP	16,310	43.25	705,407.50	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,673	239.45	2,555,649.85	
MCDONALD'S CORP	31,101	253.58	7,886,591.58	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	12,900	39.85	514,065.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,948	148.50	1,477,278.00	

STARBUCKS CORP	48,384	79.65	3,853,785.60	
WYNN RESORTS LTD	4,180	88.80	371,184.00	
YUM! BRANDS INC	11,394	136.79	1,558,585.26	
ALPHABET INC-CL A	254,510	176.79	44,994,822.90	
ALPHABET INC-CL C	219,630	178.37	39,175,403.10	
CHARTER COMMUNICATION-A	3,926	276.26	1,084,596.76	
COMCAST CORP-CLASS A	172,284	37.44	6,450,312.96	
ELECTRONIC ARTS INC	10,834	135.98	1,473,207.32	
FOX CORP - CLASS A	13,084	33.18	434,127.12	
FOX CORP- CLASS B	5,466	30.94	169,118.04	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,096	29.42	444,124.32	
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	10,280	72.43	744,580.40	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,420	88.75	569,775.00	
MATCH GROUP INC	10,912	31.55	344,273.60	
META PLATFORMS INC-CLASS A	94,530	504.16	47,658,244.80	
NETFLIX INC	18,680	669.38	12,504,018.40	
NEWS CORP - CLASS A	14,750	27.08	399,430.00	
OMNICOM GROUP	9,397	88.41	830,788.77	
PARAMOUNT GLOBAL	22,823	10.17	232,109.91	
PINTEREST INC- CLASS A	27,330	43.51	1,189,128.30	
ROBLOX CORP -CLASS A	19,130	35.10	671,463.00	
ROKU INC	6,620	54.51	360,856.20	
SEA LTD-ADR	16,470	74.42	1,225,697.40	
SNAP INC - A	45,300	15.59	706,227.00	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	7,240	158.96	1,150,870.40	
THE WALT DISNEY CO.	78,612	99.97	7,858,841.64	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	19,370	95.66	1,852,934.20	
WARNER BROS DISCOVERY INC	94,890	7.24	687,003.60	
AMAZON.COM INC	402,810	183.66	73,980,084.60	
AUTOZONE INC	722	2,835.82	2,047,462.04	
BATH & BODY WORKS INC	9,270	43.26	401,020.20	
BEST BUY CO INC	7,814	87.21	681,458.94	
BURLINGTON STORES INC	2,585	228.02	589,431.70	
CARMAX INC	8,089	69.91	565,501.99	
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,270	216.28	490,955.60	
EBAY INC	21,897	52.13	1,141,490.61	
ETSY INC	4,800	58.87	282,576.00	
GENUINE PARTS CO	5,751	136.70	786,161.70	
GLOBAL-E ONLINE LTD	5,190	32.00	166,080.00	
HOME DEPOT INC	42,705	346.84	14,811,802.20	
LKQ CORP	10,260	40.29	413,375.40	
LOWE'S COS INC	24,602	223.35	5,494,856.70	
MERCADOLIBRE INC	1,960	1,582.14	3,100,994.40	

O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,420	1,007.31	2,437,690.20	
POOL CORP	1,540	341.31	525,617.40	
ROSS STORES INC	13,762	145.93	2,008,288.66	
TJX COMPANIES INC	48,976	108.50	5,313,896.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,530	280.25	1,269,532.50	
ULTA BEAUTY INC	2,100	390.82	820,722.00	
WILLIAMS-SONOMA INC	3,000	301.62	904,860.00	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	17,570	20.01	351,575.70	
COSTCO WHOLESALE CORP	19,109	855.67	16,350,998.03	
DOLLAR GENERAL CORP	9,855	125.79	1,239,660.45	
DOLLAR TREE INC	8,986	106.03	952,785.58	
KROGER CO	30,580	50.38	1,540,620.40	
SYSCO CORP	20,636	70.69	1,458,758.84	
TARGET CORP	19,870	141.16	2,804,849.20	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	30,782	15.55	478,660.10	
WALMART INC	190,236	67.02	12,749,616.72	
ALTRIA GROUP INC	76,018	44.32	3,369,117.76	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,143	59.50	1,317,508.50	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	10,590	43.66	462,359.40	
BUNGE GLOBAL SA	5,847	102.83	601,247.01	
CAMPBELL SOUP CO	7,885	43.99	346,861.15	
CELSIUS HOLDINGS INC	6,050	59.96	362,758.00	
COCA-COLA CO/THE	176,562	62.55	11,043,953.10	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	10,150	74.05	751,607.50	
CONAGRA BRANDS INC	20,640	28.34	584,937.60	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,870	253.50	1,741,545.00	
GENERAL MILLS INC	25,189	65.50	1,649,879.50	
HERSHEY CO/THE	6,245	186.98	1,167,690.10	
HORMEL FOODS CORP	15,290	30.48	466,039.20	
JM SMUCKER CO/THE	4,100	111.58	457,478.00	
KELLANOVA	11,098	57.52	638,356.96	
KEURIG DR PEPPER INC	46,480	34.04	1,582,179.20	
KRAFT HEINZ CO/THE	38,121	32.38	1,234,357.98	
LAMB WESTON HOLDING INC	6,150	86.76	533,574.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,420	67.79	706,371.80	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,570	49.53	374,942.10	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	57,955	65.85	3,816,336.75	
MONSTER BEVERAGE CORP	31,880	48.03	1,531,196.40	
PEPSICO INC	59,261	163.81	9,707,544.41	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	67,028	102.20	6,850,261.60	
TYSON FOODS INC-CL A	12,336	53.97	665,773.92	
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,310	107.70	1,110,387.00	
CLOROX COMPANY	5,266	133.70	704,064.20	

COLGATE-PALMOLIVE CO	33,160	94.62	3,137,599.20	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	10,080	113.90	1,148,112.00	
KENVUE INC	89,200	18.07	1,611,844.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	14,753	139.49	2,057,895.97	
PROCTER & GAMBLE CO	101,419	166.79	16,915,675.01	
ABBOTT LABORATORIES	74,446	103.68	7,718,561.28	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,060	256.01	783,390.60	
BAXTER INTERNATIONAL INC	23,599	33.78	797,174.22	
BECTON DICKINSON AND CO	12,277	233.73	2,869,503.21	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	63,568	76.76	4,879,479.68	
CARDINAL HEALTH INC	10,305	100.20	1,032,561.00	
CENCORA INC	8,304	232.53	1,930,929.12	
CENTENE CORP	22,367	68.93	1,541,757.31	
CIGNA GROUP/THE	12,530	333.29	4,176,123.70	
COOPER COS INC/THE	8,100	93.47	757,107.00	
CVS HEALTH CORP	54,808	60.22	3,300,537.76	
DAVITA INC	2,108	141.16	297,565.28	
DEXCOM INC	16,520	115.95	1,915,494.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	26,110	87.29	2,279,141.90	
ELEVANCE HEALTH INC	9,996	534.81	5,345,960.76	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	19,125	76.49	1,462,871.25	
HCA HEALTHCARE INC	8,190	337.47	2,763,879.30	
HENRY SCHEIN INC	5,280	65.80	347,424.00	
HOLOGIC INC	9,858	71.79	707,705.82	
HUMANA INC	5,055	358.93	1,814,391.15	
IDEXX LABORATORIES INC	3,360	504.00	1,693,440.00	
INSULET CORP	2,745	200.45	550,235.25	
INTUITIVE SURGICAL INC	15,315	425.78	6,520,820.70	
LABCORP HOLDINGS INC	4,005	199.88	800,519.40	
MCKESSON CORP	5,929	589.95	3,497,813.55	
MEDTRONIC PLC	57,428	81.04	4,653,965.12	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,655	307.04	815,191.20	
QUEST DIAGNOSTICS	5,276	137.85	727,296.60	
RESMED INC	6,510	211.73	1,378,362.30	
SOLVENTUM CORP	5,894	54.56	321,576.64	
STERIS PLC	4,240	218.29	925,549.60	
STRYKER CORP	14,793	344.98	5,103,289.14	
TELEFLEX INC	1,820	208.29	379,087.80	
UNITEDHEALTH GROUP INC	39,800	497.12	19,785,376.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,720	187.85	510,952.00	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	6,870	184.70	1,268,889.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,412	107.19	901,682.28	
ABBVIE INC	76,316	168.59	12,866,114.44	

AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,750	129.85	1,655,587.50	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,140	160.39	984,794.60	
AMGEN INC	23,131	298.62	6,907,379.22	
AVANTOR INC	27,110	21.68	587,744.80	
BIO-RAD LABORATORIES-A	950	282.26	268,147.00	
BIO-TECHNE CORP	6,730	75.87	510,605.10	
BIOGEN INC	5,903	231.69	1,367,666.07	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,380	83.51	699,813.80	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	87,225	41.20	3,593,670.00	
CATALENT INC	7,860	55.48	436,072.80	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,420	209.47	506,917.40	
DANAHER CORP	30,359	254.85	7,736,991.15	
ELI LILLY & CO	34,789	878.45	30,560,397.05	
EXACT SCIENCES CORP	7,370	41.88	308,655.60	
GILEAD SCIENCES INC	54,044	65.06	3,516,102.64	
ILLUMINA INC	6,855	108.66	744,864.30	
INCYTE CORP	7,670	62.11	476,383.70	
IQVIA HOLDINGS INC	7,438	212.75	1,582,434.50	
JOHNSON & JOHNSON	103,821	145.54	15,110,108.34	
MERCK & CO. INC.	109,133	129.48	14,130,540.84	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	890	1,454.74	1,294,718.60	
MODERNA INC	14,425	140.03	2,019,932.75	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,630	135.45	491,683.50	
PFIZER INC	242,220	27.53	6,668,316.60	
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,670	1,036.52	4,840,548.40	
REPLIGEN CORP	2,250	125.62	282,645.00	
REVVITY INC	4,910	108.65	533,471.50	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,800	26.92	506,096.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	49,020	17.16	841,183.20	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	16,504	572.05	9,441,113.20	
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,900	288.06	547,314.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,075	480.73	5,324,084.75	
VIATRIS INC	53,899	10.17	548,152.83	
WATERS CORP	2,661	294.94	784,835.34	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,550	333.25	1,183,037.50	
ZOETIS INC	19,455	170.55	3,318,050.25	
BANK OF AMERICA CORP	306,079	39.24	12,010,539.96	
CITIGROUP INC	82,797	59.33	4,912,346.01	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,310	34.07	657,891.70	
FIFTH THIRD BANCORP	29,319	35.22	1,032,615.18	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	450	1,631.83	734,323.50	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	68,620	12.37	848,829.40	
JPMORGAN CHASE & CO	123,780	193.78	23,986,088.40	

KEYCORP	36,108	13.36	482,402.88	
M & T BANK CORP	6,913	142.18	982,890.34	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	17,950	151.09	2,712,065.50	
REGIONS FINANCIAL CORP	40,884	18.65	762,486.60	
TRUIST FINANCIAL CORP	55,680	35.41	1,971,628.80	
US BANCORP	64,141	38.83	2,490,595.03	
WELLS FARGO & CO	155,150	57.40	8,905,610.00	
ALLY FINANCIAL INC	12,240	38.78	474,667.20	
AMERICAN EXPRESS CO	24,794	224.82	5,574,187.08	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,225	423.86	1,790,808.50	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	16,940	115.87	1,962,837.80	
ARES MANAGEMENT CORP-A	7,150	132.63	948,304.50	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	32,742	58.02	1,899,690.84	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	56,445	405.54	22,890,705.30	
BLACKROCK INC	6,440	769.33	4,954,485.20	
BLACKSTONE INC	30,570	121.25	3,706,612.50	
BLOCK INC	23,390	62.15	1,453,688.50	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,385	133.70	2,324,374.50	
CARLYLE GROUP INC/THE	7,650	39.05	298,732.50	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,570	167.60	765,932.00	
CME GROUP INC	15,350	197.13	3,025,945.50	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	8,570	244.50	2,095,365.00	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	12,150	28.35	344,452.50	
CORPAY INC	2,880	249.66	719,020.80	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,750	122.00	1,311,500.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,420	39.68	572,185.60	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,590	401.74	638,766.60	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	24,198	76.57	1,852,840.86	
FISERV INC	25,654	148.94	3,820,906.76	
FRANKLIN RESOURCES INC	11,755	21.83	256,611.65	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	71.06	177,650.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	10,989	94.17	1,034,834.13	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,993	446.46	6,247,314.78	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	24,410	135.67	3,311,704.70	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,200	161.57	517,024.00	
KKR & CO INC -A	27,920	109.18	3,048,305.60	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,185	277.17	882,786.45	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,545	200.22	309,339.90	
MASTERCARD INC - A	35,870	444.63	15,948,878.10	
MOODY'S CORP	7,072	408.12	2,886,224.64	
MORGAN STANLEY	52,433	95.50	5,007,351.50	
MSCI INC	3,175	480.53	1,525,682.75	
NASDAQ INC	15,895	58.60	931,447.00	

NORTHERN TRUST CORP	9,930	81.65	810,784.50	
PAYPAL HOLDINGS INC	42,267	60.63	2,562,859.54	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,470	115.67	979,724.90	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	17,810	22.42	399,300.20	
S&P GLOBAL INC	13,770	434.40	5,981,688.00	
SCHWAB (CHARLES) CORP	65,193	73.25	4,775,387.25	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,375	64.43	281,881.25	
STATE STREET CORP	12,947	70.91	918,071.77	
SYNCHRONY FINANCIAL	19,010	41.69	792,526.90	
T ROWE PRICE GROUP INC	10,315	114.90	1,185,193.50	
TOAST INC-CLASS A	18,170	22.72	412,822.40	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,200	104.31	438,102.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	68,142	270.66	18,443,313.72	
AFLAC INC	23,424	87.04	2,038,824.96	
ALLSTATE CORP	11,073	157.07	1,739,236.11	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,660	124.14	330,212.40	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	30,345	73.42	2,227,929.90	
AON PLC	8,567	295.39	2,530,606.13	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	16,205	97.26	1,576,098.30	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,970	258.24	2,316,412.80	
ASSURANT INC	2,470	165.54	408,883.80	
BROWN & BROWN INC	10,940	90.08	985,475.20	
CHUBB LTD	17,375	259.46	4,508,117.50	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,350	112.27	825,184.50	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,090	349.82	381,303.80	
EVEREST GROUP LTD	1,989	367.56	731,076.84	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	11,071	48.28	534,507.88	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,382	99.47	1,231,637.54	
LOEWS CORP	9,765	73.79	720,559.35	
MARKEL GROUP INC	530	1,544.07	818,357.10	
MARSH & MCLENNAN COS	21,118	208.88	4,411,127.84	
METLIFE INC	26,335	68.55	1,805,264.25	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,520	76.66	729,803.20	
PROGRESSIVE CORP	25,310	203.92	5,161,215.20	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,962	113.11	1,692,351.82	
TRAVELERS COS INC/THE	10,189	205.85	2,097,405.65	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,198	255.28	1,071,665.44	
WR BERKLEY CORP	8,091	78.15	632,311.65	
ACCENTURE PLC-CL A	27,133	286.71	7,779,302.43	
ADOBE INC	19,299	525.31	10,137,957.69	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,030	89.09	537,212.70	
ANSYS INC	3,515	323.17	1,135,942.55	
APPLOVIN CORP-CLASS A	7,930	77.52	614,733.60	

ASPEN TECHNOLOGY INC	1,300	197.66	256,958.00	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	6,850	160.09	1,096,616.50	
AUTODESK INC	8,720	225.87	1,969,586.40	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	9,480	50.19	475,801.20	
CADENCE DESIGN SYS INC	11,820	312.10	3,689,022.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,840	156.49	600,921.60	
CLOUDFLARE INC-CLASS A	13,050	75.59	986,449.50	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	21,758	64.26	1,398,169.08	
CONFLUENT INC-CLASS A	6,870	27.77	190,779.90	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,810	385.43	3,781,117.35	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,650	252.33	416,344.50	
DATADOG INC-CLASS A	10,880	117.84	1,282,099.20	
DOCUSIGN INC	8,320	50.84	422,988.80	
DYNATRACE INC	12,980	45.91	595,911.80	
EPAM SYSTEMS INC	2,500	177.58	443,950.00	
FAIR ISAAC CORP	1,120	1,390.59	1,557,460.80	
FORTINET INC	28,035	60.78	1,703,967.30	
GARTNER INC	3,490	432.21	1,508,412.90	
GEN DIGITAL INC	24,365	24.39	594,262.35	
GODADDY INC-CLASS A	6,020	137.53	827,930.60	
HUBSPOT INC	1,885	584.71	1,102,178.35	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	39,582	169.21	6,697,670.22	
INTUIT INC	12,086	595.70	7,199,630.20	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	3,220	228.84	736,864.80	
MICROSOFT CORP	303,654	442.57	134,388,150.78	
MICROSTRATEGY INC-CL A	670	1,495.54	1,002,011.80	
MONDAY.COM LTD	1,970	226.58	446,362.60	
MONGODB INC	2,990	227.00	678,730.00	
OKTA INC	7,610	89.76	683,073.60	
ORACLE CORP	71,153	138.13	9,828,363.89	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	80,660	23.57	1,901,156.20	
PALO ALTO NETWORKS INC	13,985	317.31	4,437,580.35	
PTC INC	5,250	173.50	910,875.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,460	549.45	2,450,547.00	
SALESFORCE INC	41,826	231.94	9,701,122.44	
SAMSARA INC-CL A	8,370	28.07	234,945.90	
SERVICENOW INC	8,855	728.58	6,451,575.90	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	13,900	127.17	1,767,663.00	
SYNOPSYS INC	6,607	590.21	3,899,517.47	
TWILIO INC - A	7,225	54.24	391,884.00	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,830	471.79	863,375.70	
UIPATH INC - CLASS A	17,970	11.54	207,373.80	
UNITY SOFTWARE INC	9,650	16.40	158,260.00	

VERISIGN INC	4,530	180.31	816,804.30	
WIX.COM LTD	2,280	163.61	373,030.80	
WORKDAY INC-CLASS A	8,580	209.48	1,797,338.40	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	12,150	57.74	701,541.00	
ZSCALER INC	3,630	184.22	668,718.60	
AMPHENOL CORP-CL A	52,140	68.27	3,559,597.80	
APPLE INC	631,054	212.49	134,092,664.46	
ARISTA NETWORKS INC	11,520	328.50	3,784,320.00	
CDW CORP/DE	5,895	223.19	1,315,705.05	
CISCO SYSTEMS INC	174,210	45.68	7,957,912.80	
CORNING INC	33,518	37.25	1,248,545.50	
DELL TECHNOLOGIES -C	11,022	134.98	1,487,749.56	
F5 INC	2,385	167.58	399,678.30	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	50,105	21.60	1,082,268.00	
HP INC	40,345	35.51	1,432,650.95	
JABIL INC	5,590	119.48	667,893.20	
JUNIPER NETWORKS INC	13,453	35.46	477,043.38	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,160	135.98	973,616.80	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,880	375.41	2,582,820.80	
NETAPP INC	8,246	126.17	1,040,397.82	
PURE STORAGE INC - CLASS A	13,200	67.68	893,376.00	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	9,754	103.86	1,013,050.44	
SUPER MICRO COMPUTER INC	2,140	844.54	1,807,315.60	
TE CONNECTIVITY LTD	12,995	147.35	1,914,813.25	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,020	389.60	786,992.00	
TRIMBLE INC	11,410	54.81	625,382.10	
WESTERN DIGITAL CORP	14,028	78.12	1,095,867.36	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,075	301.37	625,342.75	
AT&T INC	309,067	17.64	5,451,941.88	
T-MOBILE US INC	23,119	175.99	4,068,712.81	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	181,457	39.67	7,198,399.19	
AES CORP	27,958	19.34	540,707.72	
ALLIANT ENERGY CORP	12,150	49.84	605,556.00	
AMEREN CORPORATION	12,892	70.12	903,987.04	
AMERICAN ELECTRIC POWER	22,348	88.00	1,966,624.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,705	129.30	996,256.50	
ATMOS ENERGY CORP	6,760	116.15	785,174.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,272	30.85	964,741.20	
CMS ENERGY CORP	11,090	59.65	661,518.50	
CONSOLIDATED EDISON INC	14,236	90.87	1,293,625.32	
CONSTELLATION ENERGY	13,168	214.90	2,829,803.20	
DOMINION ENERGY INC	36,341	50.43	1,832,676.63	
DTE ENERGY COMPANY	8,318	112.14	932,780.52	

DUKE ENERGY CORP	33,076	102.36	3,385,659.36	
EDISON INTERNATIONAL	16,329	73.21	1,195,446.09	
ENTERGY CORP	9,247	107.02	989,613.94	
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,210	37.13	416,227.30	
EVERGY INC	8,720	52.74	459,892.80	
EVERSOURCE ENERGY	14,310	59.01	844,433.10	
EXELON CORP	43,056	35.54	1,530,210.24	
FIRSTENERGY CORP	23,295	38.77	903,147.15	
NEXTERA ENERGY INC	88,600	73.06	6,473,116.00	
NISOURCE INC	23,010	28.17	648,191.70	
NRG ENERGY INC	9,770	78.64	768,312.80	
P G & E CORP	85,070	18.25	1,552,527.50	
PPL CORP	30,338	28.08	851,891.04	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	22,058	72.64	1,602,293.12	
SEMPRA	27,094	75.97	2,058,331.18	
SOUTHERN CO	46,765	78.65	3,678,067.25	
VISTRA CORP	14,720	87.59	1,289,324.80	
WEC ENERGY GROUP INC	14,270	78.86	1,125,332.20	
XCEL ENERGY INC	22,174	53.77	1,192,295.98	
ADVANCED MICRO DEVICES	69,664	159.63	11,120,464.32	
ANALOG DEVICES INC	21,327	231.19	4,930,589.13	
APPLIED MATERIALS INC	35,633	237.03	8,446,089.99	
BROADCOM INC	18,940	1,735.04	32,861,657.60	
ENPHASE ENERGY INC	6,430	124.61	801,242.30	
ENTEGRIS INC	6,650	133.90	890,435.00	
FIRST SOLAR INC	4,260	273.61	1,165,578.60	
INTEL CORP	183,932	30.45	5,600,729.40	
KLA CORP	5,789	824.84	4,774,998.76	
LAM RESEARCH CORP	5,622	1,035.98	5,824,279.56	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	6,540	60.22	393,838.80	
MARVELL TECHNOLOGY INC	36,844	73.27	2,699,559.88	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	23,418	91.35	2,139,234.30	
MICRON TECHNOLOGY INC	47,387	141.36	6,698,626.32	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,070	806.57	1,669,599.90	
NVIDIA CORP	1,075,440	131.88	141,829,027.20	
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,887	268.85	2,926,969.95	
ON SEMICONDUCTOR CORP	18,380	71.97	1,322,808.60	
QORVO INC	4,240	112.38	476,491.20	
QUALCOMM INC	47,912	215.33	10,316,890.96	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,440	104.37	672,142.80	
TERADYNE INC	6,190	145.06	897,921.40	
TEXAS INSTRUMENTS INC	39,272	193.90	7,614,840.80	
CBRE GROUP INC - A	12,560	86.90	1,091,464.00	

	COSTAR GROUP INC	16,800	73.93	1,242,024.00	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,500	3.22	130,410.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	6,370	48.00	305,760.00	
米ドル小計		15,605,177		2,005,641,329.87 (315,948,678,694)	
加ドル	ARC RESOURCES LTD	25,510	23.95	610,964.50	
	CAMECO CORP	19,282	71.29	1,374,613.78	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	91,808	46.62	4,280,088.96	
	CENOVUS ENERGY INC	57,213	25.06	1,433,757.78	
	ENBRIDGE INC	91,207	48.25	4,400,737.75	
	IMPERIAL OIL LTD	8,922	88.11	786,117.42	
	KEYERA CORP	8,460	36.59	309,551.40	
	MEG ENERGY CORP	11,500	27.71	318,665.00	
	PARKLAND CORP	6,170	38.71	238,840.70	
	PEMBINA PIPELINE CORP	23,552	50.92	1,199,267.84	
	SUNCOR ENERGY INC	53,489	50.26	2,688,357.14	
	TC ENERGY CORP	45,033	53.25	2,398,007.25	
	TOURMALINE OIL CORP	15,980	63.13	1,008,817.40	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	21,496	88.27	1,897,451.92	
	BARRICK GOLD CORP	69,624	22.01	1,532,424.24	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	72.68	417,910.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	16.49	373,498.50	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,125	159.49	1,295,856.25	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	24,510	17.48	428,434.80	
	KINROSS GOLD CORP	55,925	10.19	569,875.75	
	LUNDIN MINING CORP	25,010	14.70	367,647.00	
	NUTRIEN LTD	20,908	70.32	1,470,250.56	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	16,410	27.31	448,157.10	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	21,725	65.61	1,425,377.25	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,450	109.73	268,838.50	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,165	72.70	1,393,295.50	
	CAE INC	12,305	24.77	304,794.85	
	STANTEC INC	5,720	113.27	647,904.40	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,260	117.56	383,245.60	
	WSP GLOBAL INC	5,800	206.84	1,199,672.00	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	13,800	24.21	334,098.00	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	11,710	52.12	610,325.20	
	RB GLOBAL INC	7,560	109.75	829,710.00	
	THOMSON REUTERS CORP	7,350	229.65	1,687,927.50	
	AIR CANADA	7,190	17.16	123,380.40	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	23,418	167.29	3,917,597.22	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	39,281	105.62	4,148,859.22	
	TFI INTERNATIONAL INC	3,210	188.90	606,369.00	

MAGNA INTERNATIONAL INC	10,668	57.97	618,423.96	
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,570	84.73	133,026.10	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,040	51.62	363,404.80	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	12,858	94.65	1,217,009.70	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,250	135.15	304,087.50	
DOLLARAMA INC	12,990	123.85	1,608,811.50	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	32,350	75.90	2,455,365.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	32.11	223,164.50	
LOBLAW COMPANIES LTD	6,339	156.35	991,102.65	
METRO INC	9,570	73.99	708,084.30	
WESTON (GEORGE) LTD	2,808	189.32	531,610.56	
SAPUTO INC	9,620	29.37	282,539.40	
BANK OF MONTREAL	30,681	114.86	3,524,019.66	
BANK OF NOVA SCOTIA	52,339	63.70	3,333,994.30	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	42,300	65.31	2,762,613.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	13,750	106.43	1,463,412.50	
ROYAL BANK OF CANADA	60,139	142.87	8,592,058.93	
TORONTO-DOMINION BANK	76,520	74.53	5,703,035.60	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	13,859	52.22	723,716.98	
BROOKFIELD CORP	57,209	56.24	3,217,434.16	
IGM FINANCIAL INC	3,335	36.88	122,994.80	
ONEX CORPORATION	2,765	94.31	260,767.15	
TMX GROUP LTD	10,850	37.14	402,969.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	1,526.56	1,373,904.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	11,324	39.21	444,014.04	
IA FINANCIAL CORP INC	4,075	85.18	347,108.50	
INTACT FINANCIAL CORP	7,215	222.40	1,604,616.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	76,211	34.50	2,629,279.50	
POWER CORP OF CANADA	27,929	38.45	1,073,870.05	
SUN LIFE FINANCIAL INC	24,774	65.34	1,618,733.16	
CGI INC	9,510	136.86	1,301,538.60	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	870	3,800.00	3,306,000.00	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,740	129.20	483,208.00	
OPEN TEXT CORP	11,190	39.51	442,116.90	
SHOPIFY INC - CLASS-A	50,580	92.94	4,700,905.20	
BCE INC	3,000	45.18	135,540.00	
QUEBECOR INC -CL B	6,110	29.12	177,923.20	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	16,655	51.93	864,894.15	
TELUS CORP	12,662	21.72	275,018.64	
ALTAGAS LTD	11,170	30.47	340,349.90	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	41.30	224,878.50	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	30.46	138,897.60	
EMERA INC	10,460	45.81	479,172.60	

	FORTIS INC	22,635	53.69	1,215,273.15	
	HYDRO ONE LTD	13,230	39.42	521,526.60	
	NORTHLAND POWER INC	8,600	23.88	205,368.00	
	FIRSTSERVICE CORP	1,500	209.38	314,070.00	
加ドル小計		1,735,583		111,492,540.02 (12,787,079,414)	
ユーロ	ENI SPA	100,696	13.50	1,360,201.56	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	18,755	18.72	351,187.37	
	NESTE OYJ	18,710	17.79	332,850.90	
	OMV AG	5,480	39.06	214,048.80	
	REPSOL SA	54,849	14.30	784,614.94	
	TENARIS SA	23,455	14.31	335,758.32	
	TOTALENERGIES SE	92,297	61.42	5,668,881.74	
	AIR LIQUIDE SA	24,704	159.28	3,934,853.12	
	AKZO NOBEL	6,937	58.10	403,039.70	
	ARCELORMITTAL	20,552	21.82	448,444.64	
	ARKEMA	2,215	83.70	185,395.50	
	BASF SE	37,045	44.58	1,651,651.32	
	COVESTRO AG	7,410	50.24	372,278.40	
	DSM-FIRMENICH AG	7,552	99.24	749,460.48	
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,230	18.24	296,035.20	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	5,715	95.26	544,410.90	
	OCI NV	4,810	23.23	111,736.30	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	13,250	42.14	558,355.00	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	25,365	12.38	314,145.52	
	SYENSQO SA	2,811	88.33	248,295.63	
	SYMRISE AG	5,790	112.40	650,796.00	
	UMICORE	7,960	13.63	108,494.80	
	UPM-KYMMENE OYJ	25,098	32.69	820,453.62	
	VOESTALPINE AG	4,249	24.62	104,610.38	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,876	39.22	308,896.72	
	AIRBUS GROUP SE	25,708	143.82	3,697,324.56	
	ALSTOM	11,635	15.50	180,400.67	
	ALSTOM SA - RTS	11,635	1.06	12,333.10	
	BOUYGUES SA	8,460	30.80	260,568.00	
	BRENNTAG SE	6,865	65.00	446,225.00	
	COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	19,106	72.30	1,381,363.80	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	23,136	36.47	843,769.92	
	DASSAULT AVIATION SA	900	174.20	156,780.00	
	EIFFAGE	3,250	84.96	276,120.00	
	FERROVIAL SE	24,155	36.62	884,556.10	
	GEA GROUP AG	6,020	37.66	226,713.20	
	IMCD NV	2,120	136.55	289,486.00	

KINGSPAN GROUP PLC	7,300	81.05	591,665.00	
KNORR-BREMSE AG	2,970	70.40	209,088.00	
KONE OYJ-B	13,614	47.24	643,125.36	
LEGRAND SA	11,128	93.46	1,040,022.88	
LEONARDO SPA	16,300	21.18	345,234.00	
METSO CORPORATION	24,200	10.40	251,680.00	
MTU AERO ENGINES AG	2,540	224.40	569,976.00	
PRYSMIAN SPA	12,035	56.64	681,662.40	
RATIONAL AG	230	792.50	182,275.00	
REXEL SA	11,150	24.60	274,290.00	
RHEINMETALL AG	2,090	479.20	1,001,528.00	
SAFRAN SA	14,810	196.65	2,912,386.50	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	23,508	221.20	5,199,969.60	
SIEMENS AG-REG	32,826	165.74	5,440,581.24	
SIEMENS ENERGY AG	21,343	23.24	496,011.32	
THALES SA	4,925	150.30	740,227.50	
VINCI SA	20,600	98.14	2,021,684.00	
WARTSILA OYJ ABP	18,180	18.96	344,783.70	
BUREAU VERITAS SA	16,910	26.66	450,820.60	
RANDSTAD NV	4,675	45.42	212,338.50	
TELEPERFORMANCE	2,240	93.30	208,992.00	
WOLTERS KLUWER	10,027	152.70	1,531,122.90	
ADP	1,630	112.80	183,864.00	
AENA SA	3,750	184.60	692,250.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	5.89	140,796.48	
DEUTSCHE POST AG-REG	39,823	37.75	1,503,318.25	
GETLINK	17,310	15.53	268,910.85	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,355	86.90	1,160,549.50	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,150	81.40	256,410.00	
CONTINENTAL AG	4,385	55.00	241,175.00	
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	4,380	70.62	309,315.60	
FERRARI NV	5,459	379.70	2,072,782.30	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	34,202	63.20	2,161,566.40	
MICHELIN (CGDE)	30,986	36.90	1,143,383.40	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	42.46	240,748.20	
RENAULT SA	8,247	48.14	397,010.58	
STELLANTIS NV	90,796	18.82	1,708,780.72	
VOLKSWAGEN AG	1,151	112.40	129,372.40	
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,083	104.50	949,173.50	
ADIDAS AG	6,571	224.90	1,477,817.90	
HERMES INTERNATIONAL	1,342	2,112.00	2,834,304.00	
KERING	3,007	302.50	909,617.50	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	11,894	711.40	8,461,391.60	

MONCLER SPA	10,320	58.64	605,164.80	
PUMA SE	4,200	45.06	189,252.00	
SEB SA	987	102.80	101,463.60	
ACCOR SA	10,106	37.03	374,225.18	
AMADEUS IT GROUP SA	21,100	64.20	1,354,620.00	
DELIVERY HERO SE	6,600	27.84	183,744.00	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	31.00	120,900.00	
SODEXO SA	3,240	84.00	272,160.00	
BOLLORE SE	33,530	5.74	192,462.20	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	2,660	79.30	210,938.00	
PUBLICIS GROUPE	9,305	97.76	909,656.80	
SCOUT24 SE	2,970	70.40	209,088.00	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	36,410	28.63	1,042,418.30	
VIVENDI SE	26,070	9.50	247,665.00	
D'IETEREN GROUP	1,050	190.00	199,500.00	
INDITEX	45,895	45.96	2,109,334.20	
PROSUS NV	62,794	33.91	2,129,658.51	
ZALANDO SE	8,260	22.15	182,959.00	
CARREFOUR SA	22,633	14.40	326,028.36	
JERONIMO MARTINS	10,585	19.62	207,677.70	
KESKO OYJ-B SHS	10,930	16.44	179,743.85	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	40,028	28.08	1,123,986.24	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	36,121	55.46	2,003,270.66	
DANONE	25,794	58.80	1,516,687.20	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	30,650	9.62	294,853.00	
HEINEKEN HOLDING NV	4,895	76.55	374,712.25	
HEINEKEN NV	12,733	94.84	1,207,597.72	
JDE PEET'S NV	6,290	19.57	123,095.30	
KERRY GROUP PLC-A	6,460	75.30	486,438.00	
LOTUS BAKERIES	20	9,990.00	199,800.00	
PERNOD-RICARD SA	8,296	131.90	1,094,242.40	
REMY COINTREAU	810	80.10	64,881.00	
BEIERSDORF AG	4,375	146.45	640,718.75	
HENKEL AG & CO KGAA	4,520	73.65	332,898.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,793	83.06	564,226.58	
L'OREAL	10,296	440.45	4,534,873.20	
AMPLIFON SPA	4,830	34.64	167,311.20	
BIOMERIEUX	1,690	90.80	153,452.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	84.35	135,803.50	
DIASORIN ITALIA SPA	930	97.98	91,121.40	
ESSILORLUXOTTICA	12,675	201.00	2,547,675.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	9,583	38.63	370,191.29	
FRESENIUS SE & CO KGAA	20,905	29.56	617,951.80	

KONINKLIJKE PHILIPS NV	38,028	24.11	916,855.08	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	13,430	53.64	720,385.20	
ARGENX SE	2,495	360.90	900,445.50	
BAYER AG-REG	43,824	27.06	1,186,096.56	
EUROFINS SCIENTIFIC	5,050	52.12	263,206.00	
IPSEN	1,600	120.50	192,800.00	
MERCK KGAA	5,940	172.00	1,021,680.00	
ORION OYJ-CLASS B	4,500	37.58	169,110.00	
QIAGEN N.V.	10,072	39.70	399,858.40	
RECORDATI SPA	3,720	48.10	178,932.00	
SANOFI	49,226	86.43	4,254,603.18	
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,230	245.70	302,211.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	178.75	193,050.00	
UCB SA	5,398	137.85	744,114.30	
ABN AMRO BANK NV-CVA	23,550	15.24	359,019.75	
AIB GROUP PLC	70,100	4.78	335,498.60	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	241,763	9.02	2,180,702.26	
BANCO BPM SPA	49,000	5.88	288,120.00	
BANCO DE SABADELL SA	232,000	1.74	404,144.00	
BANCO SANTANDER SA	694,189	4.37	3,039,506.53	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	44,790	9.72	435,358.80	
BNP PARIBAS	44,242	58.41	2,584,175.22	
CAIXABANK S.A	163,050	4.87	794,868.75	
COMMERZBANK AG	40,474	13.76	557,124.61	
CREDIT AGRICOLE SA	49,662	13.03	647,344.17	
ERSTE GROUP BANK AG	15,328	42.02	644,082.56	
FINECOBANK SPA	23,540	13.98	329,206.90	
ING GROEP NV-CVA	146,925	15.33	2,252,654.10	
INTESA SANPAOLO	621,793	3.33	2,070,570.69	
KBC GROEP NV	11,219	64.16	719,811.04	
MEDIOBANCA SPA	19,520	13.52	264,008.00	
NORDEA BANK ABP	131,132	11.30	1,481,791.60	
SOCIETE GENERALE	30,909	22.15	684,634.35	
UNICREDIT SPA	64,276	32.53	2,091,219.66	
ADYEN NV	935	1,197.60	1,119,756.00	
AMUNDI SA	2,140	60.25	128,935.00	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	80,935	14.41	1,166,597.09	
DEUTSCHE BOERSE AG	8,250	182.25	1,503,562.50	
EDENRED	9,626	40.54	390,238.04	
EURAZEO SE	1,487	71.95	106,989.65	
EURONEXT NV	3,470	89.30	309,871.00	
EXOR NV	4,164	96.85	403,283.40	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,452	66.75	230,421.00	

NEXI SPA	21,240	5.65	120,175.92	
SOFINA	655	215.40	141,087.00	
AEGON LTD	69,679	5.67	395,637.36	
AGEAS	5,924	42.20	249,992.80	
ALLIANZ SE-REG	16,933	253.40	4,290,822.20	
ASR NEDERLAND NV	5,880	43.55	256,074.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	42,248	22.59	954,382.32	
AXA SA	75,752	29.43	2,229,381.36	
HANNOVER RUECK SE-REG	2,775	226.60	628,815.00	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,626	456.80	2,569,956.80	
NN GROUP NV	10,270	41.34	424,561.80	
POSTE ITALIANE SPA	19,560	12.17	238,143.00	
SAMPO OYJ-A SHS	19,639	39.29	771,616.31	
TALANX AG	2,500	71.60	179,000.00	
BECHTLE AG	3,070	44.46	136,492.20	
CAP GEMINI SA	6,509	182.30	1,186,590.70	
DASSAULT SYSTEMES SE	27,400	35.71	978,454.00	
NEMETSCHEK SE	2,350	90.70	213,145.00	
SAP SE	45,052	174.78	7,874,188.56	
NOKIA OYJ	251,336	3.38	851,275.03	
CELLNEX TELECOM SA	24,690	32.39	799,709.10	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	138,256	22.63	3,128,733.28	
ELISA OYJ	6,005	42.62	255,933.10	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	9.78	148,362.60	
KONINKLIJKE KPN NV	204,956	3.49	716,526.17	
ORANGE S.A.	83,604	9.29	776,848.36	
TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.22	89,634.80	
TELEFONICA SA	195,629	4.11	804,035.19	
ACCIONA SA	830	115.60	95,948.00	
E.ON SE	90,999	12.43	1,131,117.57	
EDP RENOVAVEIS SA	11,333	13.76	155,942.08	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	126,131	3.67	463,026.90	
ELIA GROUP SA/NV	1,356	90.30	122,446.80	
ENDESA SA	12,050	18.62	224,371.00	
ENEL SPA	344,237	6.33	2,181,429.86	
ENGIE	82,214	13.27	1,090,979.78	
FORTUM OYJ	16,755	14.20	237,921.00	
IBERDROLA SA	263,272	12.12	3,192,173.00	
REDEIA CORP SA	20,650	17.06	352,289.00	
RWE AG	25,835	33.16	856,688.60	
SNAM SPA	91,120	4.28	390,358.08	
TERNA SPA	71,827	7.49	538,127.88	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	31,150	27.92	869,708.00	

	VERBUND AG	2,780	73.55	204,469.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	2,105	675.80	1,422,559.00	
	ASML HOLDING NV	17,202	953.00	16,393,506.00	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	3,290	153.60	505,344.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	56,495	36.50	2,062,067.50	
	STMICROELECTRONICS NV	29,593	39.40	1,166,112.16	
	LEG IMMOBILIEN SE	3,010	77.20	232,372.00	
	VONOVIA SE	33,969	26.98	916,483.62	
ユーロ小計		7,919,260		217,282,843.16 (36,642,578,670)	
英ポンド	BP PLC	728,918	4.60	3,353,022.80	
	SHELL PLC-NEW	277,807	27.11	7,531,347.77	
	ANGLO AMERICAN PLC	54,004	23.88	1,289,885.54	
	ANTOFAGASTA PLC	17,080	20.41	348,602.80	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,131	41.27	253,026.37	
	ENDEAVOUR MINING PLC	6,490	16.10	104,489.00	
	GLENCORE PLC	453,603	4.54	2,061,852.43	
	MONDI PLC	16,700	14.63	244,321.00	
	RIO TINTO PLC	48,325	52.19	2,522,081.75	
	ASHTEAD GROUP PLC	20,500	54.22	1,111,510.00	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	124,235	13.35	1,658,537.25	
	BUNZL PLC	17,316	29.22	505,973.52	
	DCC PLC	3,820	55.50	212,010.00	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	63,400	6.00	380,780.40	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	353,031	4.57	1,616,175.91	
	SMITHS GROUP PLC	13,603	16.81	228,666.43	
	SPIRAX GROUP PLC	2,890	84.85	245,216.50	
	EXPERIAN PLC	37,408	37.07	1,386,714.56	
	INTERTEK GROUP PLC	6,025	47.44	285,826.00	
	RELX PLC	81,345	35.58	2,894,255.10	
	RENTOKIL INITIAL PLC	115,300	4.47	515,506.30	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	4.88	199,080.08	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,515	50.30	227,104.50	
	BURBERRY GROUP PLC	15,504	9.80	151,970.20	
	PERSIMMON PLC	12,440	14.20	176,648.00	
	TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.48	184,025.47	
	COMPASS GROUP PLC	72,268	22.17	1,602,181.56	
	ENTAIN PLC	24,860	6.56	163,081.60	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,366	138.35	1,019,086.10	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,473	81.80	611,291.40	
	PEARSON PLC	26,089	9.49	247,584.61	
	WHITBREAD PLC	8,110	29.12	236,163.20	
	AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	8.19	298,771.20	

INFORMA PLC	56,580	8.42	476,629.92	
WPP PLC	41,144	7.35	302,572.97	
JD SPORTS FASHION PLC	97,350	1.20	117,550.12	
KINGFISHER PLC	78,137	2.48	194,248.58	
NEXT PLC	5,667	90.08	510,483.36	
SAINSBURY (J) PLC	70,601	2.58	182,715.38	
TESCO PLC	288,058	3.10	893,555.91	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,125	24.83	325,893.75	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	84,677	23.92	2,025,473.84	
COCA-COLA HBC AG-CDI	11,230	26.92	302,311.60	
DIAGEO PLC	95,292	25.79	2,457,580.68	
IMPERIAL BRANDS PLC	38,792	19.99	775,646.04	
HALEON PLC	298,551	3.24	968,200.89	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	30,695	43.93	1,348,431.35	
UNILEVER PLC	106,352	44.50	4,732,664.00	
NMC HEALTH PLC	8,090	—	—	
SMITH & NEPHEW PLC	33,906	9.99	338,924.37	
ASTRAZENECA PLC	66,122	125.10	8,271,862.20	
GSK PLC	179,430	16.04	2,878,954.35	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,740	19.58	112,389.20	
BARCLAYS PLC	639,751	2.02	1,292,297.02	
HSBC HOLDINGS PLC	821,661	6.76	5,561,001.64	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,649,936	0.54	1,435,735.32	
NATWEST GROUP PLC	275,835	3.07	847,365.12	
STANDARD CHARTERED PLC	95,420	7.24	691,031.64	
3I GROUP PLC	40,649	30.40	1,235,729.60	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	10.51	136,840.20	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	20,707	94.34	1,953,498.38	
M&G PLC	99,522	2.00	199,541.61	
SCHRODERS PLC	30,300	3.70	112,352.40	
WISE PLC - A	29,200	7.13	208,342.00	
ADMIRAL GROUP PLC	12,845	25.51	327,675.95	
AVIVA PLC	134,324	4.76	639,382.24	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	294,051	2.24	660,732.59	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,230	4.80	145,285.38	
PRUDENTIAL PLC	121,002	7.00	847,014.00	
SAGE GROUP PLC/THE	49,540	10.56	523,390.10	
HALMA PLC	14,690	26.45	388,550.50	
BT GROUP PLC	267,752	1.39	373,647.91	
VODAFONE GROUP PLC	996,528	0.68	687,205.70	
CENTRICA PLC	209,200	1.32	276,144.00	
NATIONAL GRID PLC	204,765	8.82	1,806,027.30	
SEVERN TRENT PLC	13,573	24.74	335,796.02	

	SSE PLC	43,667	17.67	771,595.89	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	10.36	270,578.32	
英ポンド小計		11,571,658		82,809,638.69 (16,551,162,484)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,990	13.50	107,865.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	732.50	197,775.00	
	GIVAUDAN-REG	378	4,296.00	1,623,888.00	
	HOLCIM LTD	22,219	80.04	1,778,408.76	
	SIG GROUP AG	10,900	16.06	175,054.00	
	SIKA AG-REG	6,605	255.90	1,690,219.50	
	ABB LTD-REG	68,855	49.89	3,435,175.95	
	GEBERIT AG-REG	1,490	542.20	807,878.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,070	230.50	246,635.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	235.40	348,392.00	
	VAT GROUP AG	1,295	497.50	644,262.50	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,817	31.10	212,008.70	
	SGS SA-REG	5,950	81.80	486,710.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,810	256.50	720,765.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	23,289	143.85	3,350,122.65	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,525	185.25	282,506.25	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,950	36.60	71,370.00	
	AVOLTA AG	3,460	36.12	124,975.20	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	130	1,553.00	201,890.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	40	10,750.00	430,000.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	109,400.00	547,000.00	
	NESTLE SA-REG	115,080	95.28	10,964,822.40	
	ALCON INC	21,254	80.44	1,709,671.76	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,051	276.90	567,921.90	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,520	110.60	610,512.00	
	BACHEM HOLDING AG	1,400	79.25	110,950.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,333	480.30	1,600,839.90	
	NOVARTIS AG-REG	85,643	95.01	8,136,941.43	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,640	273.60	448,704.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	30,123	247.60	7,458,454.80	
	SANDOZ GROUP AG	21,268	31.89	678,236.52	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,510	94.60	142,846.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,420	50.60	426,052.00	
	PARTNERS GROUP HOLDIING AG	995	1,154.50	1,148,727.50	
	UBS GROUP AG-REG	142,282	26.92	3,830,231.44	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,740	155.30	270,222.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	1,320	117.90	155,628.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,285	632.20	812,377.00	
	SWISS RE AG	12,289	108.90	1,338,272.10	

	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,241	471.40	2,942,007.40	
	TEMENOS AG	2,280	59.90	136,572.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	88.38	588,610.80	
	SWISSCOM AG-REG	1,024	496.00	507,904.00	
	BKW AG	840	140.70	118,188.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,441	83.40	286,979.40	
スイスフラン小計		646,167		62,474,573.86 (11,048,003,641)	
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	10,290	339.40	3,492,426.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,520	425.80	1,498,816.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	22,680	155.05	3,516,534.00	
	ALFA LAVAL AB	15,220	464.60	7,071,212.00	
	ASSA ABLOY AB-B	42,940	302.40	12,985,056.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	111,390	200.20	22,300,278.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	67,170	172.95	11,617,051.50	
	BEIJER REF AB	15,480	164.55	2,547,234.00	
	EPIROC AB-A	31,565	211.80	6,685,467.00	
	EPIROC AB-B	15,450	192.50	2,974,125.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	88.40	1,326,000.00	
	INDUTRADE AB	10,180	272.20	2,770,996.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	296.00	2,012,800.00	
	LIFCO AB-B SHS	8,470	283.40	2,400,398.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	63,000	47.26	2,977,380.00	
	SAAB AB-B	11,120	241.00	2,679,920.00	
	SANDVIK AB	49,820	215.70	10,746,174.00	
	SKANSKA AB-B SHS	14,390	187.55	2,698,844.50	
	SKF AB-B SHARES-B	14,079	207.10	2,915,760.90	
	TRELLEBORG AB-B SHS	9,190	403.60	3,709,084.00	
	VOLVO AB-A SHS	9,530	268.80	2,561,664.00	
	VOLVO AB-B SHS-B	63,450	263.60	16,725,420.00	
	SECURITAS AB-B SHS	17,788	104.00	1,849,952.00	
	VOLVO CAR AB-B	39,400	32.20	1,268,680.00	
	EVOLUTION AB	8,150	1,056.00	8,606,400.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,848	188.60	5,252,132.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	29,035	278.60	8,089,151.00	
	GETINGE AB-B SHS	9,470	182.80	1,731,116.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	8,148	270.00	2,199,960.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	72,400	152.80	11,062,720.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60,120	100.25	6,027,030.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	34,550	214.60	7,414,430.00	
	EQT AB	14,450	312.50	4,515,625.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	355.00	1,769,320.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	353.70	2,115,126.00	

	INVESTOR AB-B SHS	69,350	283.75	19,678,062.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,590	516.50	1,854,235.00	
	ERICSSON LM-B SHS	114,915	61.78	7,099,448.70	
	HEXAGON AB-B SHS	94,990	116.50	11,066,335.00	
	TELE2 AB-B SHS	23,245	104.40	2,426,778.00	
	TELIA CO AB	118,530	26.76	3,171,862.80	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	23,220	68.54	1,591,498.80	
	SAGAX AB-B	7,910	266.40	2,107,224.00	
スウェーデンクローナ小計		1,398,807		239,109,728.50 (3,579,472,635)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	12,100	255.10	3,086,710.00	
	EQUINOR ASA	39,014	289.70	11,302,355.80	
	NORSK HYDRO A S	50,660	64.84	3,284,794.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,670	298.20	1,988,994.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,900	871.50	3,398,850.00	
	MOWI ASA	16,360	189.45	3,099,402.00	
	ORKLA ASA	32,290	90.20	2,912,558.00	
	SALMAR ASA	3,590	605.00	2,171,950.00	
	DNB BANK ASA	45,435	205.70	9,345,979.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,410	189.00	1,400,490.00	
	TELENOR ASA	23,915	122.90	2,939,153.50	
ノルウェークローネ小計		241,344		44,931,237.20 (663,634,373)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	16,690	407.40	6,799,506.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	315	2,750.00	866,250.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	41,480	182.05	7,551,434.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	115	11,120.00	1,278,800.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	195	11,400.00	2,223,000.00	
	DSV A/S	7,890	1,081.50	8,533,035.00	
	PANDORA A/S	3,310	1,052.50	3,483,775.00	
	CARLSBERG AS-B	3,910	938.20	3,668,362.00	
	COLOPLAST-B	6,475	851.60	5,514,110.00	
	DEMANT A/S	3,640	326.40	1,188,096.00	
	GENMAB A/S	2,920	1,832.50	5,350,900.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	140,550	991.00	139,285,050.00	
	DANSKE BANK A/S	31,185	202.40	6,311,844.00	
	TRYG A/S	13,945	143.10	1,995,529.50	
	ORSTED A/S	7,570	385.80	2,920,506.00	
デンマーククローネ小計		280,190		196,970,197.50 (4,451,526,463)	
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	33.10	290,452.50	
	SANTOS LTD	151,760	7.47	1,133,647.20	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	84,316	27.26	2,298,454.16	

BHP GROUP LTD	215,437	43.09	9,283,180.33	
BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	20.54	376,087.40	
FORTESCUE LTD	73,745	23.20	1,710,884.00	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	20,365	48.30	983,629.50	
MINERAL RESOURCES LTD	7,320	62.37	456,548.40	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	53,090	13.43	712,998.70	
ORICA LIMITED	17,675	18.00	318,150.00	
PILBARA MINERALS LTD	114,530	3.24	371,077.20	
RIO TINTO LTD	16,698	120.20	2,007,099.60	
SOUTH32 LTD	207,787	3.66	760,500.42	
REECE LTD	10,200	25.84	263,568.00	
SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	8,410	39.44	331,690.40	
BRAMBLES LTD	54,798	14.52	795,666.96	
COMPUTERSHARE LTD	20,910	26.47	553,487.70	
AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	3.65	268,530.50	
QANTAS AIRWAYS LTD	35,030	6.11	214,033.30	
TRANSURBAN GROUP	129,996	12.50	1,624,950.00	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,520	46.68	1,097,913.60	
LOTTERY CORP LTD/THE	85,554	5.19	444,025.26	
CAR GROUP LTD	14,500	35.07	508,515.00	
REA GROUP LTD	1,820	192.08	349,585.60	
SEEK LTD	12,860	23.06	296,551.60	
WESFARMERS LTD	47,855	67.40	3,225,427.00	
COLES GROUP LTD	57,925	16.99	984,145.75	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	50,462	5.05	254,833.10	
WOOLWORTHS GROUP LTD	54,692	32.59	1,782,412.28	
TREASURY WINE ESTATES LTD	43,206	12.06	521,064.36	
COCHLEAR LTD	2,947	323.51	953,383.97	
PRO MEDICUS LTD	2,450	131.17	321,366.50	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,105	48.29	343,100.45	
SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	25.34	447,504.40	
CSL LTD	20,712	289.10	5,987,839.20	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	126,149	28.75	3,626,783.75	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	71,217	125.31	8,924,202.27	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	135,333	35.02	4,739,361.66	
WESTPAC BANKING CORP	148,101	26.79	3,967,625.79	
ASX LTD	7,105	56.45	401,077.25	
MACQUARIE GROUP LTD	16,084	190.74	3,067,862.16	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,370	32.39	271,104.30	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	6.59	626,873.75	
MEDIBANK PRIVATE LTD	108,430	3.69	400,106.70	
QBE INSURANCE GROUP LTD	70,410	18.31	1,289,207.10	
SUNCORP GROUP LTD	55,536	16.39	910,235.04	

	WISETECH GLOBAL LTD	7,450	96.15	716,317.50	
	XERO LTD	5,960	130.94	780,402.40	
	TELSTRA GROUP LTD	164,284	3.50	574,994.00	
	APA GROUP	45,818	8.35	382,580.30	
	ORIGIN ENERGY LTD	68,320	10.08	688,665.60	
豪ドル小計		2,899,682		73,639,703.91 (7,671,047,956)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,165	7.47	352,558.37	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,130	30.77	711,710.10	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	4.04	309,371.08	
	MERCURY NZ LTD	34,100	6.69	228,129.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	57,830	6.37	368,377.10	
ニュージーランドドル小計		238,802		1,970,145.65 (190,434,278)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	125,708	36.85	4,632,339.80	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	58,500	95.60	5,592,600.00	
	MTR CORP	62,500	24.90	1,556,250.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	20.70	1,076,400.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	91,000	39.05	3,553,550.00	
	SANDS CHINA LTD	96,600	17.80	1,719,480.00	
	WH GROUP LTD	299,894	5.17	1,550,451.98	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	148,000	24.40	3,611,200.00	
	HANG SENG BANK LTD	36,900	107.20	3,955,680.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	52,800	257.60	13,601,280.00	
	AIA GROUP LTD	482,390	55.50	26,772,645.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	8.73	1,309,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	43.65	1,091,250.00	
	CLP HOLDINGS LTD	71,500	65.40	4,676,100.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	456,237	5.93	2,705,485.41	
	POWER ASSETS HOLDINGS	58,000	42.60	2,470,800.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	80,538	29.40	2,367,817.20	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	21.45	1,241,976.45	
	SINO LAND CO	189,050	8.22	1,553,991.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,480	71.60	4,330,368.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	17,517	70.10	1,227,941.70	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	13.18	548,288.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	43,000	23.15	995,450.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	21.55	1,374,890.00	
香港ドル小計		2,820,915		93,515,734.54 (1,885,277,208)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	68,560	6.53	447,696.80	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	63,300	3.98	251,934.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	6.73	362,747.00	

	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.87	183,657.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	3.07	227,057.20	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	84,034	35.48	2,981,526.32	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	150,740	14.14	2,131,463.60	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	57,300	30.57	1,751,661.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	9.53	405,025.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	354,480	2.55	903,924.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	30,200	5.04	152,208.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	105,000	2.63	276,150.00	
シンガポールドル小計		1,295,074		10,075,049.92 (1,173,441,064)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	39,490	16.49	651,190.10	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,010	674.80	681,548.00	
	BANK HAPOALIM BM	50,495	33.01	1,666,839.95	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	62,565	30.49	1,907,606.85	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	48,330	18.71	904,254.30	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,900	130.60	901,140.00	
	NICE LTD	3,040	621.70	1,889,968.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,780	224.20	399,076.00	
イスラエルシュケル小計		213,610		9,001,623.20 (381,225,043)	
合　　計		46,866,269		412,973,561,923 (412,973,561,923)	

(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	803,771.20	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	12,110	429,178.40	
		AMERICAN TOWER CORP	20,219	3,983,749.57	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	18,847	381,086.34	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,790	1,168,943.10	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,717	352,395.88	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,810	519,672.40	
		CROWN CASTLE INC	18,590	1,842,269.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	12,525	1,877,748.00	
		EQUINIX INC	3,978	3,048,182.28	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,550	410,816.00	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	15,450	1,030,669.50	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,020	841,070.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,800	1,377,816.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,340	492,269.40	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36,875	724,593.75	

		HOST HOTELS & RESORTS INC	33,579	598,377.78	
		INVITATION HOMES INC	25,700	912,350.00	
		IRON MOUNTAIN INC	13,365	1,176,387.30	
		KIMCO REALTY CORP	29,910	560,812.50	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,630	784,371.60	
		PROLOGIS INC	39,585	4,444,999.65	
		PUBLIC STORAGE	6,849	1,939,979.25	
		REALTY INCOME CORP	35,661	1,903,227.57	
		REGENCY CENTERS CORP	7,565	467,290.05	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,735	927,870.60	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	13,394	1,993,429.02	
		SUN COMMUNITIES INC	5,920	690,508.80	
		UDR INC	12,100	487,388.00	
		VENTAS INC	17,025	852,952.50	
		VICI PROPERTIES INC	45,610	1,290,306.90	
		WELLTOWER INC	23,830	2,479,273.20	
		WEYERHAEUSER CO	29,998	869,942.00	
		WP CAREY INC	8,610	482,934.90	
米ドル小計			550,597	42,146,632.44 (6,639,359,008)	
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	122,332.00	
加ドル小計			2,800	122,332.00 (14,030,257)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	86,201.50	
		GECINA SA	1,950	178,522.50	
		KLEPIERRE	8,402	214,587.08	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,990	361,775.00	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,730	195,569.00	
ユーロ小計			24,997	1,036,655.08 (174,821,512)	
英ポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	165,601.28	
		SEGRO PLC	65,733	597,512.97	
英ポンド小計			92,357	763,114.25 (152,523,645)	
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	42,067	273,014.83	
		GOODMAN GROUP	70,642	2,526,864.34	
		GPT GROUP	71,335	290,333.45	
		MIRVAC GROUP	159,875	301,364.37	
		SCENTRE GROUP	198,271	618,605.52	
		STOCKLAND	102,400	454,656.00	
		VICINITY CENTRES	154,902	288,117.72	
豪ドル小計			799,492	4,752,956.23 (495,115,450)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	104,160	3,395,616.00	

香港ドル小計			104,160	3,395,616.00 (68,455,618)	
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,243	355,284.51	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	406,538.64	
シンガポールドル小計			347,799	761,823.15 (88,729,542)	
合計				7,633,035,032 (7,633,035,032)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種　類	銘柄数		組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式	580銘柄	97.9%	—	75.3%
	投資証券	34銘柄	—	2.1%	1.6%
加ドル	株式	85銘柄	99.9%	—	3.0%
	投資証券	1銘柄	—	0.1%	0.0%
ユーロ	株式	217銘柄	99.5%	—	8.7%
	投資証券	5銘柄	—	0.5%	0.0%
英ポンド	株式	78銘柄	99.1%	—	3.9%
	投資証券	2銘柄	—	0.9%	0.0%
スイスフラン	株式	45銘柄	100.0%	—	2.6%
スウェーデンクローナ	株式	43銘柄	100.0%	—	0.9%
ノルウェークローネ	株式	11銘柄	100.0%	—	0.2%
デンマーククローネ	株式	15銘柄	100.0%	—	1.1%
豪ドル	株式	51銘柄	93.9%	—	1.8%
	投資証券	7銘柄	—	6.1%	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	24銘柄	96.5%	—	0.4%
	投資証券	1銘柄	—	3.5%	0.0%
シンガポールドル	株式	12銘柄	93.0%	—	0.3%
	投資証券	2銘柄	—	7.0%	0.0%
イスラエルシュケル	株式	8銘柄	100.0%	—	0.1%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 6月17日現在
資産の部	
流動資産	
預金	31,171,910
コール・ローン	1,116,312,298
株式	23,685,631,742

	2024年 6月17日現在
投資証券	442,413,901
派生商品評価勘定	22,235,329
未収入金	341,158
未収配当金	26,131,943
未収利息	2,519
差入委託証拠金	480,353,201
流動資産合計	25,804,594,001
資産合計	25,804,594,001
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	728,556,704
未払金	3,063,061
未払解約金	410,816
流動負債合計	732,030,581
負債合計	732,030,581
純資産の部	
元本等	
元本	8,961,693,680
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	16,110,869,740
元本等合計	25,072,563,420
純資産合計	25,072,563,420
負債純資産合計	25,804,594,001

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 6月17日現在
1．	期首	2023年 6月20日
	期首元本額	8,609,327,960円
	期首からの追加設定元本額	1,024,062,363円
	期首からの一部解約元本額	671,696,643円
	元本の内訳　※	
	インデックスファンド海外株式ヘッジあり（ＤＣ専用）	7,590,398,629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）	289,849,081円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	1,025,011円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）	458,325円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	30,596,002円

		2024年 6月17日現在
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	93,428,989円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	154,809,200円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	162,101,019円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジあり）	639,027,424円
	計	8,961,693,680円
２．	受益権の総数	8,961,693,680口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2023年 6月20日 至 2024年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

（2024年 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	4,901,392,609
投資証券	71,439,726
合計	4,972,832,335

(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	936,371,445	－	957,191,149	20,819,704
合計		936,371,445	－	957,191,149	20,819,704

（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				
	売建	23,640,011,696	－	24,367,152,775	△727,141,079
	米ドル	18,029,442,167	－	18,546,857,638	△517,415,471
	加ドル	728,173,174	－	748,156,707	△19,983,533
	ユーロ	2,211,798,799	－	2,273,358,047	△61,559,248
	英ポンド	922,349,414	－	967,386,433	△45,037,019
	スイスフラン	603,490,495	－	633,647,469	△30,156,974
	スウェーデンクローナ	194,702,280	－	206,332,790	△11,630,510
	ノルウェークローネ	36,129,555	－	38,238,190	△2,108,635
	デンマーククローネ	250,578,407	－	257,079,125	△6,500,718
	豪ドル	449,157,480	－	474,440,478	△25,282,998
	ニュージーランドドル	7,527,258	－	8,090,241	△562,983
	香港ドル	112,219,400	－	116,150,428	△3,931,028
	シンガポールドル	71,614,081	－	74,021,755	△2,407,674
	イスラエルシュケル	22,829,186	－	23,393,474	△564,288
合計		23,640,011,696	－	24,367,152,775	△727,141,079

（注）1.時価の算定方法

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

①同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2024年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	2.7977円
(1万口当たり純資産額)	(27,977円)

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

通 貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	APA CORP	890	27.82	24,759.80	
	BAKER HUGHES CO	2,370	31.09	73,683.30	
	CHENIERE ENERGY INC	606	155.88	94,463.28	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	270	85.14	22,987.80	
	CHEVRON CORP	4,300	152.57	656,051.00	
	CHORD ENERGY CORP	200	162.42	32,484.00	
	CONOCOPHILLIPS	2,870	109.39	313,949.30	
	COTERRA ENERGY INC	2,100	26.73	56,133.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	1,690	45.56	76,996.40	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	400	185.97	74,388.00	
	EOG RESOURCES INC	1,460	118.24	172,630.40	
	EQT CORP	870	39.34	34,225.80	
	EXXON MOBIL CORP	11,020	109.11	1,202,392.20	
	HALLIBURTON CO	2,110	32.92	69,461.20	
	HESS CORP	670	143.45	96,111.50	
	HF SINCLAIR CORP	420	52.23	21,936.60	
	KINDER MORGAN INC	4,810	19.59	94,227.90	
	MARATHON OIL CORP	980	27.30	26,754.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	900	170.07	153,063.00	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,660	59.84	99,334.40	
	ONEOK INC	1,510	78.10	117,931.00	
	OVINTIV INC	660	45.81	30,234.60	
	PHILLIPS 66	1,070	136.76	146,333.20	
	SCHLUMBERGER LTD	3,390	43.00	145,770.00	
	TARGA RESOURCES CORP	550	119.00	65,450.00	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	60	750.00	45,000.00	
	VALERO ENERGY CORP	810	150.07	121,556.70	
	WILLIAMS COS INC	2,840	41.17	116,922.80	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	590	275.14	162,332.60	
	ALBEMARLE CORP	307	103.51	31,777.57	
	AMCOR PLC	4,230	9.96	42,130.80	
	AVERY DENNISON CORP	196	226.53	44,399.88	
	BALL CORP	855	66.01	56,438.55	

CELANESE CORP	280	139.39	39,029.20	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	420	73.26	30,769.20	
CLEVELAND-CLIFFS INC	1,340	14.91	19,979.40	
CORTEVA INC	1,690	51.18	86,494.20	
CRH PLC	1,760	76.55	134,728.00	
CROWN HOLDINGS INC	298	78.18	23,297.64	
DOW INC	1,580	55.02	86,931.60	
DUPONT DE NEMOURS INC	1,130	79.66	90,015.80	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	300	99.51	29,853.00	
ECOLAB INC	620	240.05	148,831.00	
FREEPORT-MCMORAN INC	3,530	48.11	169,828.30	
INTERNATIONAL PAPER CO	874	44.89	39,233.86	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	590	94.54	55,778.60	
LINDE PLC	1,170	436.95	511,231.50	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	670	93.54	62,671.80	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	150	566.85	85,027.50	
MOSAIC CO/THE	882	27.16	23,955.12	
NEWMONT CORP	2,610	40.82	106,540.20	
NUCOR CORP	640	154.69	99,001.60	
PACKAGING CORP OF AMERICA	240	182.68	43,843.20	
PPG INDUSTRIES INC	660	127.32	84,031.20	
RELIANCE INC	170	277.09	47,105.30	
RPM INTERNATIONAL INC	385	111.29	42,846.65	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	640	296.99	190,073.60	
STEEL DYNAMICS INC	390	120.69	47,069.10	
VULCAN MATERIALS CO	310	252.64	78,318.40	
WESTROCK CO	562	49.66	27,908.92	
3M CO	1,410	100.90	142,269.00	
AECOM	380	86.59	32,904.20	
AERCAP HOLDINGS NV	450	89.03	40,063.50	
ALLEGION PLC	231	116.36	26,879.16	
AMETEK INC	630	167.02	105,222.60	
AXON ENTERPRISE INC	190	292.33	55,542.70	
BOEING CO/THE	1,400	177.27	248,178.00	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	300	149.55	44,865.00	
CARLISLE COS INC	130	405.30	52,689.00	
CARRIER GLOBAL CORP	2,090	64.35	134,491.50	
CATERPILLAR INC	1,210	321.47	388,978.70	
CNH INDUSTRIAL NV	2,590	10.40	26,936.00	
CUMMINS INC	360	266.48	95,932.80	
DEERE & CO	660	378.00	249,480.00	
DOVER CORP	354	177.25	62,746.50	

EATON CORP PLC	970	319.02	309,449.40	
EMCOR GROUP INC	120	377.20	45,264.00	
EMERSON ELECTRIC CO	1,460	106.46	155,431.60	
FASTENAL CO	1,260	63.05	79,443.00	
FERGUSON PLC	530	201.47	106,779.10	
FORTIVE CORP	950	72.73	69,093.50	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	347	67.33	23,363.51	
GE VERNOVA INC	697	170.17	118,608.49	
GENERAL DYNAMICS CORP	600	291.78	175,068.00	
GENERAL ELECTRIC CO	2,670	155.88	416,199.60	
GRACO INC	490	79.29	38,852.10	
HEICO CORP	80	225.17	18,013.60	
HEICO CORP-CLASS A	253	177.21	44,834.13	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,570	208.53	327,392.10	
HOWMET AEROSPACE INC	1,146	78.94	90,465.24	
HUBBELL INC	140	374.74	52,463.60	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	117	238.46	27,899.82	
IDEX CORP	206	198.23	40,835.38	
ILLINOIS TOOL WORKS	760	235.17	178,729.20	
INGERSOLL-RAND INC	1,003	91.46	91,734.38	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	500	36.66	18,330.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	1,710	69.43	118,725.30	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	450	217.47	97,861.50	
LENNOX INTERNATIONAL INC	80	534.00	42,720.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	530	458.34	242,920.20	
MASCO CORP	450	69.14	31,113.00	
NORDSON CORP	120	228.72	27,446.40	
NORTHROP GRUMMAN CORP	350	424.09	148,431.50	
OTIS WORLDWIDE CORP	830	97.13	80,617.90	
OWENS CORNING	242	176.58	42,732.36	
PACCAR INC	1,250	106.72	133,400.00	
PARKER HANNIFIN CORP	310	503.30	156,023.00	
PENTAIR PLC	260	77.33	20,105.80	
QUANTA SERVICES INC	370	273.29	101,117.30	
ROCKWELL AUTOMATION INC	270	254.39	68,685.30	
RTX CORP	3,260	104.23	339,789.80	
SMITH (A.O.) CORP	270	82.46	22,264.20	
SNAP-ON INC	152	262.24	39,860.48	
STANLEY BLACK & DECKER INC	421	83.55	35,174.55	
TEXTRON INC	508	85.25	43,307.00	
TORO CO	300	96.61	28,983.00	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	560	329.64	184,598.40	

TRANSDIGM GROUP INC	140	1,294.76	181,266.40	
UNITED RENTALS INC	150	616.21	92,431.50	
VERTIV HOLDINGS CO	890	91.48	81,417.20	
WABTEC CORP	460	160.32	73,747.20	
WATSCO INC	90	477.99	43,019.10	
WW GRAINGER INC	110	906.79	99,746.90	
XYLEM INC	640	138.02	88,332.80	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,020	242.62	247,472.40	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	365	150.42	54,903.30	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	280	195.13	54,636.40	
CINTAS CORP	210	695.69	146,094.90	
COPART INC	2,080	53.21	110,676.80	
DAYFORCE INC	300	50.49	15,147.00	
EQUIFAX INC	290	241.61	70,066.90	
JACOBS SOLUTIONS INC	290	138.20	40,078.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	309	143.70	44,403.30	
PAYCHEX INC	790	121.99	96,372.10	
PAYCOM SOFTWARE INC	160	142.78	22,844.80	
PAYLOCITY HOLDING CORP	140	139.23	19,492.20	
REPUBLIC SERVICES INC	580	188.64	109,411.20	
ROLLINS INC	540	48.50	26,190.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	603	60.69	36,596.07	
TRANSUNION	455	71.79	32,664.45	
VERALTO CORP	596	100.75	60,047.00	
VERISK ANALYTICS INC	360	264.37	95,173.20	
WASTE CONNECTIONS INC	630	168.61	106,224.30	
WASTE MANAGEMENT INC	950	203.64	193,458.00	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	300	83.60	25,080.00	
CSX CORP	4,580	32.18	147,384.40	
DELTA AIR LINES INC	276	48.72	13,446.72	
EXPEDITORS INTL WASH INC	270	123.39	33,315.30	
FEDEX CORP	560	246.43	138,000.80	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	3,920	3.60	14,112.00	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	219	157.26	34,439.94	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	463	46.76	21,649.88	
NORFOLK SOUTHERN CORP	560	219.90	123,144.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	500	172.74	86,370.00	
SOUTHWEST AIRLINES CO	466	28.38	13,225.08	
U-HAUL HOLDING CO	230	60.60	13,938.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	4,670	70.06	327,180.20	
UNION PACIFIC CORP	1,490	222.10	330,929.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,750	135.65	237,387.50	

APTIV PLC	720	70.30	50,616.00	
FORD MOTOR COMPANY	9,260	11.71	108,434.60	
GENERAL MOTORS CORP	2,720	46.77	127,214.40	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	1,840	10.88	20,019.20	
TESLA INC	7,040	178.01	1,253,190.40	
DECKERS OUTDOOR CORP	70	1,023.75	71,662.50	
DR HORTON INC	790	142.78	112,796.20	
GARMIN LTD	360	159.53	57,430.80	
LENNAR CORP-CL A	610	155.10	94,611.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	310	306.01	94,863.10	
NIKE INC -CL B	2,910	93.39	271,764.90	
NVR INC	7	7,602.33	53,216.31	
PULTE GROUP INC	610	114.09	69,594.90	
AIRBNB INC-CLASS A	1,110	145.97	162,026.70	
BOOKING HOLDINGS INC	80	3,859.10	308,728.00	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	521	36.03	18,771.63	
CARNIVAL CORP	2,298	15.34	35,251.32	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	70	3,271.71	229,019.70	
DARDEN RESTAURANTS INC	311	148.78	46,270.58	
DOMINO'S PIZZA INC	93	521.41	48,491.13	
DOORDASH INC - A	730	112.05	81,796.50	
DRAFTKINGS INC-CL A	1,130	38.91	43,968.30	
EXPEDIA GROUP INC	250	124.61	31,152.50	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	610	210.32	128,295.20	
HYATT HOTELS CORP - CL A	130	147.47	19,171.10	
LAS VEGAS SANDS CORP	909	43.25	39,314.25	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	600	239.45	143,670.00	
MCDONALD'S CORP	1,750	253.58	443,765.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	761	39.85	30,325.85	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	550	148.50	81,675.00	
STARBUCKS CORP	2,810	79.65	223,816.50	
WYNN RESORTS LTD	210	88.80	18,648.00	
YUM! BRANDS INC	730	136.79	99,856.70	
ALPHABET INC-CL A	14,490	176.79	2,561,687.10	
ALPHABET INC-CL C	12,600	178.37	2,247,462.00	
CHARTER COMMUNICATION-A	250	276.26	69,065.00	
COMCAST CORP-CLASS A	9,580	37.44	358,675.20	
ELECTRONIC ARTS INC	620	135.98	84,307.60	
FOX CORP - CLASS A	730	33.18	24,221.40	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	932	29.42	27,419.44	
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	514	72.43	37,229.02	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	440	88.75	39,050.00	

MATCH GROUP INC	682	31.55	21,517.10	
META PLATFORMS INC-CLASS A	5,400	504.16	2,722,464.00	
NETFLIX INC	1,060	669.38	709,542.80	
NEWS CORP - CLASS A	690	27.08	18,685.20	
OMNICOM GROUP	510	88.41	45,089.10	
PARAMOUNT GLOBAL	1,604	10.17	16,312.68	
PINTEREST INC- CLASS A	1,460	43.51	63,524.60	
ROBLOX CORP -CLASS A	1,150	35.10	40,365.00	
ROKU INC	306	54.51	16,680.06	
SEA LTD-ADR	950	74.42	70,699.00	
SNAP INC - A	2,685	15.59	41,859.15	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	417	158.96	66,286.32	
THE WALT DISNEY CO.	4,470	99.97	446,865.90	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1,050	95.66	100,443.00	
WARNER BROS DISCOVERY INC	6,490	7.24	46,987.60	
AMAZON.COM INC	23,070	183.66	4,237,036.20	
AUTOZONE INC	40	2,835.82	113,432.80	
BATH & BODY WORKS INC	593	43.26	25,653.18	
BEST BUY CO INC	559	87.21	48,750.39	
BURLINGTON STORES INC	158	228.02	36,027.16	
CARMAX INC	443	69.91	30,970.13	
DICK'S SPORTING GOODS INC	160	216.28	34,604.80	
EBAY INC	1,170	52.13	60,992.10	
ETSY INC	348	58.87	20,486.76	
GENUINE PARTS CO	390	136.70	53,313.00	
HOME DEPOT INC	2,420	346.84	839,352.80	
LKQ CORP	715	40.29	28,807.35	
LOWE'S COS INC	1,380	223.35	308,223.00	
MERCADOLIBRE INC	110	1,582.14	174,035.40	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	140	1,007.31	141,023.40	
POOL CORP	94	341.31	32,083.14	
ROSS STORES INC	810	145.93	118,203.30	
TJX COMPANIES INC	2,720	108.50	295,120.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	288	280.25	80,712.00	
ULTA BEAUTY INC	130	390.82	50,806.60	
WILLIAMS-SONOMA INC	160	301.62	48,259.20	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	730	20.01	14,607.30	
COSTCO WHOLESALE CORP	1,090	855.67	932,680.30	
DOLLAR GENERAL CORP	550	125.79	69,184.50	
DOLLAR TREE INC	490	106.03	51,954.70	
KROGER CO	1,730	50.38	87,157.40	
SYSCO CORP	1,110	70.69	78,465.90	

TARGET CORP	1,170	141.16	165,157.20	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,830	15.55	28,456.50	
WALMART INC	10,880	67.02	729,177.60	
ALTRIA GROUP INC	4,150	44.32	183,928.00	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,370	59.50	81,515.00	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	260	43.66	11,351.60	
BUNGE GLOBAL SA	384	102.83	39,486.72	
CAMPBELL SOUP CO	618	43.99	27,185.82	
CELSIUS HOLDINGS INC	350	59.96	20,986.00	
COCA-COLA CO/THE	10,050	62.55	628,627.50	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	578	74.05	42,800.90	
CONAGRA BRANDS INC	1,363	28.34	38,627.42	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	420	253.50	106,470.00	
GENERAL MILLS INC	1,480	65.50	96,940.00	
HERSHEY CO/THE	373	186.98	69,743.54	
HORMEL FOODS CORP	990	30.48	30,175.20	
JM SMUCKER CO/THE	281	111.58	31,353.98	
KELLANOVA	840	57.52	48,316.80	
KEURIG DR PEPPER INC	2,840	34.04	96,673.60	
KRAFT HEINZ CO/THE	2,120	32.38	68,645.60	
LAMB WESTON HOLDING INC	370	86.76	32,101.20	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	670	67.79	45,419.30	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	620	49.53	30,708.60	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	3,210	65.85	211,378.50	
MONSTER BEVERAGE CORP	1,990	48.03	95,579.70	
PEPSICO INC	3,340	163.81	547,125.40	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	3,800	102.20	388,360.00	
TYSON FOODS INC-CL A	731	53.97	39,452.07	
CHURCH & DWIGHT CO INC	624	107.70	67,204.80	
CLOROX COMPANY	311	133.70	41,580.70	
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,980	94.62	187,347.60	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	610	113.90	69,479.00	
KENVUE INC	4,350	18.07	78,604.50	
KIMBERLY-CLARK CORP	840	139.49	117,171.60	
PROCTER & GAMBLE CO	5,780	166.79	964,046.20	
ABBOTT LABORATORIES	4,210	103.68	436,492.80	
ALIGN TECHNOLOGY INC	189	256.01	48,385.89	
BAXTER INTERNATIONAL INC	1,380	33.78	46,616.40	
BECTON DICKINSON AND CO	720	233.73	168,285.60	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	3,530	76.76	270,962.80	
CARDINAL HEALTH INC	600	100.20	60,120.00	
CENCORA INC	460	232.53	106,963.80	

CENTENE CORP	1,230	68.93	84,783.90	
CIGNA GROUP/THE	690	333.29	229,970.10	
COOPER COS INC/THE	552	93.47	51,595.44	
CVS HEALTH CORP	3,010	60.22	181,262.20	
DAVITA INC	130	141.16	18,350.80	
DEXCOM INC	880	115.95	102,036.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,620	87.29	141,409.80	
ELEVANCE HEALTH INC	560	534.81	299,493.60	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	963	76.49	73,659.87	
HCA HEALTHCARE INC	470	337.47	158,610.90	
HENRY SCHEIN INC	310	65.80	20,398.00	
HOLOGIC INC	640	71.79	45,945.60	
HUMANA INC	320	358.93	114,857.60	
IDEXX LABORATORIES INC	200	504.00	100,800.00	
INSULET CORP	183	200.45	36,682.35	
INTUITIVE SURGICAL INC	880	425.78	374,686.40	
LABCORP HOLDINGS INC	230	199.88	45,972.40	
MCKESSON CORP	320	589.95	188,784.00	
MEDTRONIC PLC	3,180	81.04	257,707.20	
MOLINA HEALTHCARE INC	160	307.04	49,126.40	
QUEST DIAGNOSTICS	309	137.85	42,595.65	
RESMED INC	410	211.73	86,809.30	
SOLVENTUM CORP	352	54.56	19,205.12	
STERIS PLC	230	218.29	50,206.70	
STRYKER CORP	850	344.98	293,233.00	
TELEFLEX INC	138	208.29	28,744.02	
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,260	497.12	1,123,491.20	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	184	187.85	34,564.40	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	380	184.70	70,186.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	540	107.19	57,882.60	
ABBVIE INC	4,350	168.59	733,366.50	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	760	129.85	98,686.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	340	160.39	54,532.60	
AMGEN INC	1,310	298.62	391,192.20	
AVANTOR INC	2,120	21.68	45,961.60	
BIO-RAD LABORATORIES-A	64	282.26	18,064.64	
BIO-TECHNE CORP	388	75.87	29,437.56	
BIOGEN INC	350	231.69	81,091.50	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	488	83.51	40,752.88	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	5,050	41.20	208,060.00	
CATALENT INC	429	55.48	23,800.92	
CHARLES RIVER LABORATORIES	125	209.47	26,183.75	

DANAHER CORP	1,710	254.85	435,793.50	
ELI LILLY & CO	1,990	878.45	1,748,115.50	
EXACT SCIENCES CORP	426	41.88	17,840.88	
GILEAD SCIENCES INC	3,180	65.06	206,890.80	
ILLUMINA INC	440	108.66	47,810.40	
INCYTE CORP	600	62.11	37,266.00	
IQVIA HOLDINGS INC	430	212.75	91,482.50	
JOHNSON & JOHNSON	5,880	145.54	855,775.20	
MERCK & CO. INC.	6,240	129.48	807,955.20	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	50	1,454.74	72,737.00	
MODERNA INC	790	140.03	110,623.70	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	220	135.45	29,799.00	
PFIZER INC	13,790	27.53	379,638.70	
REGENERON PHARMACEUTICALS	260	1,036.52	269,495.20	
REPLIGEN CORP	170	125.62	21,355.40	
REVVITY INC	380	108.65	41,287.00	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	845	26.92	22,747.40	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	2,710	17.16	46,503.60	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	930	572.05	532,006.50	
UNITED THERAPEUTICS CORP	130	288.06	37,447.80	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	630	480.73	302,859.90	
VIATRIS INC	3,111	10.17	31,638.87	
WATERS CORP	130	294.94	38,342.20	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	199	333.25	66,316.75	
ZOETIS INC	1,150	170.55	196,132.50	
BANK OF AMERICA CORP	17,320	39.24	679,636.80	
CITIGROUP INC	4,650	59.33	275,884.50	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	960	34.07	32,707.20	
FIFTH THIRD BANCORP	1,760	35.22	61,987.20	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	30	1,631.83	48,954.90	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	4,310	12.37	53,314.70	
JPMORGAN CHASE & CO	7,050	193.78	1,366,149.00	
KEYCORP	2,531	13.36	33,814.16	
M & T BANK CORP	360	142.18	51,184.80	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	950	151.09	143,535.50	
REGIONS FINANCIAL CORP	2,407	18.65	44,890.55	
TRUIST FINANCIAL CORP	3,250	35.41	115,082.50	
US BANCORP	3,830	38.83	148,718.90	
WELLS FARGO & CO	8,630	57.40	495,362.00	
ALLY FINANCIAL INC	600	38.78	23,268.00	
AMERICAN EXPRESS CO	1,410	224.82	316,996.20	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	240	423.86	101,726.40	

APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	1,000	115.87	115,870.00	
ARES MANAGEMENT CORP-A	400	132.63	53,052.00	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	2,120	58.02	123,002.40	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	3,220	405.54	1,305,838.80	
BLACKROCK INC	360	769.33	276,958.80	
BLACKSTONE INC	1,790	121.25	217,037.50	
BLOCK INC	1,370	62.15	85,145.50	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	920	133.70	123,004.00	
CARLYLE GROUP INC/THE	590	39.05	23,039.50	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	306	167.60	51,285.60	
CME GROUP INC	920	197.13	181,359.60	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	450	244.50	110,025.00	
CORPAY INC	192	249.66	47,934.72	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	610	122.00	74,420.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	960	39.68	38,092.80	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	120	401.74	48,208.80	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	1,480	76.57	113,323.60	
FISERV INC	1,420	148.94	211,494.80	
FRANKLIN RESOURCES INC	780	21.83	17,027.40	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	139	71.06	9,877.34	
GLOBAL PAYMENTS INC	700	94.17	65,919.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	790	446.46	352,703.40	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,410	135.67	191,294.70	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	201	161.57	32,475.57	
KKR & CO INC -A	1,463	109.18	159,730.34	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	200	277.17	55,434.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	94	200.22	18,820.68	
MASTERCARD INC - A	2,050	444.63	911,491.50	
MOODY'S CORP	410	408.12	167,329.20	
MORGAN STANLEY	3,050	95.50	291,275.00	
MSCI INC	200	480.53	96,106.00	
NASDAQ INC	867	58.60	50,806.20	
NORTHERN TRUST CORP	508	81.65	41,478.20	
PAYPAL HOLDINGS INC	2,400	60.63	145,524.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	430	115.67	49,738.10	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	1,190	22.42	26,679.80	
S&P GLOBAL INC	770	434.40	334,488.00	
SCHWAB (CHARLES) CORP	3,680	73.25	269,560.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	347	64.43	22,357.21	
STATE STREET CORP	790	70.91	56,018.90	
SYNCHRONY FINANCIAL	1,226	41.69	51,111.94	
T ROWE PRICE GROUP INC	440	114.90	50,556.00	

TOAST INC-CLASS A	990	22.72	22,492.80	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	333	104.31	34,735.23	
VISA INC-CLASS A SHARES	3,870	270.66	1,047,454.20	
AFLAC INC	1,240	87.04	107,929.60	
ALLSTATE CORP	640	157.07	100,524.80	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	204	124.14	25,324.56	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,790	73.42	131,421.80	
AON PLC	460	295.39	135,879.40	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	955	97.26	92,883.30	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	540	258.24	139,449.60	
ASSURANT INC	167	165.54	27,645.18	
BROWN & BROWN INC	595	90.08	53,597.60	
CHUBB LTD	970	259.46	251,676.20	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	382	112.27	42,887.14	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	70	349.82	24,487.40	
EVEREST GROUP LTD	105	367.56	38,593.80	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	870	48.28	42,003.60	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	600	99.47	59,682.00	
LOEWS CORP	575	73.79	42,429.25	
MARKEL GROUP INC	34	1,544.07	52,498.38	
MARSH & MCLENNAN COS	1,180	208.88	246,478.40	
METLIFE INC	1,490	68.55	102,139.50	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	658	76.66	50,442.28	
PROGRESSIVE CORP	1,430	203.92	291,605.60	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	830	113.11	93,881.30	
TRAVELERS COS INC/THE	540	205.85	111,159.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	230	255.28	58,714.40	
WR BERKLEY CORP	600	78.15	46,890.00	
ACCENTURE PLC-CL A	1,530	286.71	438,666.30	
ADOBE INC	1,090	525.31	572,587.90	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	400	89.09	35,636.00	
ANSYS INC	210	323.17	67,865.70	
APPLOVIN CORP-CLASS A	380	77.52	29,457.60	
ASPEN TECHNOLOGY INC	100	197.66	19,766.00	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	430	160.09	68,838.70	
AUTODESK INC	520	225.87	117,452.40	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	519	50.19	26,048.61	
CADENCE DESIGN SYS INC	680	312.10	212,228.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	200	156.49	31,298.00	
CLOUDFLARE INC-CLASS A	780	75.59	58,960.20	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	1,300	64.26	83,538.00	
CONFLUENT INC-CLASS A	350	27.77	9,719.50	

CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	560	385.43	215,843.60	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	121	252.33	30,531.93	
DATADOG INC-CLASS A	630	117.84	74,239.20	
DOCUSIGN INC	501	50.84	25,470.84	
DYNATRACE INC	565	45.91	25,939.15	
EPAM SYSTEMS INC	180	177.58	31,964.40	
FAIR ISAAC CORP	62	1,390.59	86,216.58	
FORTINET INC	1,510	60.78	91,777.80	
GARTNER INC	210	432.21	90,764.10	
GEN DIGITAL INC	1,407	24.39	34,316.73	
GODADDY INC-CLASS A	320	137.53	44,009.60	
HUBSPOT INC	123	584.71	71,919.33	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,240	169.21	379,030.40	
INTUIT INC	680	595.70	405,076.00	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	170	228.84	38,902.80	
MICROSOFT CORP	17,400	442.57	7,700,718.00	
MICROSTRATEGY INC-CL A	40	1,495.54	59,821.60	
MONDAY.COM LTD	80	226.58	18,126.40	
MONGODB INC	180	227.00	40,860.00	
OKTA INC	349	89.76	31,326.24	
ORACLE CORP	4,050	138.13	559,426.50	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	4,890	23.57	115,257.30	
PALO ALTO NETWORKS INC	780	317.31	247,501.80	
PTC INC	270	173.50	46,845.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	260	549.45	142,857.00	
SALESFORCE INC	2,370	231.94	549,697.80	
SAMSARA INC-CL A	410	28.07	11,508.70	
SERVICENOW INC	500	728.58	364,290.00	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	720	127.17	91,562.40	
SYNOPSYS INC	380	590.21	224,279.80	
TWILIO INC - A	437	54.24	23,702.88	
TYLER TECHNOLOGIES INC	100	471.79	47,179.00	
UIPATH INC - CLASS A	1,050	11.54	12,117.00	
UNITY SOFTWARE INC	790	16.40	12,956.00	
VERISIGN INC	250	180.31	45,077.50	
WIX.COM LTD	150	163.61	24,541.50	
WORKDAY INC-CLASS A	510	209.48	106,834.80	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	567	57.74	32,738.58	
ZSCALER INC	227	184.22	41,817.94	
AMPHENOL CORP-CL A	2,960	68.27	202,079.20	
APPLE INC	36,140	212.49	7,679,388.60	
ARISTA NETWORKS INC	670	328.50	220,095.00	

CDW CORP/DE	330	223.19	73,652.70	
CISCO SYSTEMS INC	9,820	45.68	448,577.60	
CORNING INC	2,060	37.25	76,735.00	
DELL TECHNOLOGIES -C	630	134.98	85,037.40	
F5 INC	167	167.58	27,985.86	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	3,350	21.60	72,360.00	
HP INC	2,240	35.51	79,542.40	
JABIL INC	360	119.48	43,012.80	
JUNIPER NETWORKS INC	802	35.46	28,438.92	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	400	135.98	54,392.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	410	375.41	153,918.10	
NETAPP INC	510	126.17	64,346.70	
PURE STORAGE INC - CLASS A	790	67.68	53,467.20	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	463	103.86	48,087.18	
SUPER MICRO COMPUTER INC	130	844.54	109,790.20	
TE CONNECTIVITY LTD	770	147.35	113,459.50	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	120	389.60	46,752.00	
TRIMBLE INC	530	54.81	29,049.30	
WESTERN DIGITAL CORP	807	78.12	63,042.84	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	120	301.37	36,164.40	
AT&T INC	17,620	17.64	310,816.80	
T-MOBILE US INC	1,360	175.99	239,346.40	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	10,370	39.67	411,377.90	
AES CORP	2,110	19.34	40,807.40	
ALLIANT ENERGY CORP	780	49.84	38,875.20	
AMEREN CORPORATION	560	70.12	39,267.20	
AMERICAN ELECTRIC POWER	1,240	88.00	109,120.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	520	129.30	67,236.00	
ATMOS ENERGY CORP	430	116.15	49,944.50	
CENTERPOINT ENERGY INC	1,340	30.85	41,339.00	
CMS ENERGY CORP	650	59.65	38,772.50	
CONSOLIDATED EDISON INC	810	90.87	73,604.70	
CONSTELLATION ENERGY	770	214.90	165,473.00	
DOMINION ENERGY INC	2,040	50.43	102,877.20	
DTE ENERGY COMPANY	510	112.14	57,191.40	
DUKE ENERGY CORP	1,940	102.36	198,578.40	
EDISON INTERNATIONAL	910	73.21	66,621.10	
ENTERGY CORP	590	107.02	63,141.80	
ESSENTIAL UTILITIES INC	610	37.13	22,649.30	
EVERGY INC	730	52.74	38,500.20	
EVERSOURCE ENERGY	760	59.01	44,847.60	
EXELON CORP	2,340	35.54	83,163.60	

	FIRSTENERGY CORP	1,610	38.77	62,419.70	
	NEXTERA ENERGY INC	5,140	73.06	375,528.40	
	NISOURCE INC	1,151	28.17	32,423.67	
	NRG ENERGY INC	520	78.64	40,892.80	
	P G & E CORP	4,760	18.25	86,870.00	
	PPL CORP	1,630	28.08	45,770.40	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	1,190	72.64	86,441.60	
	SEMPRA	1,570	75.97	119,272.90	
	SOUTHERN CO	2,690	78.65	211,568.50	
	VISTRA CORP	921	87.59	80,670.39	
	WEC ENERGY GROUP INC	740	78.86	58,356.40	
	XCEL ENERGY INC	1,520	53.77	81,730.40	
	ADVANCED MICRO DEVICES	3,960	159.63	632,134.80	
	ANALOG DEVICES INC	1,190	231.19	275,116.10	
	APPLIED MATERIALS INC	2,030	237.03	481,170.90	
	BROADCOM INC	1,090	1,735.04	1,891,193.60	
	ENPHASE ENERGY INC	400	124.61	49,844.00	
	ENTEGRIS INC	410	133.90	54,899.00	
	FIRST SOLAR INC	250	273.61	68,402.50	
	INTEL CORP	10,700	30.45	325,815.00	
	KLA CORP	330	824.84	272,197.20	
	LAM RESEARCH CORP	320	1,035.98	331,513.60	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	380	60.22	22,883.60	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	2,090	73.27	153,134.30	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	1,370	91.35	125,149.50	
	MICRON TECHNOLOGY INC	2,720	141.36	384,499.20	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	109	806.57	87,916.13	
	NVIDIA CORP	61,600	131.88	8,123,808.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	610	268.85	163,998.50	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	1,100	71.97	79,167.00	
	QORVO INC	316	112.38	35,512.08	
	QUALCOMM INC	2,740	215.33	590,004.20	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	437	104.37	45,609.69	
	TERADYNE INC	403	145.06	58,459.18	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	2,210	193.90	428,519.00	
	CBRE GROUP INC - A	710	86.90	61,699.00	
	COSTAR GROUP INC	1,080	73.93	79,844.40	
	ZILLOW GROUP INC - C	478	48.00	22,944.00	
米ドル小計		892,341		114,902,813.48 (18,100,640,207)	
加ドル	ARC RESOURCES LTD	1,760	23.95	42,152.00	
	CAMECO CORP	960	71.29	68,438.40	

CANADIAN NATURAL RESOURCES	5,340	46.62	248,950.80	
CENOVUS ENERGY INC	3,390	25.06	84,953.40	
ENBRIDGE INC	4,980	48.25	240,285.00	
IMPERIAL OIL LTD	600	88.11	52,866.00	
KEYERA CORP	660	36.59	24,149.40	
PARKLAND CORP	500	38.71	19,355.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	1,530	50.92	77,907.60	
SUNCOR ENERGY INC	3,060	50.26	153,795.60	
TC ENERGY CORP	2,350	53.25	125,137.50	
TOURMALINE OIL CORP	870	63.13	54,923.10	
AGNICO EAGLE MINES LTD	1,300	88.27	114,751.00	
BARRICK GOLD CORP	4,090	22.01	90,020.90	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	530	72.68	38,520.40	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	1,389	16.49	22,904.61	
FRANCO-NEVADA CORP	507	159.49	80,861.43	
IVANHOE MINES LTD-CL A	1,881	17.48	32,879.88	
KINROSS GOLD CORP	4,540	10.19	46,262.60	
NUTRIEN LTD	1,310	70.32	92,119.20	
PAN AMERICAN SILVER CORP	611	27.31	16,686.41	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	1,299	65.61	85,227.39	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	150	109.73	16,459.50	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,240	72.70	90,148.00	
CAE INC	753	24.77	18,651.81	
STANTEC INC	290	113.27	32,848.30	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	270	117.56	31,741.20	
WSP GLOBAL INC	330	206.84	68,257.20	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	1,200	24.21	29,052.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	503	52.12	26,216.36	
RB GLOBAL INC	520	109.75	57,070.00	
THOMSON REUTERS CORP	430	229.65	98,749.50	
AIR CANADA	550	17.16	9,438.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,300	167.29	217,477.00	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	2,370	105.62	250,319.40	
TFI INTERNATIONAL INC	260	188.90	49,114.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	590	57.97	34,202.30	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	670	94.65	63,415.50	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	139	135.15	18,785.85	
DOLLARAMA INC	750	123.85	92,887.50	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	1,780	75.90	135,102.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	480	156.35	75,048.00	
METRO INC	776	73.99	57,416.24	
WESTON (GEORGE) LTD	220	189.32	41,650.40	

	SAPUTO INC	748	29.37	21,968.76	
	BANK OF MONTREAL	1,720	114.86	197,559.20	
	BANK OF NOVA SCOTIA	3,020	63.70	192,374.00	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	2,540	65.31	165,887.40	
	NATIONAL BANK OF CANADA	855	106.43	90,997.65	
	ROYAL BANK OF CANADA	3,400	142.87	485,758.00	
	TORONTO-DOMINION BANK	4,400	74.53	327,932.00	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	980	52.22	51,175.60	
	BROOKFIELD CORP	3,460	56.24	194,590.40	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	60	1,526.56	91,593.60	
	GREAT-WEST LIFECO INC	917	39.21	35,955.57	
	INTACT FINANCIAL CORP	473	222.40	105,195.20	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	4,570	34.50	157,665.00	
	POWER CORP OF CANADA	1,536	38.45	59,059.20	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	1,430	65.34	93,436.20	
	CGI INC	605	136.86	82,800.30	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	50	3,800.00	190,000.00	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	270	129.20	34,884.00	
	OPEN TEXT CORP	973	39.51	38,443.23	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	3,050	92.94	283,467.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	971	51.93	50,424.03	
	TELUS CORP	1,220	21.72	26,498.40	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	411	41.30	16,974.30	
	EMERA INC	675	45.81	30,921.75	
	FORTIS INC	1,170	53.69	62,817.30	
	HYDRO ONE LTD	950	39.42	37,449.00	
	FIRSTSERVICE CORP	137	209.38	28,685.06	
加ドル小計		99,619		6,481,709.83 (743,387,300)	
ユーロ	ENI SPA	5,320	13.50	71,862.56	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,090	18.72	20,410.25	
	NESTE OYJ	1,076	17.79	19,142.04	
	OMV AG	430	39.06	16,795.80	
	REPSOL SA	3,620	14.30	51,784.10	
	TENARIS SA	1,520	14.31	21,758.80	
	TOTALENERGIES SE	5,320	61.42	326,754.40	
	AIR LIQUIDE SA	1,386	159.28	220,762.08	
	AKZO NOBEL	468	58.10	27,190.80	
	ARCELORMITTAL	1,590	21.82	34,693.80	
	ARKEMA	208	83.70	17,409.60	
	BASF SE	2,440	44.58	108,787.40	
	COVESTRO AG	543	50.24	27,280.32	

DSM-FIRMENICH AG	480	99.24	47,635.20	
HEIDELBERG MATERIALS AG	333	95.26	31,721.58	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	739	42.14	31,141.46	
STORA ENSO OYJ-R SHS	1,558	12.38	19,295.83	
SYENSQO SA	192	88.33	16,959.36	
SYMRISE AG	280	112.40	31,472.00	
UMICORE	604	13.63	8,232.52	
UPM-KYMMENE OYJ	1,438	32.69	47,008.22	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	450	39.22	17,649.00	
AIRBUS GROUP SE	1,470	143.82	211,415.40	
ALSTOM	875	15.50	13,566.87	
ALSTOM SA - RTS	875	1.06	927.50	
BRENNTAG SE	402	65.00	26,130.00	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	1,050	72.30	75,915.00	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	1,179	36.47	42,998.13	
EIFFAGE	260	84.96	22,089.60	
FERROVIAL SE	1,472	36.62	53,904.64	
IMCD NV	150	136.55	20,482.50	
KINGSPAN GROUP PLC	320	81.05	25,936.00	
KNORR-BREMSE AG	225	70.40	15,840.00	
KONE OYJ-B	899	47.24	42,468.76	
LEGRAND SA	680	93.46	63,552.80	
LEONARDO SPA	1,000	21.18	21,180.00	
METSO CORPORATION	1,250	10.40	13,000.00	
MTU AERO ENGINES AG	140	224.40	31,416.00	
PRYSMIAN SPA	690	56.64	39,081.60	
RATIONAL AG	15	792.50	11,887.50	
RHEINMETALL AG	110	479.20	52,712.00	
SAFRAN SA	860	196.65	169,119.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,320	221.20	291,984.00	
SIEMENS AG-REG	1,910	165.74	316,563.40	
SIEMENS ENERGY AG	1,430	23.24	33,233.20	
THALES SA	230	150.30	34,569.00	
VINCI SA	1,360	98.14	133,470.40	
WARTSILA OYJ ABP	1,289	18.96	24,445.88	
BUREAU VERITAS SA	1,035	26.66	27,593.10	
TELEPERFORMANCE	160	93.30	14,928.00	
WOLTERS KLUWER	640	152.70	97,728.00	
ADP	93	112.80	10,490.40	
AENA SA	247	184.60	45,596.20	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,970	5.89	11,615.12	
DEUTSCHE POST AG-REG	2,730	37.75	103,057.50	

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	950	86.90	82,555.00	
CONTINENTAL AG	268	55.00	14,740.00	
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	300	70.62	21,186.00	
FERRARI NV	330	379.70	125,301.00	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	2,010	63.20	127,032.00	
MICHELIN (CGDE)	1,690	36.90	62,361.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	404	42.46	17,153.84	
RENAULT SA	490	48.14	23,588.60	
STELLANTIS NV	5,450	18.82	102,569.00	
VOLKSWAGEN AG	110	112.40	12,364.00	
VOLKSWAGEN AG-PFD	430	104.50	44,935.00	
ADIDAS AG	390	224.90	87,711.00	
HERMES INTERNATIONAL	80	2,112.00	168,960.00	
KERING	180	302.50	54,450.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	680	711.40	483,752.00	
MONCLER SPA	532	58.64	31,196.48	
PUMA SE	260	45.06	11,715.60	
ACCOR SA	541	37.03	20,033.23	
AMADEUS IT GROUP SA	1,320	64.20	84,744.00	
DELIVERY HERO SE	387	27.84	10,774.08	
SODEXO SA	273	84.00	22,932.00	
PUBLICIS GROUPE	590	97.76	57,678.40	
SCOUT24 SE	240	70.40	16,896.00	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	2,083	28.63	59,636.29	
VIVENDI SE	2,083	9.50	19,788.50	
INDITEX	2,980	45.96	136,960.80	
PROSUS NV	3,390	33.91	114,971.85	
ZALANDO SE	601	22.15	13,312.15	
CARREFOUR SA	1,713	14.40	24,675.76	
JERONIMO MARTINS	860	19.62	16,873.20	
KESKO OYJ-B SHS	643	16.44	10,574.13	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	2,610	28.08	73,288.80	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	2,320	55.46	128,667.20	
DANONE	1,720	58.80	101,136.00	
HEINEKEN HOLDING NV	410	76.55	31,385.50	
HEINEKEN NV	730	94.84	69,233.20	
KERRY GROUP PLC-A	390	75.30	29,367.00	
PERNOD-RICARD SA	500	131.90	65,950.00	
BEIERSDORF AG	230	146.45	33,683.50	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	600	83.06	49,836.00	
L'OREAL	590	440.45	259,865.50	
AMPLIFON SPA	380	34.64	13,163.20	

CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	135	84.35	11,387.25	
ESSILORLUXOTTICA	790	201.00	158,790.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	585	38.63	22,598.55	
FRESENIUS SE & CO KGAA	1,254	29.56	37,068.24	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	2,569	24.11	61,938.59	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	723	53.64	38,781.72	
ARGENX SE	140	360.90	50,526.00	
BAYER AG-REG	2,190	27.06	59,272.35	
EUROFINS SCIENTIFIC	362	52.12	18,867.44	
IPSEN	120	120.50	14,460.00	
MERCK KGAA	290	172.00	49,880.00	
QIAGEN N.V.	533	39.70	21,160.10	
SANOFI	2,810	86.43	242,868.30	
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	60	245.70	14,742.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	76	178.75	13,585.00	
UCB SA	330	137.85	45,490.50	
ABN AMRO BANK NV-CVA	809	15.24	12,333.20	
AIB GROUP PLC	3,990	4.78	19,096.14	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	14,140	9.02	127,542.80	
BANCO SANTANDER SA	38,920	4.37	170,411.22	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	3,690	9.72	35,866.80	
BNP PARIBAS	2,520	58.41	147,193.20	
CAIXABANK S.A	11,895	4.87	57,988.12	
COMMERZBANK AG	2,690	13.76	37,027.85	
CREDIT AGRICOLE SA	3,122	13.03	40,695.27	
ERSTE GROUP BANK AG	820	42.02	34,456.40	
FINECOBANK SPA	1,495	13.98	20,907.57	
ING GROEP NV-CVA	9,000	15.33	137,988.00	
INTESA SANPAOLO	40,460	3.33	134,731.80	
KBC GROEP NV	743	64.16	47,670.88	
MEDIOBANCA SPA	1,030	13.52	13,930.75	
NORDEA BANK ABP	7,720	11.30	87,236.00	
SOCIETE GENERALE	1,600	22.15	35,440.00	
UNICREDIT SPA	3,890	32.53	126,561.15	
ADYEN NV	60	1,197.60	71,856.00	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	4,610	14.41	66,448.54	
DEUTSCHE BOERSE AG	530	182.25	96,592.50	
EDENRED	658	40.54	26,675.32	
EURONEXT NV	240	89.30	21,432.00	
EXOR NV	344	96.85	33,316.40	
NEXI SPA	1,336	5.65	7,559.08	
AEGON LTD	4,432	5.67	25,164.89	

	ALLIANZ SE-REG	980	253.40	248,332.00	
	ASSICURAZIONI GENERALI	2,840	22.59	64,155.60	
	AXA SA	4,660	29.43	137,143.80	
	HANNOVER RUECK SE-REG	148	226.60	33,536.80	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	340	456.80	155,312.00	
	NN GROUP NV	680	41.34	28,111.20	
	SAMPO OYJ-A SHS	1,336	39.29	52,491.44	
	BECHTLE AG	230	44.46	10,225.80	
	CAP GEMINI SA	390	182.30	71,097.00	
	DASSAULT SYSTEMES SE	1,860	35.71	66,420.60	
	NEMETSCHEK SE	178	90.70	16,144.60	
	SAP SE	2,560	174.78	447,436.80	
	NOKIA OYJ	14,570	3.38	49,348.59	
	CELLNEX TELECOM SA	1,417	32.39	45,896.63	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	7,980	22.63	180,587.40	
	KONINKLIJKE KPN NV	9,792	3.49	34,232.83	
	ORANGE S.A.	5,254	9.29	48,820.16	
	TELECOM ITALIA SPA	22,100	0.22	4,945.98	
	TELEFONICA SA	13,410	4.11	55,115.10	
	E.ON SE	5,959	12.43	74,070.37	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	9,250	3.67	33,956.75	
	ENEL SPA	21,380	6.33	135,485.06	
	ENGIE	4,990	13.27	66,217.30	
	FORTUM OYJ	1,026	14.20	14,569.20	
	IBERDROLA SA	14,530	12.12	176,176.25	
	RWE AG	1,700	33.16	56,372.00	
	SNAM SPA	7,266	4.28	31,127.54	
	TERNA SPA	4,271	7.49	31,998.33	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	2,070	27.92	57,794.40	
	VERBUND AG	152	73.55	11,179.60	
	ASM INTERNATIONAL NV	116	675.80	78,392.80	
	ASML HOLDING NV	980	953.00	933,940.00	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	180	153.60	27,648.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	3,220	36.50	117,530.00	
	STMICROELECTRONICS NV	1,810	39.40	71,323.05	
	LEG IMMOBILIEN SE	250	77.20	19,300.00	
	VONOVIA SE	1,810	26.98	48,833.80	
ユーロ小計		447,555		12,484,448.13 (2,105,377,332)	
英ポンド	BP PLC	40,920	4.60	188,232.00	
	SHELL PLC-NEW	15,700	27.11	425,627.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	3,170	23.88	75,715.45	

ANTOFAGASTA PLC	1,183	20.41	24,145.03	
CRODA INTERNATIONAL PLC	385	41.27	15,888.95	
GLENCORE PLC	24,430	4.54	111,046.56	
MONDI PLC	1,253	14.63	18,331.39	
RIO TINTO PLC	2,840	52.19	148,219.60	
ASHTEAD GROUP PLC	1,030	54.22	55,846.60	
BAE SYSTEMS PLC ORD	7,280	13.35	97,188.00	
BUNZL PLC	865	29.22	25,275.30	
DCC PLC	217	55.50	12,043.50	
MELROSE INDUSTRIES PLC	3,490	6.00	20,960.94	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	20,630	4.57	94,444.14	
SPIRAX GROUP PLC	235	84.85	19,939.75	
EXPERIAN PLC	2,560	37.07	94,899.20	
INTERTEK GROUP PLC	590	47.44	27,989.60	
RELX PLC	4,730	35.58	168,293.40	
RENTOKIL INITIAL PLC	5,870	4.47	26,244.77	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,356	4.88	11,518.48	
BURBERRY GROUP PLC	993	9.80	9,733.38	
PERSIMMON PLC	994	14.20	14,114.80	
TAYLOR WIMPEY PLC	6,807	1.48	10,094.78	
COMPASS GROUP PLC	4,620	22.17	102,425.40	
ENTAIN PLC	1,657	6.56	10,869.92	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	443	138.35	61,289.05	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	510	81.80	41,718.00	
PEARSON PLC	1,530	9.49	14,519.70	
WHITBREAD PLC	639	29.12	18,607.68	
AUTO TRADER GROUP PLC	2,915	8.19	23,873.85	
INFORMA PLC	4,393	8.42	37,006.63	
WPP PLC	3,319	7.35	24,407.92	
JD SPORTS FASHION PLC	8,520	1.20	10,287.90	
KINGFISHER PLC	6,190	2.48	15,388.34	
NEXT PLC	260	90.08	23,420.80	
TESCO PLC	20,870	3.10	64,738.74	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	857	24.83	21,279.31	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	5,510	23.92	131,799.20	
COCA-COLA HBC AG-CDI	556	26.92	14,967.52	
DIAGEO PLC	5,280	25.79	136,171.20	
IMPERIAL BRANDS PLC	2,070	19.99	41,389.65	
HALEON PLC	14,310	3.24	46,407.33	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,820	43.93	79,952.60	
UNILEVER PLC	6,080	44.50	270,560.00	
SMITH & NEPHEW PLC	1,973	9.99	19,722.10	

	ASTRAZENECA PLC	3,810	125.10	476,631.00	
	GSK PLC	10,170	16.04	163,177.65	
	BARCLAYS PLC	35,650	2.02	72,013.00	
	HSBC HOLDINGS PLC	46,460	6.76	314,441.28	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	151,180	0.54	81,909.32	
	NATWEST GROUP PLC	16,560	3.07	50,872.32	
	STANDARD CHARTERED PLC	5,050	7.24	36,572.10	
	3I GROUP PLC	2,819	30.40	85,697.60	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	913	10.51	9,595.63	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	1,020	94.34	96,226.80	
	WISE PLC - A	1,551	7.13	11,066.38	
	ADMIRAL GROUP PLC	760	25.51	19,387.60	
	AVIVA PLC	7,600	4.76	36,176.00	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	14,010	2.24	31,480.47	
	PRUDENTIAL PLC	6,840	7.00	47,880.00	
	SAGE GROUP PLC/THE	3,107	10.56	32,825.45	
	HALMA PLC	1,095	26.45	28,962.75	
	BT GROUP PLC	16,090	1.39	22,453.59	
	VODAFONE GROUP PLC	59,770	0.68	41,217.39	
	CENTRICA PLC	15,090	1.32	19,918.80	
	NATIONAL GRID PLC	11,805	8.82	104,120.10	
	SEVERN TRENT PLC	682	24.74	16,872.68	
	SSE PLC	2,750	17.67	48,592.50	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,628	10.36	16,874.22	
英ポンド小計		659,260		4,771,560.09 (953,691,715)	
スイスフラン	GIVAUDAN-REG	23	4,296.00	98,808.00	
	HOLCIM LTD	1,260	80.04	100,850.40	
	SIG GROUP AG	1,130	16.06	18,147.80	
	SIKA AG-REG	410	255.90	104,919.00	
	ABB LTD-REG	3,850	49.89	192,076.50	
	GEBERIT AG-REG	96	542.20	52,051.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	145	235.40	34,133.00	
	VAT GROUP AG	70	497.50	34,825.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	419	31.10	13,030.90	
	SGS SA-REG	425	81.80	34,765.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	110	256.50	28,215.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	1,320	143.85	189,882.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	95	185.25	17,598.75	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	1	10,750.00	10,750.00	
	NESTLE SA-REG	6,560	95.28	625,036.80	
	ALCON INC	1,390	80.44	111,811.60	

	SONOVA HOLDING AG-REG	153	276.90	42,365.70	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	290	110.60	32,074.00	
	BACHEM HOLDING AG	120	79.25	9,510.00	
	LONZA GROUP AG-REG	190	480.30	91,257.00	
	NOVARTIS AG-REG	4,860	95.01	461,748.60	
	ROCHE HOLDING AG-BR	90	273.60	24,624.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,710	247.60	423,396.00	
	SANDOZ GROUP AG	1,052	31.89	33,548.28	
	JULIUS BAER GROUP LTD	579	50.60	29,297.40	
	PARTNERS GROUP HOLDIING AG	63	1,154.50	72,733.50	
	UBS GROUP AG-REG	8,040	26.92	216,436.80	
	BALOISE HOLDING AG - REG	160	155.30	24,848.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	87	632.20	55,001.40	
	SWISS RE AG	760	108.90	82,764.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	370	471.40	174,418.00	
	TEMENOS AG	155	59.90	9,284.50	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	484	88.38	42,775.92	
	SWISSCOM AG-REG	80	496.00	39,680.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	220	83.40	18,348.00	
スイスフラン小計		36,767		3,551,012.05 (627,960,970)	
スウェーデンクローナ	BOLIDEN AB	620	339.40	210,428.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	1,812	155.05	280,950.60	
	ALFA LAVAL AB	680	464.60	315,928.00	
	ASSA ABLOY AB-B	2,713	302.40	820,411.20	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	6,260	200.20	1,253,252.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	4,540	172.95	785,193.00	
	BEIJER REF AB	960	164.55	157,968.00	
	EPIROC AB-A	2,430	211.80	514,674.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	1,126	88.40	99,538.40	
	INDUTRADE AB	620	272.20	168,764.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	349	296.00	103,304.00	
	LIFCO AB-B SHS	830	283.40	235,222.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	3,908	47.26	184,692.08	
	SAAB AB-B	800	241.00	192,800.00	
	SANDVIK AB	3,052	215.70	658,316.40	
	SKANSKA AB-B SHS	1,056	187.55	198,052.80	
	SKF AB-B SHARES-B	1,125	207.10	232,987.50	
	VOLVO AB-B SHS-B	4,120	263.60	1,086,032.00	
	SECURITAS AB-B SHS	1,160	104.00	120,640.00	
	EVOLUTION AB	458	1,056.00	483,648.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	1,260	188.60	237,636.00	

	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,708	278.60	475,848.80	
	GETINGE AB-B SHS	650	182.80	118,820.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	540	270.00	145,800.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	4,444	152.80	679,043.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	4,361	100.25	437,190.25	
	SWEDBANK AB - A SHARES	2,010	214.60	431,346.00	
	EQT AB	830	312.50	259,375.00	
	INVESTOR AB-B SHS	4,550	283.75	1,291,062.50	
	ERICSSON LM-B SHS	7,741	61.78	478,238.98	
	HEXAGON AB-B SHS	5,010	116.50	583,665.00	
	TELE2 AB-B SHS	1,460	104.40	152,424.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	2,238	68.54	153,392.52	
	SAGAX AB-B	600	266.40	159,840.00	
スウェーデンクローナ小計		76,021		13,706,484.23 (205,186,068)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	1,130	255.10	288,263.00	
	EQUINOR ASA	2,610	289.70	756,117.00	
	NORSK HYDRO A S	4,055	64.84	262,926.20	
	YARA INTERNATIONAL ASA	429	298.20	127,927.80	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	210	871.50	183,015.00	
	MOWI ASA	1,466	189.45	277,733.70	
	DNB BANK ASA	1,990	205.70	409,343.00	
	TELENOR ASA	2,000	122.90	245,800.00	
ノルウェークローネ小計		13,890		2,551,125.70 (37,680,126)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	820	407.40	334,068.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,706	182.05	492,627.30	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	10	11,120.00	111,200.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	10	11,400.00	114,000.00	
	DSV A/S	380	1,081.50	410,970.00	
	PANDORA A/S	230	1,052.50	242,075.00	
	CARLSBERG AS-B	293	938.20	274,892.60	
	COLOPLAST-B	302	851.60	257,183.20	
	DEMANT A/S	302	326.40	98,572.80	
	GENMAB A/S	200	1,832.50	366,500.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	8,030	991.00	7,957,730.00	
	DANSKE BANK A/S	2,079	202.40	420,789.60	
	TRYG A/S	1,030	143.10	147,393.00	
	ORSTED A/S	528	385.80	203,702.40	
デンマーククローネ小計		16,920		11,431,703.90 (258,356,508)	
豪ドル	SANTOS LTD	8,590	7.47	64,167.30	

	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	5,000	27.26	136,300.00	
	BHP GROUP LTD	12,250	43.09	527,852.50	
	FORTESCUE LTD	4,520	23.20	104,864.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	1,306	48.30	63,079.80	
	MINERAL RESOURCES LTD	530	62.37	33,056.10	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	3,384	13.43	45,447.12	
	PILBARA MINERALS LTD	8,230	3.24	26,665.20	
	RIO TINTO LTD	960	120.20	115,392.00	
	SOUTH32 LTD	12,462	3.66	45,610.92	
	BRAMBLES LTD	3,858	14.52	56,018.16	
	COMPUTERSHARE LTD	1,410	26.47	37,322.70	
	AURIZON HOLDINGS LTD	5,319	3.65	19,414.35	
	TRANSURBAN GROUP	8,520	12.50	106,500.00	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,665	46.68	77,722.20	
	LOTTERY CORP LTD/THE	7,922	5.19	41,115.18	
	CAR GROUP LTD	930	35.07	32,615.10	
	SEEK LTD	1,090	23.06	25,135.40	
	WESFARMERS LTD	3,000	67.40	202,200.00	
	COLES GROUP LTD	3,500	16.99	59,465.00	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	2,800	32.59	91,252.00	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	2,315	12.06	27,918.90	
	COCHLEAR LTD	160	323.51	51,761.60	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	450	48.29	21,730.50	
	SONIC HEALTHCARE LTD	1,188	25.34	30,103.92	
	CSL LTD	1,230	289.10	355,593.00	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	7,630	28.75	219,362.50	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	4,030	125.31	504,999.30	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	8,460	35.02	296,269.20	
	WESTPAC BANKING CORP	8,720	26.79	233,608.80	
	ASX LTD	514	56.45	29,015.30	
	MACQUARIE GROUP LTD	910	190.74	173,573.40	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	8,157	6.59	53,754.63	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	7,650	3.69	28,228.50	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	3,874	18.31	70,932.94	
	SUNCORP GROUP LTD	4,089	16.39	67,018.71	
	WISETECH GLOBAL LTD	485	96.15	46,632.75	
	XERO LTD	420	130.94	54,994.80	
	TELSTRA GROUP LTD	10,933	3.50	38,265.50	
	ORIGIN ENERGY LTD	3,430	10.08	34,574.40	
豪ドル小計		171,891		4,249,533.68 (442,673,923)	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	1,488	30.77	45,785.76	

ニュージーランドドル	MERCURY NZ LTD	2,262	6.69	15,132.78	
	MERIDIAN ENERGY LTD	3,409	6.37	21,715.33	
ニュージーランドドル小計		7,159		82,633.87 (7,987,389)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	6,690	36.85	246,526.50	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	4,000	95.60	382,400.00	
	MTR CORP	5,500	24.90	136,950.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	3,000	20.70	62,100.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	6,161	39.05	240,587.05	
	SANDS CHINA LTD	7,650	17.80	136,170.00	
	WH GROUP LTD	25,500	5.17	131,835.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	10,731	24.40	261,836.40	
	HANG SENG BANK LTD	2,150	107.20	230,480.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	2,971	257.60	765,329.60	
	AIA GROUP LTD	28,540	55.50	1,583,970.00	
	CLP HOLDINGS LTD	4,694	65.40	306,987.60	
	HONG KONG & CHINA GAS	32,768	5.93	194,314.24	
	POWER ASSETS HOLDINGS	4,000	42.60	170,400.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	5,073	29.40	149,146.20	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	4,433	71.60	317,402.80	
	WHARF HOLDINGS LTD	3,000	23.15	69,450.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	5,000	21.55	107,750.00	
香港ドル小計		161,861		5,493,635.39 (110,751,689)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	5,283	6.53	34,497.99	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	4,100	6.73	27,593.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	16,200	0.87	14,094.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	5,062	35.48	179,599.76	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	9,508	14.14	134,443.12	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	3,642	30.57	111,335.94	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	26,600	2.55	67,830.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	8,911	2.63	23,435.93	
シンガポールドル小計		79,306		592,829.74 (69,046,879)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	2,760	16.49	45,512.40	
	ELBIT SYSTEMS LTD	70	674.80	47,236.00	
	BANK HAPOALIM BM	4,308	33.01	142,207.08	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	4,930	30.49	150,315.70	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	370	130.60	48,322.00	
	NICE LTD	172	621.70	106,932.40	
イスラエルシュケル小計		12,610		540,525.58 (22,891,636)	

合　　計	2,675,200		23,685,631,742 (23,685,631,742)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	409	47,574.88	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	800	28,352.00	
		AMERICAN TOWER CORP	1,160	228,554.80	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	1,163	23,515.86	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	410	82,774.90	
		BOSTON PROPERTIES INC	500	30,820.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	291	31,439.64	
		CROWN CASTLE INC	1,060	105,046.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	750	112,440.00	
		EQUINIX INC	230	176,239.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	497	31,171.84	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	1,040	69,378.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	175	48,737.50	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	490	76,719.30	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	640	27,782.40	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1,820	35,763.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	1,967	35,051.94	
		INVITATION HOMES INC	1,640	58,220.00	
		IRON MOUNTAIN INC	818	72,000.36	
		KIMCO REALTY CORP	1,600	30,000.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	300	41,796.00	
		PROLOGIS INC	2,210	248,160.90	
		PUBLIC STORAGE	390	110,467.50	
		REALTY INCOME CORP	2,240	119,548.80	
		REGENCY CENTERS CORP	482	29,773.14	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	210	41,151.60	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	770	114,599.10	
		SUN COMMUNITIES INC	317	36,974.88	
		UDR INC	827	33,311.56	
		VENTAS INC	1,190	59,619.00	
		VICI PROPERTIES INC	2,730	77,231.70	
		WELLTOWER INC	1,360	141,494.40	
		WEYERHAEUSER CO	1,690	49,010.00	
		WP CAREY INC	594	33,317.46	
米ドル小計			32,770	2,488,038.66 (391,940,730)	
ユーロ	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	351	25,447.50	

ユーロ小計			351	25,447.50 (4,291,466)	
英ポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	1,694	10,536.68	
		SEGRO PLC	3,361	30,551.49	
英ポンド小計			5,055	41,088.17 (8,212,292)	
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	2,875	18,658.75	
		GOODMAN GROUP	4,311	154,204.47	
		MIRVAC GROUP	11,628	21,918.78	
		SCENTRE GROUP	15,350	47,892.00	
		STOCKLAND	5,114	22,706.16	
		VICINITY CENTRES	10,480	19,492.80	
豪ドル小計			49,758	284,872.96 (29,675,216)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	6,680	217,768.00	
香港ドル小計			6,680	217,768.00 (4,390,202)	
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	17,278	33,519.32	
シンガポールドル小計			17,278	33,519.32 (3,903,995)	
合計				442,413,901 (442,413,901)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種　類	銘柄数		組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式	575銘柄	97.9%	—	75.0%
	投資証券	34銘柄	—	2.1%	1.6%
加ドル	株式	71銘柄	100.0%	—	3.1%
ユーロ	株式	176銘柄	99.8%	—	8.7%
	投資証券	1銘柄	—	0.2%	0.0%
英ポンド	株式	69銘柄	99.1%	—	4.0%
	投資証券	2銘柄	—	0.9%	0.0%
スイスフラン	株式	35銘柄	100.0%	—	2.6%
スウェーデンクローナ	株式	34銘柄	100.0%	—	0.9%
ノルウェークローネ	株式	8銘柄	100.0%	—	0.2%
デンマーククローネ	株式	14銘柄	100.0%	—	1.1%
豪ドル	株式	40銘柄	93.7%	—	1.8%
	投資証券	6銘柄	—	6.3%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	3銘柄	100.0%	—	0.0%

香港ドル	株式	18銘柄	96.2%	—	0.5%
	投資証券	1銘柄	—	3.8%	0.0%
シンガポールドル	株式	8銘柄	94.6%	—	0.3%
	投資証券	1銘柄	—	5.4%	0.0%
イスラエルシュケル	株式	6銘柄	100.0%	—	0.1%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

海外新興国株式インデックスＭＳＣＩエマージング（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 6月17日現在
資産の部	
流動資産	
預金	311,121,246
コール・ローン	245,939,316
株式	120,619,745,465
投資証券	96,118,756
派生商品評価勘定	1,736,037
未収入金	1,130,137
未収配当金	367,706,443
未収利息	37,098
差入委託証拠金	5,916,574,464
流動資産合計	127,560,108,962
資産合計	127,560,108,962
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,775,840
未払金	120,399,923
未払解約金	25,640,857
流動負債合計	156,816,620
負債合計	156,816,620
純資産の部	
元本等	
元本	43,369,368,369
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	84,033,923,973
元本等合計	127,403,292,342
純資産合計	127,403,292,342
負債純資産合計	127,560,108,962

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 6月17日現在
１．	期首	2023年 6月20日
	期首元本額	44,618,770,595円
	期首からの追加設定元本額	7,896,564,098円
	期首からの一部解約元本額	9,145,966,324円
	元本の内訳　※	
	日興五大陸株式ファンド	1,923,435,277円
	インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	20,237,475,250円
	インデックスファンド新興国株式（適格機関投資家向け）	3,192,053,880円
	グローバル３倍３分法ファンド（適格機関投資家向け）	17,036,807,408円
	Ｔｒａｃｅｒｓ　グローバル３分法（おとなのバランス）	3,967,763円
	インデックスファンドＭＳＣＩオール・カントリー（全世界株式）	833,557,714円
	Ｔｒａｃｅｒｓ　ＭＳＣＩオール・カントリー・インデックス（全世界株式）	140,647,892円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	981,209円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）	441,976円
	計	43,369,368,369円
２．	受益権の総数	43,369,368,369口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2023年 6月20日 至 2024年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

（2024年 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	131,822,984
投資証券	△9,705,701
合計	122,117,283

(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	6,746,588,507	－	6,737,246,978	△9,341,529
合計		6,746,588,507	－	6,737,246,978	△9,341,529

（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	185,555,000	－	185,856,726	301,726
	米ドル	185,555,000	－	185,856,726	301,726
合計		185,555,000	－	185,856,726	301,726

（注）1.時価の算定方法

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

①同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2024年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	2.9376円
(1万口当たり純資産額)	(29,376円)

附属明細表

第１　有価証券明細表
(1)株式

通 貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	COSAN SA -ADR	3,000	9.45	28,350.00	
	GAZPROM PAO-SPON ADR	649,360	—	—	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	110,100	1.89	208,639.50	
	LUKOIL PJSC	43,315	0.00	4.33	
	LUKOIL PJSC-SPON-ADR	2,640	—	—	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	10,221	—	—	
	PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR	9,100	13.59	123,669.00	
	PETROLEO BRASILEIRO-SPON ADR	8,300	12.91	107,153.00	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	126,380	—	—	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	174,750	—	—	
	TATNEFT-SPONSORED-ADR	27,469	0.00	2.74	
	CEMEX SAB-SPONS ADR PART CER	9,800	6.43	63,014.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	20,850	16.81	350,488.50	
	GERDAU SA -SPON ADR	13,862	3.13	43,388.06	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	72,014	—	—	
	NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	18,540	—	—	
	PHOSAGRO PJSC REG S-GDR	17,606	0.00	1.76	
	PHOSAGRO PJSC REG S-GDR(FUKA)	113	0.00	0.01	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	7,870	—	—	
	SEVERSTAL - GDR REG S	26,330	—	—	
	SOUTHERN COPPER CORP(US)	8,558	106.30	909,715.40	
	SUZANO SA - SPON ADR	9,350	9.06	84,711.00	
	QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	5,451	42.42	231,231.42	
	GRUPO AEROPORTUARIO PAC-ADR	500	166.28	83,140.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	44,050	22.46	989,363.00	
	NIO INC - ADR	143,050	4.33	619,406.50	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	21,672	34.12	739,448.64	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	47,500	10.91	518,225.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	42,100	33.91	1,427,611.00	
	AUTOHOME INC-ADR	7,790	27.37	213,212.30	
	IQIYI INC-ADR	44,800	4.13	185,024.00	
	KANZHUN LTD-ADR	24,650	20.28	499,902.00	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	77,050	14.80	1,140,340.00	
	VK IPJSC -GDR	15,200	—	—	
	YANDEX NV-A	35,050	0.00	3.50	
	OZON HOLDINGS PLC - ADR	6,400	—	—	
	PDD HOLDINGS INC-ADR	60,520	148.98	9,016,269.60	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	36,448	15.06	548,906.88	

	SENDAS DISTRIBUIDORA-ADR	14,150	10.91	154,376.50	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	15,430	0.00	1.54	
	AMBEV SA-ADR	34,100	2.11	71,951.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SP ADR	1,000	84.65	84,650.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEX-SP ADR	1,150	106.24	122,176.00	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	8,100	42.45	343,845.00	
	BANCO BRADESCO-ADR	36,400	2.39	86,996.00	
	BANCO DE CHILE-ADR	900	22.89	20,601.00	
	BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	2,500	18.51	46,275.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	292,200	1.58	461,676.00	
	CREDICORP LTD	6,925	155.97	1,080,092.25	
	ITAU UNIBANCO H-SPON PRF ADR-ADR	26,750	5.80	155,150.00	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	576,360	0.00	57.63	
	SBERBANK PJSC-SPONSORED ADR	51,750	—	—	
	TCS GROUP HOLDING -REG S-GDR	13,410	—	—	
	VTB BANK PJSC	336,460,000	0.00	33,646.00	
	QIFU TECHNOLOGY INC-ADR	11,900	20.10	239,190.00	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	54,288	1.68	91,692.43	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B(N)	10,857	1.68	18,337.47	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	60,892	—	—	
	TELEFONICA BRASIL-ADR	5,687	8.35	47,486.45	
	TIM SA-ADR	6,300	14.81	93,303.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BR-SP ADR	82,600	6.61	545,986.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE-ADR	1,700	13.92	23,664.00	
	ENEL CHILE SA-ADR	12,300	2.73	33,579.00	
	KE HOLDINGS INC-ADR	72,120	15.71	1,133,005.20	
米ドル小計		339,841,528		23,018,958.61 (3,626,176,549)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	1,475,603	11.89	17,544,919.67	
	GRUPO MEXICO SA-SER B	318,754	93.19	29,704,685.26	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	19,850	240.24	4,768,764.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	101,665	27.06	2,751,054.90	
	ALFA S.A.B.-A	322,500	10.52	3,392,700.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	56,300	134.28	7,559,964.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	34,562	308.67	10,668,252.54	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	18,675	565.31	10,557,164.25	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	29,300	159.01	4,658,993.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	21,040	176.73	3,718,399.20	
	WALMART DE MEXICO -SER V	524,300	60.60	31,772,580.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	48,500	178.52	8,658,220.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	40,100	156.68	6,282,868.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	183,154	196.05	35,907,341.70	
	GRUMA S.A.B.-B	17,160	340.97	5,851,045.20	

	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	140,200	67.02	9,396,204.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	164,470	32.30	5,312,381.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	80,800	50.82	4,106,256.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	265,647	137.43	36,507,867.21	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	184,100	41.93	7,719,313.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,889,749	15.66	29,593,469.34	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	145,200	17.00	2,468,400.00	
メキシコペソ小計		6,081,629		278,900,842.27 (2,373,697,178)	
ブラジルレアル	COSAN SA	111,200	12.67	1,408,904.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	356,160	36.63	13,046,140.80	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	464,960	34.68	16,124,812.80	
	PRIO SA	83,600	42.01	3,512,036.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	77,480	21.75	1,685,190.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL	64,800	12.03	779,544.00	
	GERDAU SA-PREF	127,890	17.00	2,174,130.00	
	KLABIN SA - UNIT	89,210	20.36	1,816,315.60	
	SUZANO SA	71,547	48.97	3,503,656.59	
	VALE SA	348,106	60.62	21,102,185.72	
	WEG SA	167,972	38.77	6,512,274.44	
	CCR SA	110,220	11.59	1,277,449.80	
	LOCALIZA RENT A CAR SA	94,254	40.42	3,809,746.68	
	RUMO SA	134,400	19.77	2,657,088.00	
	LOJAS RENNER S.A.	98,662	12.79	1,261,886.98	
	VIBRA ENERGIA SA	120,200	20.72	2,490,544.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	67,500	9.52	642,600.00	
	RAIA DROGASIL SA	131,916	25.70	3,390,241.20	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	77,900	11.66	908,314.00	
	AMBEV SA	446,100	11.24	5,014,164.00	
	BRF SA	59,500	18.63	1,108,485.00	
	JBS SA	80,500	28.61	2,303,105.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	94,532	14.80	1,399,073.60	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	536,163	3.75	2,010,611.25	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	59,600	26.93	1,605,028.00	
	HYPERMARCAS SA	44,600	28.74	1,281,804.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	135,240	11.38	1,539,031.20	
	BANCO BRADESCO SA-PRF	530,979	12.83	6,812,460.57	
	BANCO DO BRASIL S.A.	171,100	26.45	4,525,595.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	464,715	31.14	14,471,225.10	
	ITAUSA SA-PRF	545,355	9.57	5,219,047.35	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	580,749	10.37	6,022,367.13	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	117,200	31.90	3,738,680.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	68,700	32.46	2,230,002.00	

	CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	58,200	14.48	842,736.00	
	TOTVS SA	62,700	30.59	1,917,993.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	36,375	44.90	1,633,237.50	
	TIM SA	56,736	15.87	900,400.32	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	28,700	39.80	1,142,260.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	42,700	35.69	1,523,963.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	190,438	10.01	1,906,284.38	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PRF-B	97,500	9.35	911,625.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	31,460	75.00	2,359,500.00	
	CPFL ENERGIA SA	23,300	32.73	762,609.00	
	ENERGISA SA-UNITS	23,800	45.37	1,079,806.00	
	ENEVA SA	72,900	12.50	911,250.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	21,050	44.16	929,568.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	107,249	29.78	3,193,875.22	
ブラジルレアル小計		7,586,118		167,398,847.23 (4,901,756,304)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	39,100	7,386.00	288,792,600.00	
	EMPRESAS CMPC SA	109,000	1,851.30	201,791,700.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B-PRF	9,450	39,787.00	375,987,150.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	1,875,000	59.50	111,562,500.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	18,580,000	12.47	231,692,600.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	89,300	2,998.00	267,721,400.00	
	CENCOSUD SA	130,150	1,770.00	230,365,500.00	
	BANCO DE CHILE	4,238,027	106.99	453,426,508.73	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,616	26,484.00	175,218,144.00	
	BANCO SANTANDER CHILE SA	6,020,500	43.41	261,349,905.00	
	ENEL AMERICAS SA	2,277,620	88.38	201,296,055.60	
	ENEL CHILE SA	2,487,370	51.62	128,398,039.40	
チリペソ小計		35,862,133		2,927,602,102.73 (493,180,922)	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	25,330	34,760.00	880,470,800.00	
	BANCOLOMBIA SA-PRF	47,200	33,500.00	1,581,200,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	44,210	17,520.00	774,559,200.00	
コロンビアペソ小計		116,740		3,236,230,000.00 (123,154,732)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	7,430	24.40	181,292.00	
	MYTILINEOS S.A.	9,960	35.12	349,795.20	
	OPAP SA	17,710	14.83	262,639.30	
	JUMBO SA	12,640	25.62	323,836.80	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	227,400	1.54	350,196.00	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	267,800	2.04	548,186.60	
	NATIONAL BANK OF GREECE	75,890	7.89	598,772.10	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	110,500	3.60	397,800.00	

	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,200	13.55	273,710.00	
	PUBLIC POWER CORP	21,300	10.60	225,780.00	
ユーロ小計		770,830		3,512,008.00 (592,265,029)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	97,750	167.00	16,324,250.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	151,667	51.60	7,826,017.20	
	SASA POLYESTER SANAYI	159,739	44.36	7,086,022.04	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	153,200	59.35	9,092,420.00	
	KOC HOLDING AS	73,684	217.50	16,026,270.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	152,600	48.36	7,379,736.00	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	21,261	230.30	4,896,408.30	
	TURK HAVA YOLLARI AO	53,650	311.75	16,725,387.50	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	7,470	1,079.00	8,060,130.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	12,000	315.50	3,786,000.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	46,160	553.00	25,526,480.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	7,350	806.00	5,924,100.00	
	AKBANK T.A.S.	313,789	61.10	19,172,507.90	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	95,700	93.85	8,981,445.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	882,920	16.18	14,285,645.60	
	YAPI VE KREDI BANKASI	361,000	32.58	11,761,380.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	116,756	98.60	11,512,141.60	
トルコリラ小計		2,706,696		194,366,341.14 (939,916,752)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	8,160	763.00	6,226,080.00	
	MONETA MONEY BANK AS	39,000	98.00	3,822,000.00	
	CEZ AS	16,660	951.50	15,851,990.00	
チェココルナ小計		63,820		25,900,070.00 (176,545,237)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	49,270	2,822.00	139,039,940.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	15,070	9,300.00	140,151,000.00	
	OTP BANK PLC	21,935	17,275.00	378,927,125.00	
ハンガリーフォリント小計		86,275		658,118,065.00 (278,657,718)	
ポーランドズロチ	ORLEN SA	58,279	63.45	3,697,802.55	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	15,980	141.45	2,260,371.00	
	BUDIMEX	1,250	672.50	840,625.00	
	LPP SA	114	16,680.00	1,901,520.00	
	CD PROJEKT SA	6,650	133.80	889,770.00	
	ALLEGRO.EU SA	57,990	36.76	2,132,002.35	
	DINO POLSKA SA	5,040	398.10	2,006,424.00	
	BANK PEKAO SA	19,012	155.75	2,961,119.00	
	MBANK SA	1,620	585.00	947,700.00	
	PKO BANK POLSKI SA	87,295	57.30	5,002,003.50	

	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,640	492.60	1,793,064.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	57,400	48.34	2,774,716.00	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	86,630	6.70	580,421.00	
ポーランドズロチ小計		400,900		27,787,538.40 (1,070,362,085)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO - H	216,000	9.80	2,116,800.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	192,000	7.35	1,411,200.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,497,300	4.70	11,737,310.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	325,500	39.60	12,889,800.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	124,000	10.00	1,240,000.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,057,000	7.61	15,653,770.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	230,000	18.12	4,167,600.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	415,000	5.53	2,294,950.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	122,000	17.62	2,149,640.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	245,000	11.90	2,915,500.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	392,000	2.88	1,128,960.00	
	CMOC GROUP LTD-H	351,000	7.07	2,481,570.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H	42,960	19.06	818,817.60	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	119,000	15.64	1,861,160.00	
	MMG LTD	308,000	2.98	917,840.00	
	MMG LTD-RIGHTS(N)	123,200	0.36	44,352.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	77,250	15.94	1,231,365.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	137,000	13.02	1,783,740.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD	521,750	16.54	8,629,745.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	248,000	3.61	895,280.00	
	BOC AVIATION LTD	21,500	56.10	1,206,150.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	290,000	4.21	1,220,900.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	376,000	4.16	1,564,160.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	214,000	10.44	2,234,160.00	
	CITIC LTD	577,000	7.54	4,350,580.00	
	CRRC CORP LTD - H	401,000	4.73	1,896,730.00	
	FOSUN INTERNATIONAL LTD	241,000	4.43	1,067,630.00	
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	69,000	22.90	1,580,100.00	
	HORIZON CONSTRUCTION DEVELOP(N)	45,555	1.90	86,554.50	
	SINOTRUK HONG KONG LTD	67,000	18.82	1,260,940.00	
	WEICHAI POWER CO LTD-H	196,400	14.30	2,808,520.00	
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	63,600	29.90	1,901,640.00	
	CHINA COSCO HOLDINGS-H	295,850	13.52	3,999,892.00	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	125,000	12.16	1,520,000.00	
	JD LOGISTICS INC	196,400	8.52	1,673,328.00	
	JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	158,000	8.37	1,322,460.00	
	ORIENT OVERSEAS INTL LTD	13,500	125.10	1,688,850.00	
	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	183,540	5.12	939,724.80	

BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	310,000	7.13	2,210,300.00	
BYD CO LTD-H	106,500	229.40	24,431,100.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	58,800	44.45	2,613,660.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	627,000	8.89	5,574,030.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	273,500	11.24	3,074,140.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	390,845	3.02	1,180,351.90	
LI AUTO INC-CLASS A	125,100	73.75	9,226,125.00	
XPENG INC - CLASS A SHARES	118,300	28.70	3,395,210.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	132,000	12.22	1,613,040.00	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	52,000	29.45	1,531,400.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	131,800	81.05	10,682,390.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	446,000	4.50	2,007,000.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	236,800	28.75	6,808,000.00	
HISENSE HOME APPLIANCES GR-H	35,000	33.65	1,177,750.00	
LI NING CO LTD	252,500	18.86	4,762,150.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	86,300	83.95	7,244,885.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	168,000	16.52	2,775,360.00	
MEITUAN-CLASS B	516,785	114.70	59,275,239.50	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	150,600	59.70	8,990,820.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	125,600	16.72	2,100,032.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	131,000	10.54	1,380,740.00	
TRIP.COM GROUP LTD	55,390	396.00	21,934,440.00	
BAIDU INC-CLASS A	231,210	91.60	21,178,836.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	19,517	117.10	2,285,440.70	
CHINA LITERATURE LTD	39,400	28.05	1,105,170.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	644,000	2.15	1,384,600.00	
KINGSOFT CORP LTD	97,200	26.50	2,575,800.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	243,600	50.95	12,411,420.00	
NETEASE INC	196,975	144.10	28,384,097.50	
TENCENT HOLDINGS LTD	675,550	379.80	256,573,890.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,596,700	72.80	116,239,760.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	9,000	55.85	502,650.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	216,800	8.62	1,868,816.00	
JD.COM INC - CL A	242,223	113.90	27,589,199.70	
MINISO GROUP HOLDING LTD	42,000	40.25	1,690,500.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	55,200	39.55	2,183,160.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	212,000	4.90	1,038,800.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	81,500	12.86	1,048,090.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	642,000	3.50	2,247,000.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	116,700	24.60	2,870,820.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	10,200	119.40	1,217,880.00	
CHINA FEIHE LTD	379,000	3.80	1,440,200.00	
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS	90,000	—	—	

CHINA MENGNIU DAIRY CO	335,000	12.76	4,274,600.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	168,500	30.50	5,139,250.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	193,400	39.90	7,716,660.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	184,000	9.84	1,810,560.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	202,000	9.35	1,888,700.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	62,000	53.95	3,344,900.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	517,000	4.25	2,197,250.00	
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	28,200	47.95	1,352,190.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	84,500	25.30	2,137,850.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	37,400	31.50	1,178,100.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	263,600	4.41	1,162,476.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	82,600	11.80	974,680.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	138,000	22.05	3,042,900.00	
AKESO INC - B	53,000	39.85	2,112,050.00	
BEIGENE LTD	74,881	99.10	7,420,707.10	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	193,500	5.78	1,118,430.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	946,160	6.82	6,452,811.20	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	122,000	9.18	1,119,960.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	142,000	17.56	2,493,520.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	131,000	38.30	5,017,300.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,102,750	2.76	3,043,590.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	34,629	33.60	1,163,534.40	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	415,000	11.74	4,872,100.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,719,000	3.21	8,727,990.00	
BANK OF CHINA LTD - H	8,182,000	3.74	30,600,680.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	837,245	5.86	4,906,255.70	
CHINA CITIC BANK - H	929,000	4.71	4,375,590.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	9,861,920	5.50	54,240,560.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	182,000	2.47	449,540.00	
CHINA MERCHANTS BANK - H	382,150	33.75	12,897,562.50	
CHINA MINSHENG BANKING-H	662,640	2.94	1,948,161.60	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,699,575	4.34	29,076,155.50	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	798,000	4.31	3,439,380.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	440,000	4.30	1,892,000.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	177,200	9.39	1,663,908.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	178,675	12.18	2,176,261.50	
FAR EAST HORIZON LTD	246,000	5.22	1,284,120.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	101,000	7.01	708,010.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	237,200	3.99	946,428.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	127,000	8.98	1,140,460.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	801,000	10.80	8,650,800.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	266,400	19.92	5,306,688.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	154,740	8.68	1,343,143.20	

	NEW CHINA LIFE INSURANCE CO-H	81,000	15.86	1,284,660.00	
	PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	867,000	2.67	2,314,890.00	
	PICC PROPERTY & CASUALTY -H	724,001	9.72	7,037,289.72	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	680,500	36.45	24,804,225.00	
	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	300,000	8.20	2,460,000.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	74,500	31.20	2,324,400.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	82,000	37.20	3,050,400.00	
	LENOVO GROUP LTD	820,000	10.74	8,806,800.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	78,000	48.70	3,798,600.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	1,562,800	17.30	27,036,440.00	
	ZTE CORP-H	71,200	17.42	1,240,304.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	4,606,000	1.03	4,744,180.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	56,500	26.85	1,517,025.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	504,000	2.52	1,270,080.00	
	CGN POWER CO LTD-H	1,228,000	3.29	4,040,120.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	287,800	7.45	2,144,110.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	375,000	7.76	2,910,000.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	538,000	3.83	2,060,540.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	96,000	29.25	2,808,000.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	209,000	23.55	4,921,950.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	81,600	69.15	5,642,640.00	
	GUANGDONG INVEST	316,000	4.66	1,472,560.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	404,000	5.60	2,262,400.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	398,000	8.08	3,215,840.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	57,000	13.90	792,300.00	
	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	2,487,000	1.36	3,382,320.00	
	HANERGY THIN FILM POWER GROU	240,000	—	—	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	60,000	23.25	1,395,000.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	522,000	4.35	2,270,700.00	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	73,000	15.62	1,140,260.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	409,820	14.46	5,925,997.20	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	337,777	27.00	9,119,979.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	72,000	28.00	2,016,000.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	209,526	5.30	1,110,487.80	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	203,000	12.36	2,509,080.00	
香港ドル小計		81,254,789		1,178,153,402.62 (23,751,572,596)	
マレーシアリンギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	30,600	17.92	548,352.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	306,400	6.56	2,009,984.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	401,400	5.80	2,328,120.00	
	GAMUDA BHD	228,700	6.54	1,495,698.00	
	SIME DARBY BERHAD	279,020	2.53	705,920.60	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	99,200	9.92	984,064.00	

	MISC BHD	135,900	8.35	1,134,765.00	
	GENTING BHD	218,900	4.69	1,026,641.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	315,400	2.56	807,424.00	
	MR DIY GROUP M BHD	419,750	1.95	818,512.50	
	IOI CORPORATION BERHAD	256,875	3.77	968,418.75	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	52,500	20.50	1,076,250.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6,500	124.20	807,300.00	
	PPB GROUP BERHAD	63,980	14.40	921,312.00	
	QL RESOURCES BHD	114,500	6.30	721,350.00	
	SD GUTHRIE BHD	213,120	4.22	899,366.40	
	IHH HEALTHCARE BHD	202,900	6.25	1,268,125.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	195,800	4.27	836,066.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	667,300	6.92	4,617,716.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	64,800	19.20	1,244,160.00	
	MALAYAN BANKING BHD	550,650	9.94	5,473,461.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	1,522,350	4.08	6,211,188.00	
	RHB BANK BHD	154,859	5.53	856,370.27	
	AXIATA GROUP BERHAD	296,400	2.79	826,956.00	
	CELCOMDIGI BHD	339,600	3.72	1,263,312.00	
	MAXIS BHD	235,400	3.63	854,502.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	128,300	6.52	836,516.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	79,600	17.66	1,405,736.00	
	TENAGA NASIONAL BERHAD	256,925	14.08	3,617,504.00	
	YTL CORP BHD	319,700	3.66	1,170,102.00	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	241,600	5.28	1,275,648.00	
	INARI AMERTRON BHD	324,900	3.83	1,244,367.00	
マレーシアリンギット小計		8,723,829		50,255,207.52 (1,676,136,808)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	146,610	150.50	22,064,805.00	
	PTT PCL-NVDR	1,013,300	31.75	32,172,275.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	138,100	50.75	7,008,575.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	196,800	19.80	3,896,640.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	210,245	30.50	6,412,472.50	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	130,900	33.25	4,352,425.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	81,200	225.00	18,270,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	423,300	60.00	25,398,000.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-NVDR	783,800	8.00	6,270,400.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	911,900	3.44	3,136,936.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	324,068	29.75	9,641,023.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	206,416	31.00	6,398,896.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	665,400	9.05	6,021,870.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	350,000	16.20	5,670,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	598,400	56.00	33,510,400.00	

	CP AXTRA PCL-NVDR	208,700	27.00	5,634,900.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	406,600	22.00	8,945,200.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,144,700	27.25	31,193,075.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	61,500	240.00	14,760,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	60,000	130.00	7,800,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	394,225	17.70	6,977,782.50	
	SCB X PCL-NVDR	85,100	106.00	9,020,600.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	2,342,000	1.68	3,934,560.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	130,400	43.00	5,607,200.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	319,500	79.75	25,480,125.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	118,000	211.00	24,898,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	99,900	73.50	7,342,650.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	1,002,720	8.65	8,673,528.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	177,200	19.50	3,455,400.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	64,900	40.00	2,596,000.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	314,990	39.00	12,284,610.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	214,800	55.75	11,975,100.00	
タイバーツ小計		13,325,674		380,803,448.00 (1,633,646,791)	
フィリピンペソ	AYALA CORPORATION	30,452	573.50	17,464,222.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	300,345	28.05	8,424,677.25	
	SM INVESTMENTS CORP	23,993	832.00	19,962,176.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	101,830	339.60	34,581,468.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	47,540	219.00	10,411,260.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	90,460	104.00	9,407,840.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	182,490	116.00	21,168,840.00	
	BDO UNIBANK INC	242,125	137.90	33,389,037.50	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	188,237	69.40	13,063,647.80	
	PLDT INC	8,365	1,420.00	11,878,300.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	31,630	376.00	11,892,880.00	
	AYALA LAND INC	682,560	27.75	18,941,040.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,074,210	27.15	29,164,801.50	
フィリピンペソ小計		3,004,237		239,750,190.05 (643,921,060)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	1,485,200	2,780.00	4,128,856,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	160,000	21,225.00	3,396,000,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	668,000	12,100.00	8,082,800,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	899,300	1,210.00	1,088,153,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	3,096,796	950.00	2,941,956,200.00	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK PT	785,000	8,575.00	6,731,375,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	283,000	8,675.00	2,455,025,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,173,873	2,270.00	2,664,691,710.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,091,900	4,420.00	9,246,198,000.00	

	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	88,529,000	52.00	4,603,508,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	1,756,200	2,720.00	4,776,864,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	728,100	4,900.00	3,567,690,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	189,400	10,500.00	1,988,700,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAK TBK	452,600	6,075.00	2,749,545,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	753,000	3,200.00	2,409,600,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	2,187,700	1,565.00	3,423,750,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	5,739,900	9,200.00	52,807,080,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	3,831,700	5,750.00	22,032,275,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	1,570,400	4,310.00	6,768,424,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	7,013,300	4,180.00	29,315,594,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,172,900	2,720.00	14,070,288,000.00	
インドネシアルピア小計		128,567,269		189,248,373,410.00 (1,816,784,384)	
韓国ウォン	HD HYUNDAI	4,950	68,700.00	340,065,000.00	
	S-OIL CORPORATION	4,835	67,800.00	327,813,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	6,195	111,900.00	693,220,500.00	
	ENCHEM CO LTD	1,130	297,000.00	335,610,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	14,022	31,050.00	435,383,100.00	
	HYUNDAI STEEL CO	9,690	29,200.00	282,948,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	895	479,500.00	429,152,500.00	
	KUM YANG CO LTD	3,270	88,500.00	289,395,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,970	144,100.00	283,877,000.00	
	LG CHEM LTD	5,067	361,000.00	1,829,187,000.00	
	LG CHEM LTD-PRF	770	255,000.00	196,350,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	2,075	114,000.00	236,550,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	7,430	380,000.00	2,823,400,000.00	
	SKC CO LTD	2,170	195,300.00	423,801,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	5,610	54,000.00	302,940,000.00	
	DOOSAN ENERBILITY	47,160	19,660.00	927,165,600.00	
	ECOPRO BM CO LTD	5,084	200,500.00	1,019,342,000.00	
	ECOPRO CO LTD	10,700	99,400.00	1,063,580,000.00	
	ECOPRO MATERIALS CO LTD	1,350	112,200.00	151,470,000.00	
	GS HOLDINGS	4,395	43,450.00	190,962,750.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	3,610	228,500.00	824,885,000.00	
	HANWHA OCEAN CO LTD	5,559	32,250.00	179,277,750.00	
	HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD	2,190	290,000.00	635,100,000.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	2,190	132,600.00	290,394,000.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	4,417	138,900.00	613,521,300.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	7,560	32,600.00	246,456,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,940	51,500.00	408,910,000.00	
	L&F CO LTD	2,560	161,300.00	412,928,000.00	
	LG CORP	9,611	80,000.00	768,880,000.00	

LG ENERGY SOLUTION	4,755	349,000.00	1,659,495,000.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	3,213	273,000.00	877,149,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	5,510	68,300.00	376,333,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	8,487	133,000.00	1,128,771,000.00	
SAMSUNG E&A CO LTD	16,500	22,950.00	378,675,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	67,519	9,040.00	610,371,760.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,860	44,700.00	127,842,000.00	
SK INC	3,741	177,300.00	663,279,300.00	
SK SQUARE CO LTD	9,853	91,400.00	900,564,200.00	
HANJIN KAL CORP	2,570	72,000.00	185,040,000.00	
HMM CO LTD	25,940	18,050.00	468,217,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,870	189,000.00	353,430,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	14,844	22,250.00	330,279,000.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	7,952	45,700.00	363,406,400.00	
HYUNDAI MOBIS	5,910	238,000.00	1,406,580,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	14,140	268,000.00	3,789,520,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,530	160,400.00	566,212,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	1,910	158,800.00	303,308,000.00	
KIA CORP	26,130	122,700.00	3,206,151,000.00	
COWAY CO LTD	5,640	55,400.00	312,456,000.00	
LG ELECTRONICS INC	10,905	98,900.00	1,078,504,500.00	
HYBE CO LTD	2,420	200,500.00	485,210,000.00	
KAKAO CORP	32,415	43,900.00	1,423,018,500.00	
KRAFTON INC	2,940	272,000.00	799,680,000.00	
NAVER CORP	13,305	169,900.00	2,260,519,500.00	
NCSOFT CORP	1,430	183,300.00	262,119,000.00	
NETMARBLE CORP	2,210	55,900.00	123,539,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	874	382,000.00	333,868,000.00	
KT&G CORP	10,815	86,800.00	938,742,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	2,326	98,900.00	230,041,400.00	
AMOREPACIFIC CORP	2,990	186,600.00	557,934,000.00	
LG H&H	955	401,000.00	382,955,000.00	
HLB INC	12,382	62,300.00	771,398,600.00	
ALTEOGEN INC	4,020	265,000.00	1,065,300,000.00	
CELLTRION INC	15,680	183,400.00	2,875,712,000.00	
CELLTRION PHARM INC	1,875	93,400.00	175,125,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	731	278,000.00	203,218,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,790	737,000.00	1,319,230,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,350	78,300.00	262,305,000.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	2,940	52,000.00	152,880,000.00	
YUHAN CORP	6,079	74,500.00	452,885,500.00	
HANA FINANCIAL GROUP	29,718	58,600.00	1,741,474,800.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	27,600	13,370.00	369,012,000.00	

	KAKAOBANK CORP	16,870	21,600.00	364,392,000.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	38,850	80,900.00	3,142,965,000.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	44,778	46,950.00	2,102,327,100.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	62,591	14,120.00	883,784,920.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,985	65,200.00	259,822,000.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	10,226	73,100.00	747,520,600.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	24,868	6,990.00	173,827,320.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	11,770	11,820.00	139,121,400.00	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	4,850	103,800.00	503,430,000.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3,200	333,000.00	1,065,600,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	8,005	82,900.00	663,614,500.00	
	POSCO DX CO LTD	5,450	41,900.00	228,355,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,980	150,800.00	600,184,000.00	
	COSMOAM&T CO LTD	2,719	162,000.00	440,478,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	30,851	10,040.00	309,744,040.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,485	264,000.00	392,040,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5,865	151,700.00	889,720,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	489,200	79,600.00	38,940,320,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	82,570	64,400.00	5,317,508,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	5,663	383,500.00	2,171,760,500.00	
	KT CORP	6,330	36,400.00	230,412,000.00	
	LG UPLUS CORP.	21,900	9,740.00	213,306,000.00	
	SK TELECOM	5,610	50,900.00	285,549,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	26,740	19,740.00	527,847,600.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	4,550	179,900.00	818,545,000.00	
	SK HYNIX INC	55,300	221,000.00	12,221,300,000.00	
韓国ウォン小計		1,585,235		126,867,790,440.00 (14,500,988,447)	
台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	117,080	65.90	7,715,572.00	
	ASIA CEMENT CORP	209,978	41.80	8,777,080.40	
	CHINA STEEL CORP	1,231,181	23.25	28,624,958.25	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	360,047	52.10	18,758,448.70	
	FORMOSA PLASTICS CORP	396,424	61.00	24,181,864.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	490,145	50.70	24,850,351.50	
	TAIWAN CEMENT	662,420	34.00	22,522,280.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	14,696	1,050.00	15,430,800.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	322,957	35.55	11,481,121.35	
	FORTUNE ELECTRIC CO LTD	12,000	920.00	11,040,000.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	7,000	1,805.00	12,635,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	301,786	37.25	11,241,528.50	
	CHINA AIRLINES LTD	319,000	23.00	7,337,000.00	
	EVA AIRWAYS CORP	281,000	36.15	10,158,150.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	109,200	199.00	21,730,800.00	

TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	203,000	30.00	6,090,000.00	
WAN HAI LINES LTD	69,575	92.80	6,456,560.00	
YANG MING MARINE TRANSPORT	194,000	75.40	14,627,600.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	211,947	49.35	10,459,584.45	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	20,254	535.00	10,835,890.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	63,927	160.00	10,228,320.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	18,000	362.00	6,516,000.00	
POU CHEN	226,145	36.90	8,344,750.50	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	31,620	635.00	20,078,700.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	56,448	272.50	15,382,080.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	472,703	81.70	38,619,835.10	
PHARMAESSENTIA CORP	27,000	482.00	13,014,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	534,348	18.15	9,698,416.20	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,755,746	37.30	65,489,325.80	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,447,229	28.75	41,607,833.75	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,125,910	27.95	31,469,184.50	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	928,004	25.55	23,710,502.20	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,163,496	39.55	46,016,266.80	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,005,297	24.10	24,227,657.70	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,177,195	18.75	22,072,406.25	
TAIWAN BUSINESS BANK	636,928	17.15	10,923,315.20	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,058,215	25.95	27,460,679.25	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	394,610	45.35	17,895,563.50	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	153,479	156.50	24,019,463.50	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	956,938	32.00	30,622,016.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	947,044	58.20	55,117,960.80	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,640,715	15.25	25,020,903.75	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	747,668	76.90	57,495,669.20	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	1,362,954	9.43	12,852,656.22	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	53,000	556.00	29,468,000.00	
ACER INC	324,812	49.80	16,175,637.60	
ADVANTECH CO LTD	46,984	361.50	16,984,716.00	
ASIA VITAL COMPONENTS	33,000	739.00	24,387,000.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	73,797	493.50	36,418,819.50	
AUO CORP	664,795	18.30	12,165,748.50	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	66,405	230.50	15,306,352.50	
COMPAL ELECTRONICS	437,955	35.75	15,656,891.25	
DELTA ELECTRONICS INC	198,541	353.50	70,184,243.50	
E INK HOLDINGS INC	89,000	250.00	22,250,000.00	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	54,000	315.00	17,010,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,260,212	198.00	249,521,976.00	
INNOLUX CORP	891,803	13.60	12,128,520.80	
INVENTEC CORP	289,162	55.40	16,019,574.80	

	LARGAN PRECISION CO LTD	10,786	2,520.00	27,180,720.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	209,787	107.50	22,552,102.50	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	84,000	179.50	15,078,000.00	
	PEGATRON CORP	199,854	115.50	23,083,137.00	
	QUANTA COMPUTER INC	274,416	290.50	79,717,848.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	142,120	82.80	11,767,536.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	145,000	182.50	26,462,500.00	
	WISTRON CORP	271,000	108.50	29,403,500.00	
	WIWYNN CORP	10,000	2,765.00	27,650,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	175,520	86.20	15,129,824.00	
	YAGEO CORPORATION	34,884	696.00	24,279,264.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	69,000	121.00	8,349,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	372,371	128.00	47,663,488.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	178,000	85.70	15,254,600.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	180,188	107.50	19,370,210.00	
	ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	8,000	2,660.00	21,280,000.00	
	ASE INDUSTRIAL HOLDING CO LT	332,387	166.00	55,176,242.00	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	7,100	2,705.00	19,205,500.00	
	GLOBAL UNICHIP CORP	9,000	1,565.00	14,085,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	23,200	534.00	12,388,800.00	
	MEDIATEK INC	154,432	1,395.00	215,432,640.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	140,000	66.20	9,268,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	60,522	614.00	37,160,508.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50,815	569.00	28,913,735.00	
	SILERGY CORP	33,800	526.00	17,778,800.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,518,355	922.00	2,321,923,310.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,191,592	56.30	67,086,629.60	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	100,000	110.00	11,000,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	339,105	24.65	8,358,938.25	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	165,581	45.50	7,533,935.50	
台湾ドル小計		35,439,590		4,716,049,343.67 (22,951,597,340)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	78,450	626.65	49,160,692.50	
	COAL INDIA LTD	153,280	486.95	74,639,696.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	61,380	536.30	32,918,094.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	285,130	170.36	48,574,746.80	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	317,980	275.40	87,571,692.00	
	PETRONET LNG LTD	78,980	323.90	25,581,622.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	309,032	2,955.10	913,220,463.20	
	AMBUJA CEMENTS LIMITED	63,790	677.20	43,198,588.00	
	APL APOLLO TUBES LTD	17,000	1,558.80	26,499,600.00	
	ASIAN PAINTS LTD	40,100	2,921.60	117,156,160.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	27,260	2,471.20	67,364,912.00	

HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	137,870	683.60	94,247,932.00	
JINDAL STAINLESS LTD	33,300	812.40	27,052,920.00	
JINDAL STEEL & POWER LTD	38,230	1,052.45	40,235,163.50	
JSW STEEL LTD	63,540	921.15	58,529,871.00	
NMDC LTD	103,000	267.40	27,542,200.00	
PI INDUSTRIES LTD	8,690	3,639.00	31,622,910.00	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	16,120	3,109.80	50,129,976.00	
SHREE CEMENT LTD	955	27,538.00	26,298,790.00	
SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	2,740	9,898.15	27,120,931.00	
SRF LTD	15,610	2,402.00	37,495,220.00	
SUPREME INDUSTRIES LTD	7,150	6,039.55	43,182,782.50	
TATA STEEL LTD	751,570	183.15	137,650,045.50	
ULTRATECH CEMENT LTD	11,500	11,242.80	129,292,200.00	
UPL LTD	53,425	551.70	29,474,572.50	
VEDANTA LTD	110,860	447.60	49,620,936.00	
ABB INDIA LTD	5,480	9,020.00	49,429,600.00	
ADANI ENTERPRISES LTD	18,040	3,261.75	58,841,970.00	
ASHOK LEYLAND LTD	145,300	239.84	34,848,752.00	
ASTRAL LTD	12,100	2,269.45	27,460,345.00	
BHARAT ELECTRONICS LTD	364,700	309.60	112,911,120.00	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	105,000	305.70	32,098,500.00	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	63,350	688.80	43,635,480.00	
CUMMINS INDIA LTD	13,440	3,825.60	51,416,064.00	
HAVELLS INDIA LTD	25,550	1,839.50	46,999,225.00	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	19,830	5,200.55	103,126,906.50	
LARSEN & TOUBRO LTD	67,720	3,687.80	249,737,816.00	
POLYCAB INDIA LTD	4,610	7,079.90	32,638,339.00	
SIEMENS LTD	8,940	7,790.20	69,644,388.00	
SUZLON ENERGY LTD	904,000	49.48	44,729,920.00	
THERMAX LTD	4,220	5,311.90	22,416,218.00	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	26,000	1,018.20	26,473,200.00	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	54,163	1,430.70	77,491,004.10	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	29,942	1,139.85	34,129,388.70	
GMR AIRPORTS INFRASTRUCTURE	241,000	93.92	22,634,720.00	
INTERGLOBE AVIATION LTD	17,290	4,270.40	73,835,216.00	
BAJAJ AUTO LTD	6,520	9,961.75	64,950,610.00	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	7,940	3,240.60	25,730,364.00	
BHARAT FORGE LTD	27,720	1,717.30	47,603,556.00	
BOSCH LTD	750	32,327.80	24,245,850.00	
EICHER MOTORS LTD	13,930	4,935.10	68,745,943.00	
HERO MOTOCORP LTD	11,820	5,804.20	68,605,644.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	93,880	2,928.60	274,936,968.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	13,910	12,845.20	178,676,732.00	

MRF LTD	230	125,580.70	28,883,561.00	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	240,860	174.62	42,058,973.20	
SONA BLW PRECISION FORGINGS	40,500	648.30	26,256,150.00	
TATA MOTORS LTD	165,058	993.40	163,968,617.20	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	46,900	668.35	31,345,615.00	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	11,340	4,307.00	48,841,380.00	
TVS MOTOR CO LTD	24,370	2,503.85	61,018,824.50	
PAGE INDUSTRIES LTD	660	38,512.70	25,418,382.00	
TITAN CO LTD	36,270	3,530.05	128,034,913.50	
INDIAN HOTELS CO LTD	90,930	613.85	55,817,380.50	
JUBILANT FOODWORKS LTD	44,490	530.65	23,608,618.50	
ZOMATO LTD	668,500	186.24	124,501,440.00	
INFO EDGE INDIA LTD	7,230	6,242.95	45,136,528.50	
TRENT LTD	18,070	5,245.55	94,787,088.50	
AVENUE SUPERMARTS LTD	16,640	4,739.95	78,872,768.00	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	10,570	5,393.65	57,010,880.50	
ITC LTD	296,305	431.15	127,751,900.75	
MARICO LTD	55,700	619.35	34,497,795.00	
NESTLE INDIA LTD	31,530	2,542.50	80,165,025.00	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	59,060	1,112.45	65,701,297.00	
UNITED SPIRITS LTD	29,680	1,269.00	37,663,920.00	
VARUN BEVERAGES LTD	45,030	1,639.25	73,815,427.50	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	12,630	2,952.60	37,291,338.00	
DABUR INDIA LTD	65,930	608.65	40,128,294.50	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	41,565	1,392.95	57,897,966.75	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	83,510	2,479.75	207,083,922.50	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	10,230	6,207.60	63,503,748.00	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	79,870	927.90	74,111,373.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	27,210	1,259.00	34,257,390.00	
CIPLA LTD	55,000	1,564.75	86,061,250.00	
DIVI'S LABORATORIES LTD	12,840	4,588.60	58,917,624.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	12,130	6,085.25	73,814,082.50	
LUPIN LTD	20,890	1,604.10	33,509,649.00	
MANKIND PHARMA LTD	10,100	2,240.60	22,630,060.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	93,754	1,516.00	142,131,064.00	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	10,420	2,882.10	30,031,482.00	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	35,110	661.25	23,216,487.50	
AXIS BANK LTD	231,590	1,181.05	273,519,369.50	
BANDHAN BANK LTD	74,240	194.34	14,427,801.60	
BANK OF BARODA	100,500	286.25	28,768,125.00	
CANARA BANK	183,500	120.81	22,168,635.00	
HDFC BANK LIMITED	284,493	1,596.90	454,306,871.70	
ICICI BANK LTD	520,387	1,105.65	575,365,886.55	

IDFC FIRST BANK LTD	390,500	78.00	30,459,000.00	
INDUSIND BANK LTD	29,500	1,502.35	44,319,325.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	112,430	1,717.20	193,064,796.00	
PUNJAB NATIONAL BANK	223,000	128.94	28,753,620.00	
STATE BANK OF INDIA	178,670	839.20	149,939,864.00	
UNION BANK OF INDIA	148,000	147.55	21,837,400.00	
YES BANK LTD	1,377,600	23.81	32,800,656.00	
BAJAJ FINANCE LTD	28,540	7,341.55	209,527,837.00	
BAJAJ FINSERV LTD	38,590	1,591.75	61,425,632.50	
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	2,880	8,302.85	23,912,208.00	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	45,020	1,447.00	65,143,940.00	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	8,500	4,014.40	34,122,400.00	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	295,802	357.00	105,601,314.00	
MUTHOOT FINANCE LTD	13,050	1,770.00	23,098,500.00	
POWER FINANCE CORPORATION	157,400	510.05	80,281,870.00	
REC LTD	139,700	532.65	74,411,205.00	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	31,920	728.35	23,248,932.00	
SHRIRAM FINANCE LTD	29,334	2,732.15	80,144,888.10	
SUNDARAM FINANCE LTD	6,740	4,548.70	30,658,238.00	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	99,780	598.35	59,703,363.00	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	25,340	1,730.90	43,861,006.00	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	35,540	613.70	21,810,898.00	
PB FINTECH LTD	29,700	1,372.05	40,749,885.00	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	47,040	1,469.90	69,144,096.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	94,690	1,431.05	135,506,124.50	
INFOSYS LTD	335,788	1,488.90	499,954,753.20	
LTIMINDTREE LTD	9,801	5,032.55	49,324,022.55	
MPHASIS LTD	7,840	2,408.85	18,885,384.00	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	10,470	3,772.80	39,501,216.00	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	92,959	3,832.05	356,223,535.95	
TATA ELXSI LTD	3,480	7,268.00	25,292,640.00	
TECH MAHINDRA LTD	55,910	1,371.45	76,677,769.50	
WIPRO LTD	134,629	477.50	64,285,347.50	
BHARTI AIRTEL LTD	231,155	1,427.40	329,950,647.00	
INDUS TOWERS LTD	81,700	340.75	27,839,275.00	
TATA COMMUNICATIONS LTD	11,700	1,868.40	21,860,280.00	
ADANI GREEN ENERGY LTD	32,600	1,806.30	58,885,380.00	
ADANI POWER LTD	79,080	746.75	59,052,990.00	
GAIL INDIA LTD	234,863	221.83	52,099,659.29	
JSW ENERGY LTD	35,300	683.60	24,131,080.00	
NHPC LTD	305,000	102.59	31,289,950.00	
NTPC LIMITED	431,622	368.45	159,031,125.90	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	462,884	321.50	148,817,206.00	

	TATA POWER CO LTD	150,180	448.65	67,378,257.00	
	TORRENT POWER LTD	17,000	1,599.10	27,184,700.00	
	DLF LTD	75,050	878.60	65,938,930.00	
	GODREJ PROPERTIES LTD	12,700	2,998.50	38,080,950.00	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	29,360	1,557.10	45,716,456.00	
	PHOENIX MILLS LTD	9,940	3,561.60	35,402,304.00	
インドルピー小計		15,440,186		12,078,006,320.04 (22,948,212,008)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	67,690	14.70	995,043.00	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	260,800	4.53	1,181,945.60	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	473,800	1.70	809,250.40	
	INDUSTRIES QATAR	157,210	12.18	1,914,817.80	
	COMMERCIAL BANK PQSC	342,480	3.99	1,368,892.56	
	DUKHAN BANK	179,000	3.56	637,777.00	
	MASRAF AL RAYAN	575,200	2.35	1,354,596.00	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	96,100	9.99	960,903.90	
	QATAR ISLAMIC BANK	181,500	17.78	3,227,070.00	
	QATAR NATIONAL BANK	461,740	14.18	6,547,473.20	
	OOREDOO QPSC	77,600	9.77	758,152.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	44,020	15.01	660,740.20	
	BARWA REAL ESTATE CO	214,700	2.78	597,080.70	
カタールリアル小計		3,131,840		21,013,742.36 (909,684,906)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	24,980	171.00	4,271,580.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	6,660	575.57	3,833,296.20	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	43,602	420.62	18,339,873.24	
	GOLD FIELDS LTD	90,310	244.97	22,123,240.70	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	57,570	156.57	9,013,734.90	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	93,370	84.10	7,852,417.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	7,080	444.93	3,150,104.40	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	36,420	108.00	3,933,360.00	
	SASOL LTD	60,095	115.96	6,968,616.20	
	SIBANYE STILLWATER LTD	292,830	20.04	5,868,313.20	
	BIDVEST GROUP LTD	30,292	257.29	7,793,828.68	
	NASPERS LTD-N SHS	18,410	3,736.94	68,797,065.40	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	193,850	18.51	3,588,163.50	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	95,575	59.03	5,641,792.25	
	BID CORP LTD	32,969	404.95	13,350,796.55	
	CLICKS GROUP LTD	22,890	309.51	7,084,683.90	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	50,400	264.60	13,335,840.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	37,271	220.13	8,204,465.23	
	ABSA GROUP LTD	89,130	165.91	14,787,558.30	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	8,872	2,373.10	21,054,143.20	

	NEDBANK GROUP LTD	44,908	246.60	11,074,312.80	
	STANDARD BANK GROUP LTD	136,943	199.36	27,300,956.48	
	FIRSTRAND LTD	511,219	70.51	36,046,051.69	
	REINET INVESTMENTS SCA	13,180	470.90	6,206,462.00	
	REMGRO LTD	55,390	132.08	7,315,911.20	
	DISCOVERY LTD	55,055	125.48	6,908,301.40	
	OLD MUTUAL LTD	508,380	11.31	5,749,777.80	
	OUTSURANCE GROUP LTD	72,900	44.57	3,249,153.00	
	SANLAM LTD	170,861	76.48	13,067,449.28	
	MTN GROUP LTD	177,442	82.25	14,594,604.50	
	VODACOM GROUP LTD	62,895	93.80	5,899,551.00	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	49,648	133.66	6,635,951.68	
南アフリカランド小計		3,151,397		393,041,355.68 (3,372,294,831)	
アラブディルハム	MULTIPLY GROUP	402,100	2.00	804,200.00	
	AMERICANA RESTAURANTS INTERN	250,000	3.01	752,500.00	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	322,900	3.29	1,062,341.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	291,504	7.91	2,305,796.64	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	150,050	11.04	1,656,552.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	316,633	5.59	1,769,978.47	
	EMIRATES NBD PJSC	174,470	16.25	2,835,137.50	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	442,201	11.58	5,120,687.58	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	363,731	15.90	5,783,322.90	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	418,950	5.94	2,488,563.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	676,450	7.75	5,242,487.50	
アラブディルハム小計		3,808,989		29,821,566.59 (1,281,134,500)	
クウェート・ディナール	BOUBYAN BANK K.S.C	165,886	0.57	95,550.33	
	GULF BANK	243,153	0.28	68,569.14	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	1,041,494	0.72	749,875.68	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	782,143	0.85	668,732.26	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	218,400	0.44	97,624.80	
	MABANEE CO KPSC	71,746	0.83	59,620.92	
クウェート・ディナール小計		2,522,822		1,739,973.13 (895,163,976)	
香港・オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	57,700	8.42	485,834.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	214,717	6.15	1,320,509.55	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	49,400	44.35	2,190,890.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	23,600	16.37	386,332.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	46,500	7.73	359,445.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	166,233	9.83	1,634,070.39	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	73,700	27.38	2,017,906.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	53,700	10.96	588,552.00	

YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	36,150	23.82	861,093.00	
YANTAI JEREH OILFIELD-A	14,900	35.91	535,059.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	117,200	7.73	905,956.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	34,200	23.82	814,644.00	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	206,200	6.80	1,402,160.00	
CHINA JUSHI CO LTD -A	26,289	11.13	292,596.57	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	139,200	8.28	1,152,576.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH-A	38,100	17.97	684,657.00	
GANFENG LITHIUM CO LTD-A	16,100	31.55	507,955.00	
GEM CO LTD-A	55,400	6.49	359,546.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	16,600	19.07	316,562.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	66,554	14.02	933,087.08	
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	7,400	47.59	352,166.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	438,792	1.43	627,472.56	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	66,500	3.87	257,355.00	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	58,800	8.32	489,216.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	20,600	24.35	501,610.00	
LB GROUP CO LTD-A	14,800	18.68	276,464.00	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	67,500	16.54	1,116,450.00	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	50,000	17.06	853,000.00	
RONGSHENG PETROCHEMICAL CO-A	77,800	9.65	750,770.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	27,244	27.58	751,389.52	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	15,340	27.79	426,298.60	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	145,000	3.74	542,300.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	17,545	15.85	278,088.25	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	30,700	5.18	159,026.00	
TIANQI LITHIUM CORP-A	13,500	32.56	439,560.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	14,600	15.20	221,920.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	22,500	86.47	1,945,575.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	8,320	25.69	213,740.80	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C-A	8,300	36.13	299,879.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	15,150	25.55	387,082.50	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	24,480	18.62	455,817.60	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	154,600	17.09	2,642,114.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	24,100	37.53	904,473.00	
AVICOPTER PLC-A	9,400	40.78	383,332.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	12,200	31.95	389,790.00	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	40,900	38.14	1,559,926.00	
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	308,200	2.12	653,384.00	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	48,800	8.02	391,376.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	185,000	6.45	1,193,250.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION-A	324,000	5.56	1,801,440.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	29,700	184.89	5,491,233.00	

CRRC CORP LTD-A	231,200	6.91	1,597,592.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	21,700	18.04	391,468.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	17,383	40.50	704,011.50	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	3,500	50.87	178,045.00	
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	43,900	7.70	338,030.00	
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD-A	14,100	19.20	270,720.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	11,879	51.23	608,561.17	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	30,800	14.74	453,992.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	157,500	3.10	488,250.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	65,080	23.90	1,555,412.00	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	3,276	69.53	227,780.28	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	122,702	5.15	631,915.30	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	69,100	15.68	1,083,488.00	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	87,700	2.24	196,448.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	121,700	3.82	464,894.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	12,576	55.26	694,949.76	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	18,340	66.59	1,221,260.60	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	12,200	15.28	186,416.00	
TBEA CO LTD-A	51,350	14.36	737,386.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	57,500	15.96	917,700.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	111,700	7.21	805,357.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	20,100	20.64	414,864.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	49,000	7.98	391,020.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	5,400	34.10	184,140.00	
AIR CHINA LTD-A	110,000	7.39	812,900.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	464,100	5.13	2,380,833.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	161,700	3.95	638,715.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	71,400	5.78	412,692.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	103,710	15.21	1,577,429.10	
DAQIN RAILWAY CO LTD-A	135,800	7.17	973,686.00	
HAINAN AIRLINES HOLDING CO-A	408,400	1.26	514,584.00	
S F HOLDING CO LTD-A	32,200	36.69	1,181,418.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	11,338	33.38	378,462.44	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	24,570	7.78	191,154.60	
BYD CO LTD -A	12,800	253.05	3,239,040.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	2,300	123.81	284,763.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	65,482	13.54	886,626.28	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	18,900	46.70	882,630.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS-A	29,471	16.01	471,830.71	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	5,200	101.25	526,500.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC-A	11,800	15.73	185,614.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	7,700	58.98	454,146.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	64,200	14.30	918,060.00	

SERES GROUP CO L-A	14,400	87.79	1,264,176.00	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	12,500	18.46	230,750.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	18,100	40.93	740,833.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	53,100	30.65	1,627,515.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	9,400	24.11	226,634.00	
MIDEA GROUP CO LTD-A	20,500	65.61	1,345,005.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	3,780	65.12	246,153.60	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	6,493	53.92	350,102.56	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	7,000	26.70	186,900.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	17,320	9.10	157,612.00	
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	17,300	14.09	243,757.00	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	22,700	9.34	212,018.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	128,100	6.09	780,129.00	
KUNLUN TECH CO LTD-A	6,400	34.10	218,240.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	17,400	22.51	391,674.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	58,200	3.67	213,594.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	18,500	69.28	1,281,680.00	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	32,200	5.55	178,710.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	67,900	4.48	304,192.00	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	8,604	29.20	251,236.80	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	3,200	233.34	746,688.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	4,500	40.62	182,790.00	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	5,000	61.47	307,350.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING-A	30,872	35.94	1,109,539.68	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	14,600	49.37	720,802.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	31,677	25.70	814,098.90	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	54,300	27.17	1,475,331.00	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	11,600	49.54	574,664.00	
JIANGSU YANGHE DISTILLERY-A	10,383	91.07	945,579.81	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	5,647	26.41	149,137.27	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	7,860	1,555.00	12,222,300.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	9,600	156.00	1,497,600.00	
MUYUAN FOODS CO LTD-A	34,452	45.03	1,551,373.56	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	41,775	9.44	394,356.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	8,460	234.81	1,986,492.60	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	6,300	42.61	268,443.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	6,600	77.48	511,368.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO-A	43,080	20.84	897,787.20	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	25,500	135.68	3,459,840.00	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	13,300	28.99	385,567.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	25,500	14.58	371,790.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	66,176	11.65	770,950.40	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	13,100	30.95	405,445.00	

GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	3,700	30.69	113,553.00	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	10,000	39.60	396,000.00	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	52,920	5.26	278,359.20	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	16,073	16.10	258,775.30	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	17,900	18.48	330,792.00	
SHANGHAI UNITED IMAGING HE-A	3,900	113.00	440,700.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	7,755	299.10	2,319,520.50	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	3,260	75.08	244,760.80	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	13,000	42.35	550,550.00	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	5,684	66.75	379,407.00	
CHANGCHUN HIGH-TECH INDUST-A	3,300	100.81	332,673.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	12,610	46.05	580,690.50	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	19,200	30.44	584,448.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	3,400	53.80	182,920.00	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	20,930	17.09	357,693.70	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	1,820	185.89	338,319.80	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	47,673	41.90	1,997,498.70	
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	10,350	20.13	208,345.50	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	20,700	23.18	479,826.00	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	65,500	7.53	493,215.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	9,280	16.73	155,254.40	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	14,800	12.47	184,556.00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	19,488	43.70	851,625.60	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	12,740	52.82	672,926.80	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	4,900	222.50	1,090,250.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	11,620	17.54	203,814.80	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	672,600	4.25	2,858,550.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	199,923	5.64	1,127,565.72	
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	38,000	15.40	585,200.00	
BANK OF CHINA LTD-A	180,800	4.48	809,984.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	313,500	6.80	2,131,800.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	55,760	13.14	732,686.40	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	169,910	7.40	1,257,334.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	79,112	9.54	754,728.48	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	45,407	22.86	1,038,004.02	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	134,327	7.47	1,003,422.69	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	90,700	7.13	646,691.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	439,900	3.14	1,381,286.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	154,410	33.81	5,220,602.10	
CHINA MINSHENG BANKING-A	335,200	3.77	1,263,704.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	125,443	6.64	832,941.52	
IND & COMM BK OF CHINA-A	384,100	5.50	2,112,550.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	152,821	17.46	2,668,254.66	

PING AN BANK CO LTD-A	147,644	10.18	1,503,015.92	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	172,500	4.75	819,375.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	185,521	8.14	1,510,140.94	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	70,700	2.38	168,266.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	73,580	7.01	515,795.80	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	87,100	5.10	444,210.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	22,948	32.08	736,171.84	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	69,230	14.18	981,681.40	
CITIC SECURITIES CO-A	94,970	18.63	1,769,291.10	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	41,000	21.27	872,070.00	
DONGXING SECURITIES CO LT-A	43,500	8.34	362,790.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	123,866	12.34	1,528,506.44	
EVERBRIGHT SECURITIE CO-A	30,800	15.91	490,028.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	55,200	5.31	293,112.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	46,700	12.71	593,557.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	59,317	9.38	556,393.46	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	69,188	14.44	999,074.72	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	68,900	6.37	438,893.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	88,200	8.87	782,334.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	4,400	115.80	509,520.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	68,100	13.17	896,877.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	68,640	5.27	361,732.80	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	60,160	8.12	488,499.20	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	220,000	4.50	990,000.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	79,937	6.29	502,803.73	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	88,900	3.75	333,375.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	55,200	6.57	362,664.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	43,800	11.44	501,072.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	22,867	31.41	718,252.47	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	53,312	28.63	1,526,322.56	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	15,000	31.68	475,200.00	
PICC HOLDING CO-A	77,900	5.18	403,522.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	76,657	41.87	3,209,628.59	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	64,500	7.98	514,710.00	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	4,215	271.22	1,143,192.30	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	17,660	19.51	344,546.60	
IFLYTEK CO LTD-A	17,400	43.40	755,160.00	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	3,800	52.28	198,664.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	27,499	33.77	928,641.23	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	31,571	10.92	344,755.32	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	320,712	4.07	1,305,297.84	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	23,100	9.35	215,985.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	104,900	27.23	2,856,427.00	

GOERTEK INC -A	35,700	17.56	626,892.00	
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	47,875	10.75	514,656.25	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	36,300	10.66	386,958.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	13,336	36.72	489,697.92	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	41,100	16.15	663,765.00	
LINGYI ITECH GUANGDONG CO-A	45,000	5.12	230,400.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	51,560	34.35	1,771,086.00	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	4,880	90.39	441,103.20	
NINESTAR CORP-A	16,800	26.62	447,216.00	
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	9,527	88.58	843,901.66	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	25,300	16.94	428,582.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	172,920	4.34	750,472.80	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	27,002	23.07	622,936.14	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	12,300	29.96	368,508.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	25,352	6.40	162,252.80	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	14,948	37.06	553,972.88	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	7,630	38.67	295,052.10	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	28,000	16.54	463,120.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	10,080	138.30	1,394,064.00	
ZTE CORP-A	36,100	27.82	1,004,302.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	217,000	4.51	978,670.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	178,500	10.04	1,792,140.00	
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	270,700	4.70	1,272,290.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	169,509	27.90	4,729,301.10	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	168,600	5.83	982,938.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-A	71,900	7.02	504,738.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	86,900	9.25	803,825.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	56,200	17.73	996,426.00	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	42,192	18.60	784,771.20	
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	5,844	140.56	821,432.64	
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	3,920	200.01	784,039.20	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	5,376	90.66	487,388.16	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	14,756	24.45	360,784.20	
HYGON INFORMATION TECHNOLO-A	9,160	73.14	669,962.40	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	25,648	13.89	356,250.72	
JINKO SOLAR CO LTD-A	63,000	8.27	521,010.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	54,235	16.72	906,809.20	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	4,400	322.80	1,420,320.00	
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	47,200	12.41	585,752.00	
SHANGHAI AIKO SOLAR ENERGY-A	17,080	10.46	178,656.80	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	1,820	95.95	174,629.00	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	2,560	136.55	349,568.00	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	30,500	9.97	304,085.00	

	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	27,500	8.26	227,150.00	
	TONGWEI CO LTD-A	33,400	20.97	700,398.00	
	TRINA SOLAR CO LTD-A	16,250	20.75	337,187.50	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	6,579	57.95	381,253.05	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	10,160	102.49	1,041,298.40	
	XINJIANG DAQO NEW ENERGY C-A	16,830	25.24	424,789.20	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	13,500	33.63	454,005.00	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	61,077	10.00	610,770.00	
	CHINA VANKE CO LTD -A	75,200	7.94	597,088.00	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	84,753	10.00	847,530.00	
香港・オフショア人民元小計		17,467,819		232,909,449.51 (5,044,352,857)	
サウジアラビアリアル	ADES HOLDING CO	32,900	20.46	673,134.00	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	364,139	27.70	10,086,650.30	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	14,800	38.10	563,880.00	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	24,000	110.00	2,640,000.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	38,390	29.20	1,120,988.00	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	129,530	44.40	5,751,132.00	
	SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	5,010	135.40	678,354.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	90,970	73.50	6,686,295.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	38,016	20.62	783,889.92	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	80,560	8.01	645,285.60	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	28,190	36.35	1,024,706.50	
	SAL SAUDI LOGISTICS SERVICES	2,430	288.00	699,840.00	
	SAUDI RESEARCH AND MARKETING	3,990	198.80	793,212.00	
	JARIR MARKETING CO	62,840	12.90	810,636.00	
	NAHDI MEDICAL CO	3,940	132.00	520,080.00	
	ALMARAI CO	24,340	54.90	1,336,266.00	
	SAVOLA	26,820	42.80	1,147,896.00	
	DALLAH HEALTHCARE CO	3,390	164.20	556,638.00	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	8,270	288.00	2,381,760.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	10,060	121.60	1,223,296.00	
	AL RAJHI BANK	200,592	79.00	15,846,768.00	
	ALINMA BANK	121,095	31.30	3,790,273.50	
	ARAB NATIONAL BANK	94,560	19.92	1,883,635.20	
	BANK AL-JAZIRA	53,050	16.72	886,996.00	
	BANK ALBILAD	62,420	33.20	2,072,344.00	
	BANQUE SAUDI FRANSI	61,170	34.85	2,131,774.50	
	RIYAD BANK	153,010	24.66	3,773,226.60	
	SAUDI AWWAL BANK	103,950	37.85	3,934,507.50	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	65,887	12.94	852,577.78	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	297,155	35.15	10,444,998.25	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	4,860	237.20	1,152,792.00	

	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	8,065	240.00	1,935,600.00	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	7,180	139.20	999,456.00	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	2,580	281.60	726,528.00	
	ELM CO	2,350	821.00	1,929,350.00	
	ETIHAD ETISALAT CO	38,960	49.20	1,916,832.00	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	47,250	11.78	556,605.00	
	SAUDI TELECOM CO	201,965	36.60	7,391,919.00	
	ACWA POWER CO	14,820	331.80	4,917,276.00	
	POWER & WATER UTILITY CO FOR	7,330	58.20	426,606.00	
	SAUDI ELECTRICITY CO	83,220	16.42	1,366,472.40	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	57,980	12.00	695,760.00	
サウジアラビアリアル小計		2,682,034		109,756,237.05 (4,618,542,455)	
合　　計		713,622,379		120,619,745,465 (120,619,745,465)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
メキシコペソ	投資証券	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	299,900	6,738,753.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	72,738	4,554,853.56	
メキシコペソ小計			372,638	11,293,606.56 (96,118,756)	
合計				96,118,756 (96,118,756)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種　類	銘柄数		組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式	64銘柄	100.0%	—	3.0%
メキシコペソ	株式	22銘柄	96.1%	—	2.0%
	投資証券	2銘柄	—	3.9%	0.1%
ブラジルレアル	株式	48銘柄	100.0%	—	4.1%
チリペソ	株式	12銘柄	100.0%	—	0.4%
コロンビアペソ	株式	3銘柄	100.0%	—	0.1%
ユーロ	株式	10銘柄	100.0%	—	0.5%
トルコリラ	株式	17銘柄	100.0%	—	0.8%
チェココルナ	株式	3銘柄	100.0%	—	0.1%
ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%	—	0.2%
ポーランドズロチ	株式	13銘柄	100.0%	—	0.9%
香港ドル	株式	159銘柄	100.0%	—	19.6%
マレーシアリンギット	株式	32銘柄	100.0%	—	1.4%
タイバーツ	株式	32銘柄	100.0%	—	1.4%

フィリピンペソ	株式	13銘柄	100.0%	—	0.5%
インドネシアルピア	株式	21銘柄	100.0%	—	1.5%
韓国ウォン	株式	98銘柄	100.0%	—	12.0%
台湾ドル	株式	88銘柄	100.0%	—	19.0%
インドルピー	株式	146銘柄	100.0%	—	19.0%
カタールリアル	株式	13銘柄	100.0%	—	0.8%
南アフリカランド	株式	32銘柄	100.0%	—	2.8%
アラブディルハム	株式	11銘柄	100.0%	—	1.1%
クウェート・ディナール	株式	6銘柄	100.0%	—	0.7%
香港・オフショア人民元	株式	276銘柄	100.0%	—	4.2%
サウジアラビアリアル	株式	42銘柄	100.0%	—	3.8%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 6月17日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	214,999,838
投資証券	59,683,122,100
未収配当金	335,386,878
未収利息	485
流動資産合計	60,233,509,301
資産合計	60,233,509,301
負債の部	
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
純資産の部	
元本等	
元本	24,754,972,956
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	35,297,870,915
元本等合計	60,052,843,871
純資産合計	60,052,843,871
負債純資産合計	60,233,509,301

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 （1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。 （2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券

	当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 （3）時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 6月17日現在
１．	期首	2023年 6月20日
	期首元本額	23,888,659,299円
	期首からの追加設定元本額	4,084,291,051円
	期首からの一部解約元本額	3,217,977,394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
	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
	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
	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
	財産３分法（適格機関投資家専用）	722,843,641円
	Ｔｒａｃｅｒｓ　グローバル３分法（おとなのバランス）	1,885,915円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	1,160,932円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）	523,009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
	計	24,754,972,956円
２．	受益権の総数	24,754,972,956口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2023年 6月20日 至 2024年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。当該有価証券の性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

（2024年 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

(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

1口当たり純資産額	2.4259円
(1万口当たり純資産額)	(24,259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	1,234	146,229,000	
	サンケイリアルエステート投資法人　投資証券	1,945	161,824,000	
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人　投資証券	3,030	348,450,000	
	東海道リート投資法人　投資証券	1,038	126,324,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人　投資証券	2,097	1,342,080,000	
	森ヒルズリート投資法人　投資証券	7,141	927,615,900	
	産業ファンド投資法人　投資証券	11,061	1,350,548,100	
	アドバンス・レジデンス投資法人　投資証券	5,958	1,906,560,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人　投資証券	3,186	1,167,669,000	
	ＧＬＰ投資法人　投資証券	20,398	2,649,700,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人　投資証券	2,986	939,097,000	
	日本プロロジスリート投資法人　投資証券	10,579	2,645,807,900	
	星野リゾート・リート投資法人　投資証券	1,276	649,484,000	
	Ｏｎｅリート投資法人　投資証券	1,059	270,045,000	
	イオンリート投資法人　投資証券	7,449	981,033,300	
	ヒューリックリート投資法人　投資証券	5,682	816,503,400	
	日本リート投資法人　投資証券	1,973	655,036,000	
	積水ハウス・リート投資法人　投資証券	18,248	1,412,395,200	
	トーセイ・リート投資法人　投資証券	1,279	175,734,600	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人　投資証券	1,497	189,220,800	
	サムティ・レジデンシャル投資法人　投資証券	1,654	171,850,600	
	野村不動産マスターファンド投資法人　投資証券	19,638	2,755,211,400	
	いちごホテルリート投資法人　投資証券	1,006	109,654,000	
	ラサールロジポート投資法人　投資証券	7,762	1,139,461,600	
	スターアジア不動産投資法人　投資証券	9,359	554,988,700	
	マリモ地方創生リート投資法人　投資証券	936	122,241,600	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人　投資証券	2,526	1,088,706,000	
	日本ホテル＆レジデンシャル投資法人　投資証券	928	68,857,600	
	投資法人みらい　投資証券	8,334	370,446,300	
	三菱地所物流リート投資法人　投資証券	2,097	787,423,500	
	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人　投資証券	2,614	371,449,400	
	ザイマックス・リート投資法人　投資証券	985	115,540,500	
	タカラレーベン不動産投資法人　投資証券	3,235	318,971,000	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人　投資証券	2,661	316,659,000	

	日本ビルファンド投資法人　投資証券	7,084	4,101,636,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人　投資証券	6,238	3,162,666,000	
	日本都市ファンド投資法人　投資証券	29,108	2,613,898,400	
	オリックス不動産投資法人　投資証券	12,100	1,906,960,000	
	日本プライムリアルティ投資法人　投資証券	4,153	1,358,031,000	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人　投資証券	6,157	712,980,600	
	東急リアル・エステート投資法人　投資証券	4,071	629,783,700	
	グローバル・ワン不動産投資法人　投資証券	4,484	446,606,400	
	ユナイテッド・アーバン投資法人　投資証券	13,584	1,931,644,800	
	森トラストリート投資法人　投資証券	11,705	804,133,500	
	インヴィンシブル投資法人　投資証券	29,403	1,996,463,700	
	フロンティア不動産投資法人　投資証券	2,253	1,002,585,000	
	平和不動産リート投資法人　投資証券	4,706	616,486,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人　投資証券	3,876	1,028,690,400	
	福岡リート投資法人　投資証券	3,141	496,278,000	
	ＫＤＸ不動産投資法人　投資証券	17,207	2,624,067,500	
	いちごオフィスリート投資法人　投資証券	4,976	404,548,800	
	大和証券オフィス投資法人　投資証券	2,516	703,473,600	
	阪急阪神リート投資法人　投資証券	2,896	379,955,200	
	スターツプロシード投資法人　投資証券	1,053	211,021,200	
	大和ハウスリート投資法人　投資証券	9,154	2,239,983,800	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人　投資証券	20,328	1,603,879,200	
	大和証券リビング投資法人　投資証券	8,943	920,234,700	
	ジャパンエクセレント投資法人　投資証券	5,277	634,295,400	
合計		387,264	59,683,122,100	

(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
資産の部	
流動資産	
預金	342,192,595
コール・ローン	21,161,575
投資証券	55,931,087,801
未収入金	1,339,882
未収配当金	146,414,243
未収利息	47
流動資産合計	56,442,196,143
資産合計	56,442,196,143
負債の部	
流動負債	

	2024年 6月17日現在
未払解約金	6,033,914
流動負債合計	6,033,914
負債合計	6,033,914
純資産の部	
元本等	
元本	16,493,547,462
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	39,942,614,767
元本等合計	56,436,162,229
純資産合計	56,436,162,229
負債純資産合計	56,442,196,143

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
1．	期首	2023年 6月20日
	期首元本額	20,076,486,597円
	期首からの追加設定元本額	1,493,576,470円
	期首からの一部解約元本額	5,076,515,605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
	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
	Ｔｒａｃｅｒｓ　グローバル３分法（おとなのバランス）	20,686,523円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	841,098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
	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
	計	16,493,547,462円
2．	受益権の総数	16,493,547,462口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2023年 6月20日 至 2024年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、為替予約取引があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

（2024年 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

(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	
1口当たり純資産額	3.4217円
(1万口当たり純資産額)	(34,217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	27,031	467,636.30	
		AGREE REALTY CORPORATION	26,931	1,650,062.37	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	18,817	310,668.67	
		ALEXANDER'S INC	536	114,302.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	41,858	4,868,922.56	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	3,159	47,669.31	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	12,925	279,826.25	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	84,612	2,998,649.28	
		AMERICOLD REALTY TRUST INC	70,939	1,808,235.11	
		APARTMENT INCOME REIT CO	38,608	1,502,623.36	
		APARTMENT INVT&MGMT CO -A	34,628	279,447.96	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	56,643	817,924.92	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	18,326	202,319.04	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	8,742	8,737.62	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	37,743	7,619,934.27	
		BOSTON PROPERTIES INC	38,426	2,368,578.64	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	12,905	37,811.65	

		BRANDYWINE REALTY TRUST	45,029	206,232.82	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	80,002	1,782,444.56	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	49,747	760,134.16	
		BRT APARTMENTS CORP	3,398	58,819.38	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	28,426	3,071,145.04	
		CARETRUST REIT INC	34,923	879,011.91	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	6,784	148,366.08	
		CENTERSPACE	3,864	261,360.96	
		CHATHAM LODGING TRUST	12,668	104,891.04	
		CITY OFFICE REIT INC	11,825	58,060.75	
		CLIPPER REALTY INC	3,393	12,452.31	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	6,767	158,144.79	
		COPT DEFENSE PROPERTIES	29,908	729,157.04	
		COUSINS PROPERTIES INC	40,164	927,386.76	
		CTO REALTY GROWTH INC	5,391	93,911.22	
		CUBESMART	59,752	2,642,830.96	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	55,280	453,848.80	
		DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	209,224	112,980.96	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	85,905	12,878,877.60	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	58,979	166,320.78	
		DOUGLAS EMMETT INC	44,423	590,825.90	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	68,595.90	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	25,603	311,588.51	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	12,673	2,101,943.78	
		ELME COMMUNITIES	23,811	371,927.82	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	34,826	324,578.32	
		EPR PROPERTIES	20,066	809,261.78	
		EQUINIX INC	24,970	19,133,512.20	
		EQUITY COMMONWEALTH	29,834	573,409.48	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	49,747	3,120,131.84	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	91,884	6,129,581.64	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	41,452	1,144,075.20	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	17,092	4,760,122.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	56,186	8,797,042.02	
		FARMLAND PARTNERS INC	11,078	126,289.20	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	19,577	1,980,996.63	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	35,145	1,669,036.05	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	24,410	595,115.80	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	26,426	43,602.90	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	71,213	3,091,356.33	
		GETTY REALTY CORPORATION	12,818	343,137.86	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	10,804	152,228.36	

		GLADSTONE LAND CORP	8,550	114,399.00	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	14,729	132,855.58	
		GLOBAL NET LEASE INC	52,000	374,920.00	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	101,524	1,675,146.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	188,516	3,704,339.40	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	27,853	715,265.04	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	187,859	3,347,647.38	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	34,874	172,626.30	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	59,440	1,065,759.20	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	15,324	57,771.48	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	7,407	789,734.34	
		INVENTRUST PROPERTIES CORP	18,090	447,184.80	
		INVITATION HOMES INC	152,946	5,429,583.00	
		IRON MOUNTAIN INC	77,640	6,833,872.80	
		JBG SMITH PROPERTIES	23,314	342,715.80	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	219,100	30,674.00	
		KILROY REALTY CORPORATION	28,406	903,878.92	
		KIMCO REALTY CORP	177,187	3,322,256.25	
		KITE REALTY GROUP TRUST	58,411	1,282,705.56	
		LTC PROPERTIES INC	11,104	373,760.64	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	77,103	678,506.40	
		MACERICH CO/THE	57,176	827,908.48	
		MANULIFE US REAL ESTATE INV	432,047	29,379.19	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	159,365	772,920.25	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	31,058	4,327,000.56	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	20,509	837,792.65	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	11,541	766,784.04	
		NET LEASE OFFICE PROPERTY	4,251	105,637.35	
		NETSTREIT CORP	18,339	314,513.85	
		NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	9,278	44,905.52	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	5,677	210,503.16	
		NNN REIT INC	48,644	2,048,885.28	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	15,503	34,726.72	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	65,522	2,120,947.14	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,069	96,028.40	
		ORION OFFICE REIT INC	12,343	42,336.49	
		PARAMOUNT GROUP INC	41,575	192,908.00	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	55,902	820,641.36	
		PEAKSTONE REALTY TRUST	9,704	111,304.88	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	31,421	436,437.69	
		PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	32,643	1,052,083.89	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	33,502	237,529.18	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	9,038	189,346.10	

		POSTAL REALTY TRUST INC- A	5,728	75,552.32	
		PRIME US REIT	202,620	23,706.54	
		PROLOGIS INC	245,657	27,584,824.53	
		PUBLIC STORAGE	42,088	11,921,426.00	
		REALTY INCOME CORP	221,442	11,818,359.54	
		REGENCY CENTERS CORP	43,788	2,704,784.76	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	33,628	413,960.68	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	55,930	2,507,341.90	
		RLJ LODGING TRUST	41,229	394,561.53	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	15,889	1,570,309.87	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	61,891	884,422.39	
		SAFEHOLD INC	11,591	217,331.25	
		SAUL CENTERS INC	3,408	125,209.92	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	43,770	215,786.10	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	86,669	12,898,947.27	
		SITE CENTERS CORP	47,674	694,133.44	
		SL GREEN REALTY CORP	17,168	977,374.24	
		STAG INDUSTRIAL INC	48,224	1,685,911.04	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	29,619	172,086.39	
		SUN COMMUNITIES INC	33,133	3,864,633.12	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	54,732	545,130.72	
		TANGER INC	28,596	773,521.80	
		TERRENO REALTY CORP	24,815	1,439,021.85	
		UDR INC	80,587	3,246,044.36	
		UMH PROPERTIES INC	15,970	246,257.40	
		UNITI GROUP INC	63,878	175,664.50	
		UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	3,614	139,897.94	
		URBAN EDGE PROPERTIES	31,065	556,995.45	
		VENTAS INC	107,054	5,363,405.40	
		VERIS RESIDENTIAL INC	21,462	324,290.82	
		VICI PROPERTIES INC	275,374	7,790,330.46	
		VORNADO REALTY TRUST	42,466	1,079,910.38	
		WELLTOWER INC	147,226	15,317,393.04	
		WHITESTONE REIT	11,667	156,104.46	
		WP CAREY INC	58,243	3,266,849.87	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	27,751	395,174.24	
米ドル小計			7,485,126	276,110,864.34 (43,495,744,459)	
加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	16,464	259,143.36	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,987	103,435.89	
		BOARDWALK EQUITIES INC	6,351	436,440.72	
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	5,317	81,084.25	

		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	10,240	32,204.80	
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	21,800	952,442.00	
		CHOICE PROPERTIES REIT	44,021	559,506.91	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,914	186,574.14	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	13,804	186,215.96	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	35,381	443,677.74	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,395	45,648.70	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	28,197	414,777.87	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	8,208	547,719.84	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	33,939	305,451.00	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	19,632	230,872.32	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	15,022	257,627.30	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,648	84,550.56	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,944	74,555.52	
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	7,802	54,457.96	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	32,841	159,607.26	
		PRIMARIS REIT	12,438	167,415.48	
		PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	8,609	43,389.36	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	39,494	659,549.80	
		SLATE GROCERY REIT	6,982	77,709.66	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	19,883	437,227.17	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	2,223	19,073.34	
加ドル小計			432,536	6,820,358.91 (782,226,963)	
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	12,688	714,334.40	
		ALTAREA	1,217	102,958.20	
		CARE PROPERTY INVEST	10,115	141,205.40	
		CARMILA	14,591	233,747.82	
		COFINIMMO	9,837	564,643.80	
		COVIVIO	12,744	570,676.32	
		CROMWELL REIT EUR	81,360	115,531.20	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	11,271	244,017.15	
		GECINA SA	13,674	1,251,854.70	
		HAMBORNER REIT AG	20,332	131,751.36	
		ICADE	8,080	206,848.00	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	17,269	31,498.65	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	76,015	456,850.15	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	129,693	118,409.70	
		KLEPIERRE	51,966	1,327,211.64	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14,373	99,173.70	
		MERCIALYS	24,965	270,121.30	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	89,455	948,223.00	

		MONTEA	4,826	383,667.00	
		NSI NV	4,727	92,932.82	
		RETAIL ESTATES	3,481	217,910.60	
		SHURGARD SELF STORAGE LTD	8,266	319,894.20	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	26,984	1,956,340.00	
		VASTNED RETAIL	4,832	113,068.80	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	46,068	1,165,520.40	
		WERELDHAVE NV	9,878	131,970.08	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	8,768	251,641.60	
ユーロ小計			717,475	12,162,001.99 (2,051,000,015)	
英ポンド	投資証券	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	95,935	48,734.98	
		AEW UK REIT PLC	48,766	41,792.46	
		ASSURA PLC	803,210	319,035.01	
		BALANCED COMM PROPERTY TRUST	191,534	144,608.17	
		BIG YELLOW GROUP PLC	51,902	608,291.44	
		BRITISH LAND COMPANY PLC	249,787	1,065,591.34	
		CLS HOLDINGS PLC	40,564	34,966.16	
		CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	124,321	89,511.12	
		DERWENT LONDON PLC	29,748	690,748.56	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	168,582	157,624.17	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	106,734	362,361.93	
		HAMMERSON PLC	1,004,970	281,592.59	
		HELICAL PLC	29,147	63,540.46	
		HOME REIT PLC	256,438	97,574.65	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	106,581	90,700.43	
		INTU PROPERTIES PLC	758,746	—	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	199,714	1,242,221.08	
		LIFE SCIENCE REIT PLC	110,213	37,803.05	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	541,559	1,053,332.25	
		NEWRIVER REIT PLC	95,617	69,226.70	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	138,667	89,024.21	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	361,746	329,912.35	
		PRS REIT PLC/THE	145,505	111,311.32	
		REGIONAL REIT LTD	147,696	31,606.94	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	57,366	457,780.68	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	139,902	62,256.39	
		SEGRO PLC	355,760	3,233,858.40	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	519,907	711,752.68	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	336,736	242,786.65	
		TARGET HEALTHCARE REIT PLC	169,014	134,366.13	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	103,176	58,500.79	

		TRITAX BIG BOX REIT PLC	606,306	932,498.62	
		UNITE GROUP PLC/THE	105,494	959,995.40	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	116,651	139,514.59	
		WAREHOUSE REIT PLC	103,182	82,132.87	
		WORKSPACE GROUP PLC	34,600	195,144.00	
英ポンド小計			8,455,776	14,271,698.57 (2,852,484,393)	
豪ドル	投資証券	ABACUS GROUP	125,548	141,869.24	
		ABACUS STORAGE KING	147,049	179,399.78	
		ARENA REIT	91,703	341,135.16	
		BWP TRUST	151,260	544,536.00	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	209,494	362,424.62	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	148,189	460,867.79	
		CENTURIA OFFICE REIT	121,951	145,121.69	
		CHARTER HALL GROUP	125,339	1,540,416.31	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	180,627	619,550.61	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	142,745	468,203.60	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	93,916	226,337.56	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	384,121	161,330.82	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	60,062	177,783.52	
		DEXUS/AU	288,730	1,873,857.70	
		GDI PROPERTY GROUP	181,454	109,779.67	
		GOODMAN GROUP	459,635	16,441,143.95	
		GPT GROUP	511,856	2,083,253.92	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	76,727	175,704.83	
		HEALTHCO REIT	135,702	154,021.77	
		HMC CAPITAL LTD	64,211	474,519.29	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	494,518	605,784.55	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	55,089	177,937.47	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	99,588	484,993.56	
		MIRVAC GROUP	1,053,700	1,986,224.50	
		NATIONAL STORAGE REIT	345,303	797,649.93	
		REGION RE LTD	314,446	691,781.20	
		RURAL FUNDS GROUP	103,455	207,944.55	
		SCENTRE GROUP	1,386,467	4,325,777.04	
		STOCKLAND	634,403	2,816,749.32	
		VICINITY CENTRES	1,034,047	1,923,327.42	
		WAYPOINT REIT	184,377	427,754.64	
豪ドル小計			9,405,712	41,127,182.01 (4,284,218,549)	
ニュージーランドドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	354,249	745,694.14	

ニュージーランドドル小計			354,249	745,694.14 (72,078,795)	
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	503,000	804,800.00	
		FORTUNE REIT	398,900	1,555,710.00	
		LINK REIT	686,080	22,366,208.00	
		PROSPERITY REIT	317,000	427,950.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	306,000	529,380.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	539,610	555,798.30	
香港ドル小計			2,750,590	26,239,846.30 (528,995,301)	
シンガポールドル	投資証券	AIMS APAC REIT	196,717	249,830.59	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	951,332	2,444,923.24	
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	672,392	598,428.88	
		CAPITALAND CHINA TRUST	310,285	203,236.67	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,351,992	2,622,864.48	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	172,200	164,451.00	
		EC WORLD REIT	70,300	19,684.00	
		ESR-LOGOS REIT	1,596,519	447,025.32	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	295,600	181,794.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	309,905	666,295.75	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	767,760	733,210.80	
		KEPPEL DC REIT	357,477	639,883.83	
		KEPPEL REIT	617,100	518,364.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	477,052	264,763.86	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	556,908	1,202,921.28	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	890,887	1,175,970.84	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	624,031	761,317.82	
		PARAGON REIT	345,400	288,409.00	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	102,500	373,100.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	154,400	102,676.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	394,000	189,120.00	
		SUNTEC REIT	619,000	656,140.00	
シンガポールドル小計			11,833,757	14,504,411.36 (1,689,328,791)	
韓国ウォン	投資証券	D&D PLATFORM REIT CO LTD	16,715	58,669,650.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	45,468	209,380,140.00	
		JR REIT XXVII	45,388	187,679,380.00	
		KORAMCO LIFE INFRA REIT	11,530	53,268,600.00	
		LOTTE REIT CO LTD	34,731	115,654,230.00	
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,699	46,859,310.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	22,911	139,986,210.00	
		SK REITS CO LTD	34,097	165,881,905.00	

韓国ウォン小計			223,539	977,379,425.00 (111,714,468)	
イスラエルシュケル	投資証券	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	197,705	307,628.98	
		REIT 1 LTD	56,023	771,996.94	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	63,926	414,943.66	
イスラエルシュケル小計			317,654	1,494,569.58 (63,296,067)	
合計				55,931,087,801 (55,931,087,801)	

(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	138銘柄	100.0%	77.8%
加ドル	投資証券	26銘柄	100.0%	1.4%
ユーロ	投資証券	27銘柄	100.0%	3.7%
英ポンド	投資証券	36銘柄	100.0%	5.1%
豪ドル	投資証券	31銘柄	100.0%	7.7%
ニュージーランドドル	投資証券	1銘柄	100.0%	0.1%
香港ドル	投資証券	6銘柄	100.0%	0.9%
シンガポールドル	投資証券	22銘柄	100.0%	3.0%
韓国ウォン	投資証券	8銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシュケル	投資証券	3銘柄	100.0%	0.1%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 6月17日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	239,990,104
国債証券	48,934,876,410
地方債証券	1,921,804,621
特殊債券	2,096,553,711
社債券	1,504,194,000
未収利息	150,392,527
前払費用	7,044,677
流動資産合計	54,854,856,050
資産合計	54,854,856,050
負債の部	
流動負債	
未払解約金	11,062,299
流動負債合計	11,062,299

	2024年 6月17日現在
負債合計	11,062,299
純資産の部	
元本等	
元本	41,634,998,227
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	13,208,795,524
元本等合計	54,843,793,751
純資産合計	54,843,793,751
負債純資産合計	54,854,856,050

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 6月17日現在
1．	期首	2023年 6月20日
	期首元本額	37,185,676,902円
	期首からの追加設定元本額	5,785,918,151円
	期首からの一部解約元本額	1,336,596,826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
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	6,335,058,393円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	5,298,425,593円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	1,028,653,945円
	インデックスファンド日本債券（ＤＣ専用）	2,175,942,211円
	世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	4,636,888,576円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,839,701,160円
	Ｔｒａｃｅｒｓ　グローバル３分法（おとなのバランス）	29,393,855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
	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
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	3,067,373,592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
	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
	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
	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
	インデックスファンド日本債券（１年決算型）	5,720,716,710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
	計	41,634,998,227円
2．	受益権の総数	41,634,998,227口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ｉ金融商品の状況に関する事項

	自 2023年 6月20日 至 2024年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

（2024年 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

(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	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3173円 (13,173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４５０回利付国債（２年）	200,000,000	199,710,000	
	第４５１回利付国債（２年）	50,000,000	49,918,500	
	第４５４回利付国債（２年）	100,000,000	99,883,000	
	第４５５回利付国債（２年）	100,000,000	99,717,000	
	第４５６回利付国債（２年）	100,000,000	99,823,000	
	第４５７回利付国債（２年）	150,000,000	149,695,500	
	第４５８回利付国債（２年）	50,000,000	49,966,000	
	第１４９回利付国債（５年）	100,000,000	99,360,000	

第１５０回利付国債（５年）	50,000,000	49,626,500	
第１５１回利付国債（５年）	290,000,000	287,506,000	
第１５２回利付国債（５年）	100,000,000	99,399,000	
第１５３回利付国債（５年）	300,000,000	297,054,000	
第１５５回利付国債（５年）	100,000,000	99,740,000	
第１５６回利付国債（５年）	200,000,000	198,788,000	
第１５７回利付国債（５年）	150,000,000	148,863,000	
第１５８回利付国債（５年）	230,000,000	227,405,600	
第１５９回利付国債（５年）	150,000,000	148,050,000	
第１６０回利付国債（５年）	120,000,000	118,912,800	
第１６１回利付国債（５年）	120,000,000	119,385,600	
第１６２回利付国債（５年）	130,000,000	129,157,600	
第１６３回利付国債（５年）	270,000,000	269,379,000	
第１６４回利付国債（５年）	130,000,000	128,365,900	
第１６５回利付国債（５年）	130,000,000	128,939,200	
第１６６回利付国債（５年）	140,000,000	139,505,800	
第１６７回利付国債（５年）	120,000,000	119,414,400	
第１６８回利付国債（５年）	150,000,000	150,660,000	
第１回利付国債（４０年）	70,000,000	76,605,900	
第２回利付国債（４０年）	125,000,000	131,423,750	
第３回利付国債（４０年）	85,000,000	88,718,750	
第４回利付国債（４０年）	95,000,000	98,654,650	
第５回利付国債（４０年）	95,000,000	94,242,850	
第６回利付国債（４０年）	110,000,000	106,341,400	
第７回利付国債（４０年）	130,000,000	119,492,100	
第８回利付国債（４０年）	115,000,000	97,321,050	
第９回利付国債（４０年）	210,000,000	127,751,400	
第１０回利付国債（４０年）	175,000,000	125,027,000	
第１１回利付国債（４０年）	140,000,000	95,383,400	
第１２回利付国債（４０年）	175,000,000	104,749,750	
第１３回利付国債（４０年）	210,000,000	123,370,800	
第１４回利付国債（４０年）	210,000,000	131,428,500	
第１５回利付国債（４０年）	230,000,000	158,978,300	
第１６回利付国債（４０年）	220,000,000	167,048,200	
第１７回利付国債（４０年）	50,000,000	49,165,500	
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	59,523,000	
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	68,833,800	
第３４０回利付国債（１０年）	620,000,000	621,785,600	
第３４１回利付国債（１０年）	700,000,000	701,050,000	
第３４２回利付国債（１０年）	630,000,000	628,456,500	
第３４３回利付国債（１０年）	645,000,000	642,742,500	
第３４４回利付国債（１０年）	700,000,000	697,011,000	

第３４５回利付国債（１０年）	660,000,000	656,627,400	
第３４６回利付国債（１０年）	660,000,000	656,033,400	
第３４７回利付国債（１０年）	680,000,000	675,240,000	
第３４８回利付国債（１０年）	500,000,000	495,890,000	
第３４９回利付国債（１０年）	590,000,000	584,383,200	
第３５０回利付国債（１０年）	540,000,000	533,908,800	
第３５１回利付国債（１０年）	535,000,000	528,045,000	
第３５２回利付国債（１０年）	520,000,000	512,288,400	
第３５３回利付国債（１０年）	400,000,000	393,204,000	
第３５４回利付国債（１０年）	325,000,000	318,886,750	
第３５５回利付国債（１０年）	350,000,000	342,993,000	
第３５６回利付国債（１０年）	350,000,000	342,562,500	
第３５７回利付国債（１０年）	560,000,000	547,405,600	
第３５８回利付国債（１０年）	590,000,000	575,834,100	
第３５９回利付国債（１０年）	420,000,000	409,130,400	
第３６０回利付国債（１０年）	580,000,000	563,696,200	
第３６１回利付国債（１０年）	460,000,000	446,011,400	
第３６２回利付国債（１０年）	400,000,000	386,892,000	
第３６３回利付国債（１０年）	500,000,000	482,220,000	
第３６４回利付国債（１０年）	500,000,000	480,770,000	
第３６５回利付国債（１０年）	410,000,000	392,874,300	
第３６６回利付国債（１０年）	480,000,000	462,009,600	
第３６７回利付国債（１０年）	420,000,000	402,855,600	
第３６８回利付国債（１０年）	450,000,000	430,249,500	
第３６９回利付国債（１０年）	490,000,000	478,862,300	
第３７０回利付国債（１０年）	420,000,000	409,189,200	
第３７１回利付国債（１０年）	480,000,000	462,120,000	
第３７２回利付国債（１０年）	500,000,000	497,425,000	
第３７３回利付国債（１０年）	440,000,000	428,436,800	
第３７４回利付国債（１０年）	310,000,000	306,531,100	
第１回利付国債（３０年）	50,000,000	55,934,000	
第３回利付国債（３０年）	70,000,000	77,200,900	
第５回利付国債（３０年）	80,000,000	88,592,800	
第６回利付国債（３０年）	50,000,000	56,297,000	
第８回利付国債（３０年）	170,000,000	184,298,700	
第９回利付国債（３０年）	70,000,000	73,579,100	
第１０回利付国債（３０年）	50,000,000	51,248,000	
第１１回利付国債（３０年）	170,000,000	182,852,000	
第１２回利付国債（３０年）	50,000,000	55,530,500	
第１３回利付国債（３０年）	180,000,000	198,207,000	
第１４回利付国債（３０年）	108,000,000	122,855,400	
第１５回利付国債（３０年）	147,000,000	168,742,770	
第１６回利付国債（３０年）	35,000,000	40,202,050	

第１７回利付国債（３０年）	50,000,000	56,980,500	
第１８回利付国債（３０年）	110,000,000	124,246,100	
第１９回利付国債（３０年）	40,000,000	45,177,600	
第２０回利付国債（３０年）	40,000,000	46,024,400	
第２１回利付国債（３０年）	70,000,000	79,023,000	
第２２回利付国債（３０年）	70,000,000	80,534,300	
第２３回利付国債（３０年）	55,000,000	63,300,050	
第２４回利付国債（３０年）	68,000,000	78,282,280	
第２５回利付国債（３０年）	60,000,000	67,655,400	
第２６回利付国債（３０年）	170,000,000	193,526,300	
第２７回利付国債（３０年）	89,000,000	102,350,000	
第２８回利付国債（３０年）	144,000,000	165,415,680	
第２９回利付国債（３０年）	176,000,000	199,645,600	
第３０回利付国債（３０年）	147,000,000	164,382,750	
第３１回利付国債（３０年）	120,000,000	132,235,200	
第３２回利付国債（３０年）	160,000,000	178,124,800	
第３３回利付国債（３０年）	175,000,000	186,802,000	
第３４回利付国債（３０年）	160,000,000	174,995,200	
第３５回利付国債（３０年）	193,000,000	204,684,220	
第３６回利付国債（３０年）	195,000,000	206,354,850	
第３７回利付国債（３０年）	211,000,000	219,169,920	
第３８回利付国債（３０年）	165,000,000	168,182,850	
第３９回利付国債（３０年）	165,000,000	170,474,700	
第４０回利付国債（３０年）	130,000,000	131,885,000	
第４１回利付国債（３０年）	160,000,000	159,416,000	
第４２回利付国債（３０年）	135,000,000	134,106,300	
第４３回利付国債（３０年）	155,000,000	153,623,600	
第４４回利付国債（３０年）	150,000,000	148,323,000	
第４５回利付国債（３０年）	120,000,000	114,265,200	
第４６回利付国債（３０年）	160,000,000	151,944,000	
第４７回利付国債（３０年）	125,000,000	120,637,500	
第４８回利付国債（３０年）	135,000,000	125,253,000	
第４９回利付国債（３０年）	140,000,000	129,509,800	
第５０回利付国債（３０年）	145,000,000	118,264,900	
第５１回利付国債（３０年）	140,000,000	101,158,400	
第５２回利付国債（３０年）	190,000,000	143,453,800	
第５３回利付国債（３０年）	135,000,000	103,891,950	
第５４回利付国債（３０年）	160,000,000	128,468,800	
第５５回利付国債（３０年）	110,000,000	87,953,800	
第５６回利付国債（３０年）	140,000,000	111,560,400	
第５７回利付国債（３０年）	190,000,000	150,770,700	
第５８回利付国債（３０年）	180,000,000	142,237,800	
第５９回利付国債（３０年）	170,000,000	130,556,600	

第６０回利付国債（３０年）	120,000,000	96,392,400	
第６１回利付国債（３０年）	100,000,000	76,116,000	
第６２回利付国債（３０年）	120,000,000	86,200,800	
第６３回利付国債（３０年）	120,000,000	83,341,200	
第６４回利付国債（３０年）	100,000,000	69,038,000	
第６５回利付国債（３０年）	110,000,000	75,490,800	
第６６回利付国債（３０年）	180,000,000	122,799,600	
第６７回利付国債（３０年）	110,000,000	79,054,800	
第６８回利付国債（３０年）	140,000,000	100,135,000	
第６９回利付国債（３０年）	145,000,000	106,183,500	
第７０回利付国債（３０年）	140,000,000	102,138,400	
第７１回利付国債（３０年）	160,000,000	116,192,000	
第７２回利付国債（３０年）	160,000,000	115,752,000	
第７３回利付国債（３０年）	150,000,000	108,106,500	
第７４回利付国債（３０年）	150,000,000	117,165,000	
第７５回利付国債（３０年）	180,000,000	151,664,400	
第７６回利付国債（３０年）	150,000,000	129,315,000	
第７７回利付国債（３０年）	160,000,000	144,572,800	
第７８回利付国債（３０年）	150,000,000	128,865,000	
第７９回利付国債（３０年）	140,000,000	114,098,600	
第８０回利付国債（３０年）	150,000,000	141,459,000	
第８１回利付国債（３０年）	150,000,000	134,862,000	
第８２回利付国債（３０年）	100,000,000	94,161,000	
第８２回利付国債（２０年）	60,000,000	61,452,600	
第８７回利付国債（２０年）	130,000,000	134,460,300	
第８８回利付国債（２０年）	300,000,000	312,147,000	
第９０回利付国債（２０年）	16,000,000	16,687,200	
第９１回利付国債（２０年）	250,000,000	261,297,500	
第９２回利付国債（２０年）	60,000,000	62,686,800	
第９３回利付国債（２０年）	60,000,000	62,767,800	
第９４回利付国債（２０年）	50,000,000	52,443,000	
第９５回利付国債（２０年）	82,000,000	86,819,960	
第９６回利付国債（２０年）	248,000,000	261,101,840	
第９７回利付国債（２０年）	45,000,000	47,688,750	
第９８回利付国債（２０年）	94,000,000	99,313,820	
第９９回利付国債（２０年）	117,000,000	124,028,190	
第１００回利付国債（２０年）	80,000,000	85,356,000	
第１０１回利付国債（２０年）	66,000,000	70,907,100	
第１０２回利付国債（２０年）	81,000,000	87,334,200	
第１０３回利付国債（２０年）	71,000,000	76,272,460	
第１０４回利付国債（２０年）	33,000,000	35,190,540	
第１０５回利付国債（２０年）	77,000,000	82,341,490	
第１０６回利付国債（２０年）	62,000,000	66,560,100	

第１０７回利付国債（２０年）	130,000,000	139,382,100	
第１０８回利付国債（２０年）	134,000,000	142,487,560	
第１０９回利付国債（２０年）	107,000,000	114,007,430	
第１１０回利付国債（２０年）	98,000,000	105,328,440	
第１１１回利付国債（２０年）	95,000,000	102,936,300	
第１１２回利付国債（２０年）	80,000,000	86,292,000	
第１１３回利付国債（２０年）	290,000,000	313,930,800	
第１１４回利付国債（２０年）	52,000,000	56,473,560	
第１１５回利付国債（２０年）	125,000,000	136,425,000	
第１１６回利付国債（２０年）	135,000,000	147,792,600	
第１１７回利付国債（２０年）	343,000,000	373,585,310	
第１１８回利付国債（２０年）	70,000,000	76,032,600	
第１１９回利付国債（２０年）	60,000,000	64,472,400	
第１２０回利付国債（２０年）	170,000,000	180,638,600	
第１２１回利付国債（２０年）	142,000,000	153,689,440	
第１２２回利付国債（２０年）	17,000,000	18,296,420	
第１２３回利付国債（２０年）	195,000,000	213,918,900	
第１２４回利付国債（２０年）	90,000,000	98,166,600	
第１２５回利付国債（２０年）	50,000,000	55,300,000	
第１２６回利付国債（２０年）	105,000,000	114,726,150	
第１２７回利付国債（２０年）	50,000,000	54,306,500	
第１２８回利付国債（２０年）	65,000,000	70,704,400	
第１２９回利付国債（２０年）	85,000,000	91,887,550	
第１３０回利付国債（２０年）	150,000,000	162,292,500	
第１３１回利付国債（２０年）	92,000,000	98,900,000	
第１３２回利付国債（２０年）	135,000,000	145,145,250	
第１３３回利付国債（２０年）	110,000,000	119,095,900	
第１３４回利付国債（２０年）	120,000,000	129,993,600	
第１３５回利付国債（２０年）	30,000,000	32,265,600	
第１３６回利付国債（２０年）	220,000,000	234,993,000	
第１３７回利付国債（２０年）	200,000,000	215,160,000	
第１３８回利付国債（２０年）	120,000,000	127,228,800	
第１３９回利付国債（２０年）	230,000,000	245,598,600	
第１４０回利付国債（２０年）	318,000,000	342,155,280	
第１４１回利付国債（２０年）	235,000,000	252,850,600	
第１４２回利付国債（２０年）	165,000,000	178,853,400	
第１４３回利付国債（２０年）	154,000,000	164,347,260	
第１４４回利付国債（２０年）	330,000,000	349,324,800	
第１４５回利付国債（２０年）	315,000,000	338,814,000	
第１４６回利付国債（２０年）	195,000,000	209,584,050	
第１４７回利付国債（２０年）	208,000,000	221,526,240	
第１４８回利付国債（２０年）	220,000,000	231,833,800	
第１４９回利付国債（２０年）	225,000,000	236,846,250	

	第１５０回利付国債（２０年）	250,000,000	260,392,500	
	第１５１回利付国債（２０年）	240,000,000	244,795,200	
	第１５２回利付国債（２０年）	250,000,000	254,482,500	
	第１５３回利付国債（２０年）	270,000,000	276,930,900	
	第１５４回利付国債（２０年）	230,000,000	233,003,800	
	第１５５回利付国債（２０年）	270,000,000	266,967,900	
	第１５６回利付国債（２０年）	160,000,000	147,193,600	
	第１５７回利付国債（２０年）	220,000,000	196,603,000	
	第１５８回利付国債（２０年）	230,000,000	212,340,600	
	第１５９回利付国債（２０年）	210,000,000	195,447,000	
	第１６０回利付国債（２０年）	210,000,000	197,076,600	
	第１６１回利付国債（２０年）	180,000,000	166,075,200	
	第１６２回利付国債（２０年）	210,000,000	192,939,600	
	第１６３回利付国債（２０年）	165,000,000	150,862,800	
	第１６４回利付国債（２０年）	255,000,000	228,926,250	
	第１６５回利付国債（２０年）	170,000,000	151,816,800	
	第１６６回利付国債（２０年）	150,000,000	137,193,000	
	第１６７回利付国債（２０年）	200,000,000	176,802,000	
	第１６８回利付国債（２０年）	140,000,000	121,249,800	
	第１６９回利付国債（２０年）	160,000,000	135,651,200	
	第１７０回利付国債（２０年）	140,000,000	118,041,000	
	第１７１回利付国債（２０年）	170,000,000	142,453,200	
	第１７２回利付国債（２０年）	230,000,000	194,904,300	
	第１７３回利付国債（２０年）	190,000,000	160,130,100	
	第１７４回利付国債（２０年）	200,000,000	167,630,000	
	第１７５回利付国債（２０年）	180,000,000	152,649,000	
	第１７６回利付国債（２０年）	190,000,000	160,373,300	
	第１７７回利付国債（２０年）	200,000,000	165,048,000	
	第１７８回利付国債（２０年）	220,000,000	183,792,400	
	第１７９回利付国債（２０年）	220,000,000	182,901,400	
	第１８０回利付国債（２０年）	190,000,000	165,999,200	
	第１８１回利付国債（２０年）	190,000,000	168,233,600	
	第１８２回利付国債（２０年）	200,000,000	182,644,000	
	第１８３回利付国債（２０年）	190,000,000	181,974,400	
	第１８４回利付国債（２０年）	200,000,000	181,388,000	
	第１８５回利付国債（２０年）	230,000,000	207,788,900	
	第１８６回利付国債（２０年）	200,000,000	193,076,000	
	第１８７回利付国債（２０年）	170,000,000	158,069,400	
	第１８８回利付国債（２０年）	120,000,000	117,184,800	
国債証券 合計		50,580,000,000	48,934,876,410	
地方債証券	第４回東京都公募公債（東京グリーンボンド（５年））	100,000,000	99,711,000	
	第２６回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	107,191,000	
	第３２回東京都公募公債（５年）	200,000,000	199,534,000	

	令和３年度第６回北海道公募公債（５年）	100,000,000	99,231,000	
	第２１４回神奈川県公募公債	100,000,000	100,313,000	
	平成２７年度第１０回静岡県公募公債	200,000,000	200,528,000	
	平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）	100,000,000	101,987,000	
	第１４４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,250,416	
	第１４７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,307,000	
	第１６５回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,750,000	
	平成２８年度第１回長崎県公募公債	100,000,000	99,376,000	
	平成２７年度第１回佐賀県公募公債	100,000,000	100,290,000	
	平成２９年度第１回滋賀県公募公債	100,000,000	99,098,000	
	平成２７年度第２回熊本県公募公債（１０年）	100,000,000	100,287,000	
	第２回名古屋市定時償還公募公債（１０年）	15,000,000	15,011,205	
	平成２７年度第５回札幌市公募公債（１０年）	100,000,000	100,275,000	
	令和２年度第１回鹿児島県公募公債（５年）	100,000,000	99,665,000	
地方債証券 合計		1,915,000,000	1,921,804,621	
特殊債券	第５回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	99,325,000	
	第３５回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	198,440,000	
	第６０回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,017,000	
	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	105,095,000	
	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	106,221,000	
	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	100,192,000	
	第２７３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,441,000	
	第３２４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	197,854,000	
	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	98,615,000	
	第９６回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,322,000	
	第９７回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,202,000	
	第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,124,000	
	第５２回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	98,497,000	
	第３６３回信金中金債（５年）	100,000,000	99,852,711	
	第３９５回信金中金債（５年）	100,000,000	98,859,000	
	第２９回国際協力機構債券	100,000,000	100,268,000	
	第３７回国際協力機構債券	100,000,000	99,229,000	
特殊債券 合計		2,100,000,000	2,096,553,711	
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	99,779,000	
	第２５回味の素株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,356,000	
	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	98,534,000	
	第１７回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）（ソーシャルボンド）	100,000,000	98,772,000	
	第１４回株式会社小松製作所無担保社債（社債間限定同順位特約付）（グリーンボンド）	100,000,000	99,698,000	

	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	99,525,000	
	第１８４回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,749,000	
	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）	100,000,000	107,089,000	
	第５１０回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,362,000	
	第５５２回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,933,000	
	第４００回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	98,909,000	
	第４４７回中国電力株式会社社債（一般担保付）（トランジションボンド）	100,000,000	98,929,000	
	第３１回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,805,000	
	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	99,722,000	
	第２８回東京瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	105,032,000	
社債券 合計		1,500,000,000	1,504,194,000	
合計		56,095,000,000	54,457,428,742	

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
資産の部	
流動資産	
預金	115,540,209
コール・ローン	86,680,360
国債証券	168,779,266,015
派生商品評価勘定	57,938
未収入金	80,078,161
未収利息	1,228,981,169
前払費用	75,582,557
流動資産合計	170,366,186,409
資産合計	170,366,186,409
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	76,617
未払解約金	162,365,840
流動負債合計	162,442,457
負債合計	162,442,457
純資産の部	
元本等	
元本	55,620,468,481
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	114,583,275,471
元本等合計	170,203,743,952
純資産合計	170,203,743,952
負債純資産合計	170,366,186,409

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 6月17日現在
1．	期首	2023年 6月20日
	期首元本額	58,231,039,162円
	期首からの追加設定元本額	3,685,158,911円
	期首からの一部解約元本額	6,295,729,592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
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	425,726,925円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	612,613,905円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	919,335,691円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	891,421,308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
	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
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	11,490,037,749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
	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
	財産３分法（適格機関投資家専用）	347,202,276円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	935,868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
	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
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	454,153,367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
	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
	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
	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
	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
	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
	計	55,620,468,481円
2．	受益権の総数	55,620,468,481口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2023年 6月20日 至 2024年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

（2024年 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

(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

（注）1.時価の算定方法

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

①同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2024年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	3.0601円
(1万口当たり純資産額)	(30,601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%-25/05/31	1,420,000.00	1,390,628.72	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/05/31	3,820,000.00	3,649,200.16	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/06/15	5,000,000.00	4,894,225.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	1,370,000.00	1,338,653.03	
		US TREASURY N/B-3.0%-25/07/15	5,000,000.00	4,895,505.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	1,440,000.00	1,407,036.96	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	3,000,000.00	2,846,658.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	4,730,000.00	4,571,838.26	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/08/31	3,000,000.00	2,922,186.00	
		US TREASURY N/B-5.0%-25/08/31	5,000,000.00	4,999,900.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	4,200,000.00	4,099,510.80	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/09/30	1,570,000.00	1,479,049.90	
		US TREASURY N/B-4.25%-25/10/15	170,000.00	168,502.47	
		US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,364,834.80	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	2,110,000.00	1,981,256.24	
		US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	3,440,000.00	3,317,178.24	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,283,286.84	
		US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	3,420,000.00	3,206,113.20	
		US TREASURY N/B-4.875%-25/11/30	4,000,000.00	3,999,920.00	
		US TREASURY N/B-4.0%-25/12/15	1,510,000.00	1,491,360.56	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	1,934,920.00	
		US TREASURY N/B-3.875%-26/01/15	1,150,000.00	1,133,311.20	
		US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	1,787,127.75	
		US TREASURY N/B-0.375%-26/01/31	2,370,000.00	2,207,292.39	
		US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	1,838,952.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,310,000.00	3,143,205.79	
		US TREASURY N/B-4.0%-26/02/15	3,000,000.00	2,962,089.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,723,573.10	
		US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	3,650,000.00	3,397,277.65	
		US TREASURY N/B-4.625%-26/02/28	2,820,000.00	2,812,507.26	
		US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	4,490,000.00	4,299,525.22	
		US TREASURY N/B-0.75%-26/03/31	2,400,000.00	2,237,390.40	

		US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	1,050,000.00	1,006,317.90	
		US TREASURY N/B-0.75%-26/04/30	2,740,000.00	2,547,610.90	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	4,840,000.00	4,570,015.12	
		US TREASURY N/B-3.625%-26/05/15	6,750,000.00	6,618,159.00	
		US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	2,740,000.00	2,610,384.30	
		US TREASURY N/B-0.75%-26/05/31	2,800,000.00	2,596,232.80	
		US TREASURY N/B-4.125%-26/06/15	3,000,000.00	2,968,827.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	1,893,202.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	960,000.00	906,936.96	
		US TREASURY N/B-0.625%-26/07/31	3,260,000.00	2,998,880.52	
		US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,744,840.00	
		US TREASURY N/B-0.75%-26/08/31	3,000,000.00	2,760,000.00	
		US TREASURY N/B-4.625%-26/09/15	2,600,000.00	2,600,507.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,517,230.44	
		US TREASURY N/B-0.875%-26/09/30	2,000,000.00	1,841,600.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	250,000.00	233,554.50	
		US TREASURY N/B-1.125%-26/10/31	3,950,000.00	3,647,809.20	
		US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,040,000.00	2,863,418.56	
		US TREASURY N/B-4.625%-26/11/15	3,200,000.00	3,204,499.20	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,400,000.00	2,238,561.60	
		US TREASURY N/B-1.25%-26/11/30	2,210,000.00	2,043,041.13	
		US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	1,868,906.00	
		US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	4,000,000.00	3,705,780.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	2,680,000.00	2,530,399.72	
		US TREASURY N/B-4.125%-27/02/15	1,880,000.00	1,862,337.40	
		US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,390,000.00	1,272,175.26	
		US TREASURY N/B-4.25%-27/03/15	2,300,000.00	2,286,478.30	
		US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	670,000.00	603,209.04	
		US TREASURY N/B-4.5%-27/04/15	2,430,000.00	2,432,276.91	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	1,380,000.00	1,234,506.60	
		US TREASURY N/B-2.75%-27/04/30	1,430,000.00	1,364,894.96	
		US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,330,745.62	
		US TREASURY N/B-4.5%-27/05/15	4,700,000.00	4,705,320.40	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	1,600,000.00	1,427,000.00	
		US TREASURY N/B-2.625%-27/05/31	1,750,000.00	1,662,430.00	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	2,600,000.00	2,313,287.60	
		US TREASURY N/B-3.25%-27/06/30	5,000,000.00	4,834,275.00	
		US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	5,950,000.00	5,255,289.90	
		US TREASURY N/B-2.75%-27/07/31	930,000.00	884,916.39	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	2,772,282.72	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	2,900,000.00	2,564,687.50	
		US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	4,090,000.00	3,592,406.51	

		US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	3,640,000.00	3,200,637.44	
		US TREASURY N/B-4.125%-27/10/31	800,000.00	793,359.20	
		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	1,400,000.00	1,478,940.40	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	2,817,445.58	
		US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	220,000.00	193,819.12	
		US TREASURY N/B-3.875%-27/11/30	2,320,000.00	2,283,070.24	
		US TREASURY N/B-0.625%-27/12/31	2,410,000.00	2,117,315.14	
		US TREASURY N/B-0.75%-28/01/31	2,850,000.00	2,508,832.20	
		US TREASURY N/B-3.5%-28/01/31	1,450,000.00	1,408,651.80	
		US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	3,783,512.00	
		US TREASURY N/B-1.125%-28/02/29	3,830,000.00	3,411,913.37	
		US TREASURY N/B-4.0%-28/02/29	2,650,000.00	2,618,271.55	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/03/31	960,000.00	857,361.60	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	3,370,000.00	3,003,445.10	
		US TREASURY N/B-3.5%-28/04/30	3,000,000.00	2,912,049.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	2,440,000.00	2,313,376.20	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	4,300,000.00	3,824,983.30	
		US TREASURY N/B-3.625%-28/05/31	1,020,000.00	994,439.82	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	3,300,000.00	2,928,555.30	
		US TREASURY N/B-4.0%-28/06/30	200,000.00	197,718.60	
		US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	2,920,000.00	2,558,991.64	
		US TREASURY N/B-4.125%-28/07/31	5,950,000.00	5,910,486.05	
		US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	3,971,952.60	
		US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	2,960,000.00	2,601,848.88	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	3,700,000.00	3,262,286.30	
		US TREASURY N/B-4.625%-28/09/30	2,400,000.00	2,430,513.60	
		US TREASURY N/B-1.375%-28/10/31	3,800,000.00	3,363,220.40	
		US TREASURY N/B-4.875%-28/10/31	2,100,000.00	2,148,684.30	
		US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,112,841.73	
		US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	2,610,000.00	2,488,674.15	
		US TREASURY N/B-1.5%-28/11/30	4,930,000.00	4,380,285.28	
		US TREASURY N/B-4.375%-28/11/30	1,050,000.00	1,054,490.85	
		US TREASURY N/B-1.375%-28/12/31	870,000.00	767,162.52	
		US TREASURY N/B-4.0%-29/01/31	2,700,000.00	2,670,308.10	
		US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,590,000.00	4,274,074.89	
		US TREASURY N/B-4.25%-29/02/28	5,000,000.00	5,001,070.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-29/03/31	4,630,000.00	4,255,979.34	
		US TREASURY N/B-2.875%-29/04/30	2,000,000.00	1,879,804.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	4,810,000.00	4,414,959.51	
		US TREASURY N/B-3.25%-29/06/30	4,980,000.00	4,755,900.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	1,670,000.00	1,471,817.76	
		US TREASURY N/B-3.875%-29/09/30	325,000.00	319,388.55	
		US TREASURY N/B-4.0%-29/10/31	1,920,000.00	1,898,323.20	

		US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	7,190,000.00	6,345,735.82	
		US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	3,749,521.30	
		US TREASURY N/B-4.0%-30/02/28	1,650,000.00	1,630,985.40	
		US TREASURY N/B-3.625%-30/03/31	2,550,000.00	2,471,505.90	
		US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,171,465.36	
		US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	4,590,000.00	3,735,915.75	
		US TREASURY N/B-3.75%-30/05/31	710,000.00	692,374.25	
		US TREASURY N/B-4.0%-30/07/31	4,900,000.00	4,841,332.30	
		US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	5,090,000.00	4,107,986.30	
		US TREASURY N/B-4.625%-30/09/30	800,000.00	817,577.60	
		US TREASURY N/B-4.875%-30/10/31	3,000,000.00	3,108,513.00	
		US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	5,910,000.00	4,817,571.96	
		US TREASURY N/B-4.375%-30/11/30	3,000,000.00	3,026,190.00	
		US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	560,000.00	600,709.20	
		US TREASURY N/B-1.125%-31/02/15	3,300,000.00	2,723,143.50	
		US TREASURY N/B-4.25%-31/02/28	1,000,000.00	1,002,265.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	6,020,000.00	5,097,946.70	
		US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	5,470,000.00	4,480,695.80	
		US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	6,530,000.00	5,362,762.50	
		US TREASURY N/B-1.875%-32/02/15	5,870,000.00	4,981,698.77	
		US TREASURY N/B-2.875%-32/05/15	4,800,000.00	4,372,310.40	
		US TREASURY N/B-2.75%-32/08/15	5,100,000.00	4,590,096.90	
		US TREASURY N/B-4.125%-32/11/15	6,110,000.00	6,074,317.60	
		US TREASURY N/B-3.5%-33/02/15	2,610,000.00	2,475,063.00	
		US TREASURY N/B-3.375%-33/05/15	1,680,000.00	1,575,720.72	
		US TREASURY N/B-3.875%-33/08/15	3,330,000.00	3,243,170.25	
		US TREASURY N/B-4.5%-33/11/15	5,540,000.00	5,660,749.84	
		US TREASURY N/B-4.0%-34/02/15	2,000,000.00	1,966,718.00	
		US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	827,812.00	
		US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	811,259.25	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	681,855.65	
		US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	720,000.00	741,402.72	
		US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	735,608.80	
		US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	1,447,281.25	
		US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	1,456,498.26	
		US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	757,983.00	
		US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	706,057.60	
		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	1,603,290.81	
		US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	2,340,538.60	
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,364,878.08	
		US TREASURY N/B-1.125%-40/08/15	3,000,000.00	1,879,218.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	1,000,018.17	

		US TREASURY N/B-1.375%-40/11/15	3,100,000.00	2,013,787.90	
		US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	1,574,002.50	
		US TREASURY N/B-1.875%-41/02/15	4,200,000.00	2,953,452.60	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	872,089.74	
		US TREASURY N/B-2.25%-41/05/15	4,900,000.00	3,641,596.70	
		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	887,211.84	
		US TREASURY N/B-1.75%-41/08/15	3,190,000.00	2,167,764.50	
		US TREASURY N/B-2.0%-41/11/15	3,000,000.00	2,116,464.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	420,605.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	630,593.60	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	1,570,546.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	1,765,000.00	1,463,569.77	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	1,630,949.25	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	1,950,000.00	1,734,661.50	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	1,890,714.32	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	1,080,000.00	958,119.84	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,000,000.00	1,706,014.00	
		US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	2,150,000.00	1,760,226.50	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	1,900,000.00	1,520,110.20	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	2,120,000.00	1,551,823.04	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	1,400,000.00	1,116,334.80	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	1,390,000.00	1,082,733.55	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	1,190,000.00	945,816.76	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	1,300,000.00	942,093.10	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	1,500,000.00	1,083,631.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	1,650,000.00	1,132,891.65	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	540,000.00	417,086.28	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	1,720,000.00	1,356,044.56	
		US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	1,530,000.00	1,204,634.79	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	1,700,000.00	1,276,128.80	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,740,000.00	1,303,775.04	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	2,155,848.75	
		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	1,923,842.40	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	3,208,086.00	
		US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	2,469,931.75	
		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	2,579,798.10	
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	2,288,319.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,950,000.00	1,973,042.60	
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	2,129,613.20	
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	2,327,385.10	
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	2,450,000.00	1,261,941.10	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,920,000.00	1,551,019.32	
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	3,000,000.00	1,703,496.00	

		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	4,750,000.00	2,876,158.25	
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	4,100,000.00	2,795,363.60	
		US TREASURY N/B-2.0%-51/08/15	2,000,000.00	1,245,428.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/11/15	1,400,000.00	843,718.40	
		US TREASURY N/B-2.25%-52/02/15	2,000,000.00	1,321,014.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-52/05/15	600,000.00	455,566.20	
		US TREASURY N/B-3.0%-52/08/15	1,100,000.00	856,946.20	
		US TREASURY N/B-4.0%-52/11/15	1,500,000.00	1,412,724.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-53/02/15	2,900,000.00	2,550,866.10	
		US TREASURY N/B-3.625%-53/05/15	2,150,000.00	1,891,370.05	
		US TREASURY N/B-4.125%-53/08/15	1,500,000.00	1,443,750.00	
		US TREASURY N/B-4.75%-53/11/15	1,500,000.00	1,603,242.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-54/02/15	1,000,000.00	984,218.00	
		US TREASURY N/B-4.625%-54/05/15	1,500,000.00	1,571,250.00	
米ドル小計			566,390,000.00	506,767,167.57 (79,831,031,907)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	950,000.00	932,417.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-25/08/01	510,000.00	506,189.28	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-25/09/01	1,755,000.00	1,682,146.44	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-25/10/01	430,000.00	424,182.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-25/11/01	450,000.00	452,538.45	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-26/02/01	620,000.00	625,325.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	995,000.00	936,732.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-26/04/01	700,000.00	689,973.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-26/05/01	870,000.00	872,617.83	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	670,000.00	642,012.76	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-26/09/01	990,000.00	934,124.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	520,000.00	489,456.24	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	750,000.00	698,807.25	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-27/09/01	620,000.00	607,179.64	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-28/03/01	580,000.00	582,222.56	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	897,000.00	854,085.72	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-28/09/01	630,000.00	627,706.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-29/03/01	950,000.00	978,450.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	410,000.00	456,998.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	364,000.00	348,303.22	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-29/09/01	50,000.00	50,499.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/12/01	120,000.00	114,485.52	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	1,848,000.00	1,649,404.68	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-30/12/01	1,205,000.00	1,014,191.86	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	1,746,000.00	1,557,025.18	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/12/01	1,520,000.00	1,344,646.72	

		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-32/06/01	1,070,000.00	976,239.11	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-32/12/01	890,000.00	840,524.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	710,000.00	845,661.83	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-33/06/01	500,000.00	480,148.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-33/12/01	800,000.00	798,489.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-34/06/01	420,000.00	410,212.74	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	290,000.00	341,687.57	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	550,000.00	599,628.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	520,000.00	538,044.52	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	650,000.00	596,035.05	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	2,123,000.00	1,645,847.25	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-53/12/01	1,241,000.00	894,893.78	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-55/12/01	600,000.00	545,687.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	303,930.09	
加ドル小計			31,849,000.00	29,888,755.49 (3,427,941,367)	
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	24,250,000.00	22,317,578.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.0%-26/09/03	3,000,000.00	2,775,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	13,350,000.00	11,789,718.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	20,500,000.00	18,924,062.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/03/01	4,900,000.00	4,579,968.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	14,120,000.00	13,197,787.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	19,900,000.00	17,549,312.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-33/05/26	12,800,000.00	10,860,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	6,000,000.00	5,090,625.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-35/05/24	1,500,000.00	1,294,252.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	4,400,000.00	4,367,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	11,170,000.00	9,787,712.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	14,100,000.00	11,271,187.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	13,570,000.00	10,957,775.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-53/07/31	9,550,000.00	7,625,078.12	
メキシコペソ小計			173,110,000.00	152,387,058.74 (1,296,951,018)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	270,000.00	113,175.90	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,020,000.00	994,328.64	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	505,000.00	517,645.20	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	772,000.00	742,282.63	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	780,000.00	734,132.10	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	545,000.00	496,372.92	

		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	970,000.00	1,062,214.02	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	795,000.00	735,890.95	
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	950,000.00	867,180.90	
		BELGIUM KINGDOM-2.7%-29/10/22	152,000.00	151,171.14	
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	730,000.00	621,983.36	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	855,000.00	754,948.75	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-31/10/22	750,000.00	609,605.25	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	475,000.00	510,925.20	
		BELGIUM KINGDOM-0.35%-32/06/22	675,000.00	552,555.00	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	525,000.00	457,335.90	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-33/06/22	476,000.00	477,378.96	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	543,000.00	542,040.51	
		BELGIUM KINGDOM-2.85%-34/10/22	50,000.00	49,097.15	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	974,000.00	1,142,086.10	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	340,000.00	276,698.80	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	415,000.00	352,418.83	
		BELGIUM KINGDOM-2.75%-39/04/22	160,000.00	150,225.60	
		BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	405,000.00	259,675.87	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	992,000.00	1,107,377.53	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	435,000.00	457,016.65	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	538,000.00	383,606.37	
		BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	626,000.00	439,792.54	
		BELGIUM KINGDOM-1.4%-53/06/22	485,000.00	304,063.47	
		BELGIUM KINGDOM-3.3%-54/06/22	433,000.00	416,646.87	
		BELGIUM KINGDOM-3.5%-55/06/22	235,000.00	233,637.00	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	412,000.00	315,317.19	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	446,000.00	329,695.24	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-71/10/31	345,000.00	169,418.11	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	1,205,000.00	1,222,319.46	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%-25/10/31	1,455,000.00	1,435,094.14	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-26/01/31	1,455,000.00	1,384,477.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-26/04/30	1,055,000.00	1,033,768.12	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.8%-26/05/31	485,000.00	482,341.71	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	1,360,000.00	1,437,972.88	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%-26/10/31	1,640,000.00	1,576,994.48	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-27/01/31	755,000.00	698,383.30	
			1,275,000.00	1,224,063.75	

		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%-27/04/30			
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.5%-27/05/31	120,000.00	118,307.88	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%-27/07/30	1,315,000.00	1,231,138.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-27/10/31	1,300,000.00	1,238,668.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-28/01/31	1,125,000.00	1,012,513.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/04/30	1,270,000.00	1,199,803.29	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/07/30	1,275,000.00	1,200,597.37	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-28/10/31	1,020,000.00	1,111,614.36	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	1,355,000.00	1,533,494.15	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-29/04/30	1,275,000.00	1,190,739.07	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.5%-29/05/31	430,000.00	440,489.42	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%-29/07/30	1,035,000.00	930,082.05	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%-29/10/31	1,280,000.00	1,132,436.48	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-30/04/30	1,205,000.00	1,047,347.44	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-30/07/30	1,180,000.00	1,113,699.34	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%-30/10/31	1,180,000.00	1,062,422.44	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%-31/04/30	1,245,000.00	1,023,162.16	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-31/10/31	1,015,000.00	846,503.91	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.7%-32/04/30	1,270,000.00	1,060,481.75	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	1,170,000.00	1,389,338.73	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.55%-32/10/31	1,045,000.00	1,000,036.78	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-33/04/30	1,082,000.00	1,078,432.64	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%-33/07/30	1,165,000.00	1,087,692.93	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.55%-33/10/31	1,030,000.00	1,055,404.94	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.25%-34/04/30	553,000.00	551,333.25	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%-35/07/30	995,000.00	858,030.29	

		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	1,055,000.00	1,136,272.98	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.85%-37/07/30	670,000.00	485,463.24	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.9%-39/07/30	340,000.00	351,517.16	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	1,045,000.00	1,205,149.38	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%-40/10/31	1,000,000.00	701,962.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	1,265,000.00	1,434,421.45	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-42/07/30	390,000.00	254,607.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-43/07/30	300,000.00	288,481.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	710,000.00	854,056.87	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	980,000.00	856,855.16	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	985,000.00	819,544.62	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-50/10/31	1,170,000.00	636,997.14	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.9%-52/10/31	743,000.00	499,370.30	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-54/10/31	150,000.00	152,670.75	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	848,000.00	771,203.42	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-25/10/10	1,650,000.00	1,587,611.85	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-26/04/10	1,600,000.00	1,523,646.40	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-26/10/09	800,000.00	753,512.00	
		BUNDESOBLIGATION-0.0%-27/04/16	1,050,000.00	978,319.65	
		BUNDESOBLIGATION-1.3%-27/10/15	1,130,000.00	1,088,901.90	
		BUNDESOBLIGATION-2.2%-28/04/13	750,000.00	743,777.25	
		BUNDESOBLIGATION-2.4%-28/10/19	685,000.00	685,089.73	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15	2,070,000.00	2,021,245.29	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	1,820,000.00	1,752,237.76	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-26/08/15	1,910,000.00	1,805,393.12	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	1,315,000.00	1,238,606.39	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	910,000.00	1,014,515.32	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15	1,770,000.00	1,665,596.55	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-27/11/15	1,295,000.00	1,192,406.21	

		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	650,000.00	719,425.85	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-28/02/15	1,690,000.00	1,578,573.23	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	970,000.00	1,057,029.37	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-28/08/15	1,670,000.00	1,532,325.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-28/11/15	1,180,000.00	1,065,416.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-29/02/15	1,705,000.00	1,550,813.44	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-29/08/15	1,760,000.00	1,565,016.64	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.1%-29/11/15	620,000.00	612,446.54	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	660,000.00	792,201.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/02/15	1,360,000.00	1,196,562.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/08/15	1,800,000.00	1,567,780.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/08/15	740,000.00	644,971.42	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	1,110,000.00	1,319,649.03	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/02/15	1,310,000.00	1,128,077.68	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/08/15	1,565,000.00	1,333,054.48	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/08/15	400,000.00	340,936.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-32/02/15	1,323,000.00	1,113,006.82	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.7%-32/08/15	1,380,000.00	1,319,648.46	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.3%-33/02/15	1,770,000.00	1,767,973.35	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.3%-33/02/15	170,000.00	169,860.26	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.6%-33/08/15	1,310,000.00	1,338,623.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.2%-34/02/15	850,000.00	838,808.90	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	1,300,000.00	1,574,300.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-35/05/15	1,030,000.00	795,370.12	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-36/05/15	1,000,000.00	751,197.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	1,790,000.00	2,084,787.94	

		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-38/05/15	115,000.00	94,974.82	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	1,135,000.00	1,378,733.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	1,165,000.00	1,504,321.39	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	955,000.00	1,051,222.93	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-44/07/04	1,635,000.00	1,622,737.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-46/08/15	1,697,000.00	1,686,911.33	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%-48/08/15	2,040,000.00	1,576,012.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	1,630,000.00	857,777.72	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	640,000.00	338,248.32	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-52/08/15	900,000.00	452,684.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%-53/08/15	1,040,000.00	888,737.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%-53/08/15	500,000.00	428,144.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-54/08/15	345,000.00	344,180.62	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.8%-25/06/12	910,000.00	906,648.47	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-3.1%-25/12/12	420,000.00	420,875.70	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.5%-26/03/19	280,000.00	278,414.08	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-72/03/01	220,000.00	133,768.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-25/06/01	1,300,000.00	1,275,670.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%-25/07/01	1,000,000.00	983,300.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.6%-25/09/29	85,000.00	85,078.45	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-25/11/15	1,100,000.00	1,086,356.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-25/12/01	1,085,000.00	1,063,462.75	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-26/01/15	810,000.00	810,710.37	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%-26/02/01	850,000.00	811,075.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-26/03/01	1,330,000.00	1,353,620.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-26/04/01	1,020,000.00	960,574.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%-26/04/15	950,000.00	956,483.75	
			970,000.00	937,682.51	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%-26/06/01			
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%-26/07/15	950,000.00	926,441.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-26/08/01	870,000.00	810,630.33	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-26/09/15	445,000.00	449,592.84	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	720,000.00	783,576.72	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%-26/12/01	1,080,000.00	1,027,890.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%-27/01/15	1,005,000.00	944,360.31	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.1%-27/04/01	410,000.00	385,896.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%-27/06/01	1,160,000.00	1,123,773.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%-27/08/01	995,000.00	957,688.49	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-27/09/15	775,000.00	719,086.85	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	1,440,000.00	1,585,118.88	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.65%-27/12/01	950,000.00	929,183.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-28/02/01	1,365,000.00	1,303,594.11	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%-28/03/15	1,140,000.00	1,017,239.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.4%-28/04/01	150,000.00	150,241.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%-28/07/15	1,130,000.00	1,008,941.97	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%-28/08/01	650,000.00	660,428.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-28/09/01	1,330,000.00	1,401,132.39	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-28/12/01	1,030,000.00	1,006,801.31	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.1%-29/02/01	735,000.00	756,724.39	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%-29/02/15	605,000.00	529,238.87	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-29/06/15	305,000.00	296,409.67	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-29/08/01	1,945,000.00	1,907,766.86	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	1,750,000.00	1,906,822.75	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-29/12/15	535,000.00	544,940.83	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-30/03/01	1,500,000.00	1,503,807.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%-30/04/01	1,075,000.00	956,083.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.7%-30/06/15	540,000.00	544,888.62	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-30/08/01	897,000.00	771,001.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-30/11/15	585,000.00	599,492.79	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-30/12/01	1,287,000.00	1,146,837.97	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-31/02/15	235,000.00	233,762.72	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%-31/04/01	1,295,000.00	1,089,063.92	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	1,515,000.00	1,740,533.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%-31/08/01	1,120,000.00	911,858.08	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-31/10/30	290,000.00	297,589.59	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-31/12/01	1,010,000.00	836,259.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-32/03/01	1,250,000.00	1,086,211.25	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-32/06/01	1,130,000.00	921,678.85	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-32/12/01	670,000.00	612,429.58	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	1,425,000.00	1,632,544.12	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.4%-33/05/01	865,000.00	907,212.86	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-33/09/01	1,195,000.00	1,075,203.64	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.35%-33/11/01	700,000.00	729,739.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.2%-34/03/01	705,000.00	725,480.25	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	1,460,000.00	1,599,159.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%-35/03/01	980,000.00	932,772.82	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-35/04/30	400,000.00	404,053.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-36/03/01	770,000.00	591,013.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%-36/09/01	965,000.00	805,858.95	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	1,825,000.00	1,832,482.50	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-37/03/01	400,000.00	279,548.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.05%-37/10/30	290,000.00	290,443.12	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-38/03/01	200,000.00	182,542.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%-38/09/01	785,000.00	689,301.43	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	1,200,000.00	1,311,018.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.15%-39/10/01	350,000.00	348,757.15	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%-40/03/01	810,000.00	711,734.04	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	1,070,000.00	1,168,660.42	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%-41/03/01	730,000.00	523,778.65	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.45%-43/09/01	500,000.00	511,102.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01	935,000.00	995,891.87	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-45/04/30	440,000.00	277,257.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-46/09/01	820,000.00	704,063.48	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%-47/03/01	970,000.00	755,286.62	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%-48/03/01	915,000.00	805,177.12	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-49/09/01	650,000.00	606,563.75	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-50/09/01	870,000.00	625,456.92	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%-51/09/01	750,000.00	453,893.25	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-52/09/01	280,000.00	184,544.36	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-53/10/01	735,000.00	750,961.99	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	500,000.00	363,612.50	
		FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	332,000.00	334,723.39	
		FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	247,000.00	240,225.03	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	245,000.00	234,407.91	
		FINNISH GOVERNMENT-0.0%-26/09/15	180,000.00	168,706.26	
		FINNISH GOVERNMENT-1.375%-27/04/15	170,000.00	163,149.51	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	350,000.00	325,224.55	
		FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	330,000.00	329,776.26	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	245,362.50	
		FINNISH GOVERNMENT-2.875%-29/04/15	180,000.00	180,404.64	

		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	375,000.00	333,365.62	
		FINNISH GOVERNMENT-0.0%-30/09/15	292,000.00	245,387.45	
		FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	365,000.00	318,412.86	
		FINNISH GOVERNMENT-0.125%-31/09/15	200,000.00	164,713.40	
		FINNISH GOVERNMENT-1.5%-32/09/15	230,000.00	206,493.31	
		FINNISH GOVERNMENT-3.0%-33/09/15	110,000.00	110,323.18	
		FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	325,000.00	274,608.10	
		FINNISH GOVERNMENT-3.0%-34/09/15	140,000.00	140,010.64	
		FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	278,000.00	197,758.35	
		FINNISH GOVERNMENT-2.75%-38/04/15	210,000.00	200,985.96	
		FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15	210,000.00	133,818.51	
		FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	277,000.00	257,383.69	
		FINNISH GOVERNMENT-0.5%-43/04/15	235,000.00	147,939.31	
		FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	187,570.76	
		FINNISH GOVERNMENT-0.125%-52/04/15	250,000.00	115,895.75	
		FINNISH GOVERNMENT-2.95%-55/04/15	110,000.00	106,080.70	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	515,000.00	191,390.48	
		FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	1,570,000.00	1,626,058.42	
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	2,000,000.00	1,938,926.00	
		FRANCE (GOVT OF)-0.0%-26/02/25	2,270,000.00	2,156,454.60	
		FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	1,970,000.00	1,984,818.34	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,450,000.00	2,334,507.00	
		FRANCE (GOVT OF)-2.5%-26/09/24	1,360,000.00	1,344,300.16	
		FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,520,000.00	2,358,392.40	
		FRANCE (GOVT OF)-0.0%-27/02/25	2,005,000.00	1,852,622.00	
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	1,775,000.00	1,677,987.37	
		FRANCE (GOVT OF)-2.5%-27/09/24	180,000.00	177,423.30	
		FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,020,000.00	2,998,615.38	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/02/25	1,275,000.00	1,178,448.07	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	3,765,000.00	3,463,001.82	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	3,080,000.00	2,805,011.44	
		FRANCE (GOVT OF)-2.75%-29/02/25	305,000.00	302,447.15	
		FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	2,105,000.00	2,340,924.19	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	2,980,000.00	2,652,638.06	
		FRANCE (GOVT OF)-0.0%-29/11/25	2,510,000.00	2,147,362.73	
		FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	2,935,000.00	2,868,222.88	
		FRANCE (GOVT OF)-0.0%-30/11/25	2,839,000.00	2,356,259.27	
		FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	2,940,000.00	2,675,620.50	
		FRANCE (GOVT OF)-0.0%-31/11/25	2,605,000.00	2,093,773.96	
		FRANCE (GOVT OF)-0.0%-32/05/25	1,903,000.00	1,503,982.76	
		FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	1,655,000.00	1,977,862.36	
		FRANCE (GOVT OF)-2.0%-32/11/25	2,075,000.00	1,915,720.92	

		FRANCE (GOVT OF)-3.0%-33/05/25	1,260,000.00	1,252,050.66	
		FRANCE (GOVT OF)-3.5%-33/11/25	1,113,000.00	1,147,247.01	
		FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	2,305,000.00	1,939,811.93	
		FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	1,425,000.00	1,628,273.40	
		FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	2,555,000.00	2,058,474.07	
		FRANCE (GOVT OF)-1.25%-38/05/25	190,000.00	146,158.45	
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	1,500,000.00	1,613,175.00	
		FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	1,890,000.00	1,541,391.39	
		FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	2,780,000.00	3,167,907.30	
		FRANCE (GOVT OF)-2.5%-43/05/25	135,000.00	117,042.16	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-44/06/25	1,050,000.00	610,493.10	
		FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	1,430,000.00	1,386,645.26	
		FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	1,580,000.00	1,202,677.04	
		FRANCE (GOVT OF)-3.0%-49/06/25	248,000.00	228,587.05	
		FRANCE (GOVT OF)-1.5%-50/05/25	1,840,000.00	1,222,775.68	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-52/05/25	1,500,000.00	777,454.50	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-53/05/25	1,320,000.00	668,401.80	
		FRANCE (GOVT OF)-3.0%-54/05/25	850,000.00	764,672.75	
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,190,000.00	1,290,433.62	
		FRANCE (GOVT OF)-3.25%-55/05/25	400,000.00	375,987.60	
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,070,000.00	1,173,386.61	
		FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	945,000.00	607,755.01	
		IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	560,000.00	540,606.08	
		IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15	327,000.00	304,080.57	
		IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	425,000.00	397,230.07	
		IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	463,000.00	430,270.99	
		IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	476,000.00	468,370.67	
		IRISH TREASURY-0.2%-30/10/18	282,000.00	241,697.12	
		IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	335,000.00	307,106.22	
		IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	405,000.00	332,299.66	
		IRISH TREASURY-0.35%-32/10/18	205,000.00	168,482.32	
		IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	238,000.00	210,470.06	
		IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	250,000.00	192,183.75	
		IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	365,000.00	314,620.51	
		IRISH TREASURY-0.55%-41/04/22	185,000.00	124,110.02	
		IRISH TREASURY-3.0%-43/10/18	170,000.00	167,516.64	
		IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	521,000.00	435,803.47	
		IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	461,000.00	330,597.39	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	940,000.00	911,533.98	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-26/01/15	455,000.00	435,068.72	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	870,000.00	830,954.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	740,000.00	691,031.98	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	820,000.00	774,503.94	

		NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	655,000.00	719,007.91	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	911,000.00	846,746.25	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	590,000.00	524,694.67	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	595,000.00	529,732.07	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-30/01/15	365,000.00	362,913.29	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-30/07/15	670,000.00	573,797.38	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-31/07/15	710,000.00	592,979.22	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-32/07/15	700,000.00	593,068.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	697,000.00	689,869.69	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/07/15	465,000.00	458,484.88	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-34/07/15	290,000.00	284,501.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	935,000.00	1,053,046.55	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-38/01/15	395,000.00	270,400.01	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	763,000.00	542,765.39	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	902,000.00	1,017,032.06	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-44/01/15	220,000.00	234,129.06	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	919,000.00	916,517.78	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	907,000.00	439,013.39	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-54/01/15	539,000.00	458,138.67	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.7%-71/04/20	180,000.00	81,609.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	173,000.00	105,241.09	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	343,000.00	259,130.66	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.85%-99/99/99	192,000.00	88,258.75	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	680,000.00	663,450.84	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	550,000.00	568,022.95	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.0%-26/07/15	170,000.00	167,016.67	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	773,000.00	736,871.52	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	642,487.53	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	487,000.00	535,686.85	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	660,000.00	613,837.62	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-28/10/20	382,000.00	339,396.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	715,000.00	644,964.32	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-29/05/23	150,000.00	151,084.05	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	680,000.00	581,465.28	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.45%-30/10/20	155,000.00	160,607.43	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-31/02/20	745,000.00	617,127.45	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.9%-32/02/20	610,000.00	527,581.68	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-33/02/20	650,000.00	648,069.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	455,000.00	433,005.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-36/10/20	270,000.00	192,702.78	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	790,000.00	879,033.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-39/07/15	53,000.00	53,456.33	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	255,000.00	154,385.16	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	394,000.00	394,948.75	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	503,000.00	371,490.14	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.85%-49/05/23	288,000.00	225,144.86	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	455,000.00	264,046.05	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-53/10/20	206,000.00	205,684.82	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	245,000.00	281,185.76	
ユーロ小計			331,673,000.00	308,551,630.10 (52,034,146,900)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	760,000.00	355,908.00	
		UK TREASURY-1.125%-73/10/22	513,000.00	191,319.75	
		UK TREASURY-0.625%-25/06/07	813,000.00	782,392.17	
		UK TREASURY-3.5%-25/10/22	1,490,000.00	1,467,013.77	
		UK TREASURY-0.125%-26/01/30	710,000.00	665,666.18	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	820,000.00	775,841.36	
		UK TREASURY-0.375%-26/10/22	1,260,000.00	1,153,272.96	
		UK TREASURY-4.125%-27/01/29	1,495,000.00	1,488,227.65	
		UK TREASURY-3.75%-27/03/07	535,000.00	527,060.06	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	755,000.00	694,394.64	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	850,000.00	855,270.00	
		UK TREASURY-0.125%-28/01/31	745,000.00	648,850.30	
		UK TREASURY-4.5%-28/06/07	1,235,000.00	1,253,055.70	
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	720,000.00	654,936.48	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	710,000.00	769,144.42	
		UK TREASURY-0.5%-29/01/31	1,180,000.00	1,010,291.22	
		UK TREASURY-4.125%-29/07/22	280,000.00	281,176.00	
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	736,000.00	630,325.12	
		UK TREASURY-0.375%-30/10/22	870,000.00	699,855.84	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	945,000.00	989,930.02	
		UK TREASURY-0.25%-31/07/31	1,345,000.00	1,042,618.44	
		UK TREASURY-4.0%-31/10/22	75,000.00	75,124.95	
		UK TREASURY-1.0%-32/01/31	1,645,000.00	1,329,250.47	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,030,000.00	1,053,329.50	
		UK TREASURY-3.25%-33/01/31	1,540,000.00	1,457,657.74	
		UK TREASURY-0.875%-33/07/31	1,340,000.00	1,021,607.96	
		UK TREASURY-4.625%-34/01/31	760,000.00	794,544.26	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	789,000.00	816,753.07	
		UK TREASURY-0.625%-35/07/31	967,000.00	668,912.58	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	970,000.00	979,603.00	
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,280,000.00	963,683.84	
		UK TREASURY-3.75%-38/01/29	650,000.00	615,747.60	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	935,000.00	981,002.00	

		UK TREASURY-1.125%-39/01/31	747,000.00	491,239.89	
		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	850,000.00	841,585.00	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	815,000.00	802,515.83	
		UK TREASURY-1.25%-41/10/22	1,360,000.00	846,032.88	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,040,000.00	1,047,904.00	
		UK TREASURY-4.75%-43/10/22	260,000.00	269,168.90	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,115,000.00	937,944.69	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,160,000.00	1,005,836.00	
		UK TREASURY-0.875%-46/01/31	435,000.00	219,735.46	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	720,000.00	694,129.68	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,005,000.00	575,171.55	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	675,000.00	401,113.35	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	895,000.00	859,161.51	
		UK TREASURY-0.625%-50/10/22	770,000.00	316,123.50	
		UK TREASURY-1.25%-51/07/31	600,000.00	297,660.00	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	872,000.00	767,065.26	
		UK TREASURY-1.5%-53/07/31	580,000.00	300,057.20	
		UK TREASURY-3.75%-53/10/22	970,000.00	848,816.93	
		UK TREASURY-4.375%-54/07/31	170,000.00	165,631.00	
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	925,000.00	490,211.15	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	962,000.00	920,922.60	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	578,651.00	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	751,000.00	689,675.59	
		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	1,050,000.00	322,633.50	
		UK TREASURY-4.0%-63/10/22	370,000.00	338,414.58	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	830,000.00	688,214.42	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	765,000.00	741,327.07	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	742,000.00	477,144.58	
英ポンド小計			53,257,000.00	44,627,854.17 (8,919,769,212)	
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	3,930,000.00	3,800,129.22	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,550,000.00	3,359,059.70	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	3,180,000.00	2,964,736.26	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	2,700,000.00	2,359,068.30	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,800,000.00	1,815,021.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.75%-33/11/11	1,730,000.00	1,677,669.23	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	2,420,000.00	2,806,667.60	
スウェーデンクローナ小計			19,310,000.00	18,782,351.31 (281,171,799)	
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,400,000.00	2,309,318.40	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,400,000.00	2,289,760.80	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,040,000.00	1,933,340.64	

		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	1,930,000.00	1,776,561.14	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	2,685,000.00	2,380,714.32	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.25%-31/09/17	2,040,000.00	1,756,619.52	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.125%-32/05/18	2,030,000.00	1,844,693.48	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-33/08/15	2,350,000.00	2,263,649.25	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.625%-34/04/13	1,100,000.00	1,114,144.90	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.5%-42/10/06	1,050,000.00	1,069,136.25	
ノルウェークローネ小計			20,025,000.00	18,737,938.70 (276,759,354)	
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	3,125,000.00	3,078,218.75	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	2,630,000.00	2,464,517.77	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	2,290,000.00	2,081,016.89	
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-31/11/15	1,350,000.00	1,139,576.85	
		KINGDOM OF DENMARK-2.25%-33/11/15	700,000.00	691,046.30	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	7,205,000.00	8,943,436.81	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	1,550,000.00	850,131.60	
デンマーククローネ小計			18,850,000.00	19,247,944.97 (435,003,556)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,270,000.00	2,231,693.75	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-25/10/25	400,000.00	374,625.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,190,000.00	2,073,656.25	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,600,000.00	1,427,500.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	1,310,000.00	1,254,734.37	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,140,000.00	1,968,800.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,160,000.00	1,964,925.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-7.5%-28/07/25	1,720,000.00	1,844,162.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	2,075,000.00	2,090,384.05	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-29/07/25	500,000.00	480,781.25	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	2,565,000.00	2,237,962.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	2,025,000.00	1,563,679.68	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-32/04/25	1,890,000.00	1,429,312.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.0%-33/10/25	2,145,000.00	2,187,229.68	
ポーランドズロチ小計			24,990,000.00	23,129,446.53 (890,934,715)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	950,000.00	900,131.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	900,000.00	905,393.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,210,000.00	1,123,105.06	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	980,000.00	1,004,569.58	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	830,000.00	801,975.05	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	700,000.00	660,400.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	720,000.00	688,717.44	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	910,000.00	885,986.01	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	890,000.00	841,279.62	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,020,000.00	944,801.52	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	930,000.00	774,138.51	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,083,000.00	920,198.02	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,385,000.00	1,119,530.12	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,350,000.00	1,096,205.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	1,195,000.00	998,018.59	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,130,000.00	1,164,520.37	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-33/11/21	1,010,000.00	923,313.72	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-34/05/21	960,000.00	931,121.28	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.5%-34/12/21	855,000.00	808,645.32	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	700,000.00	613,467.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	550,000.00	524,487.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	582,000.00	513,920.55	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	710,000.00	569,914.87	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	720,000.00	565,475.76	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	870,000.00	494,983.89	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-54/06/21	260,000.00	270,645.70	
豪ドル小計			23,400,000.00	21,044,947.13 (2,192,252,142)	
ニュージーランドドル	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.5%-26/05/15	215,000.00	198,432.31	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-27/04/15	700,000.00	698,285.70	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.25%-28/05/15	370,000.00	314,364.21	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.0%-29/04/20	680,000.00	637,067.52	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-30/05/15	430,000.00	430,663.92	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.5%-31/05/15	350,000.00	288,262.45	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.0%-32/05/15	190,000.00	158,114.58	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.5%-33/04/14	430,000.00	396,939.88	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.25%-34/05/15	220,000.00	213,882.90	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-37/04/15	430,000.00	347,731.54	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.75%-41/05/15	225,000.00	144,275.62	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-51/05/15	500,000.00	340,283.00	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-5.0%-54/05/15	170,000.00	172,022.66	
ニュージーランドドル小計			4,910,000.00	4,340,326.29 (419,535,939)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-72/08/01	240,000.00	235,920.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	480,000.00	474,624.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-25/11/01	314,000.00	301,502.80	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	420,000.00	410,004.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-26/11/01	365,000.00	347,894.27	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	498,000.00	501,187.20	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-27/09/01	150,000.00	148,410.00	

		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	347,000.00	339,817.10	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-28/08/01	60,000.00	59,304.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-29/04/01	33,000.00	32,755.30	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	365,000.00	359,963.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	440,000.00	432,520.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-31/07/01	300,000.00	270,960.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-32/08/01	170,000.00	163,285.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	335,000.00	340,360.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	391,000.00	355,419.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	220,000.00	198,778.80	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	280,000.00	265,580.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	387,000.00	362,787.34	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	367,000.00	288,278.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-51/10/01	222,000.00	171,992.28	
シンガポールドル小計			6,384,000.00	6,061,342.59 (705,964,571)	
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,050,000.00	1,058,242.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	830,000.00	837,677.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	920,000.00	929,706.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,200,000.00	1,213,260.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.519%-28/04/20	350,000.00	348,775.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.504%-29/04/30	350,000.00	363,125.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,320,000.00	1,334,520.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	985,000.00	916,739.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.582%-32/07/15	100,000.00	98,150.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	742,700.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,000,000.00	996,500.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	960,000.00	985,920.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,320,000.00	1,419,660.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	1,080,000.00	1,180,980.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	1,490,000.00	1,434,870.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.696%-42/10/15	750,000.00	804,750.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	660,000.00	727,164.24	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	620,000.00	668,198.18	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	510,000.00	563,805.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	1,410,000.00	1,374,750.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.457%-53/03/31	580,000.00	602,388.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	650,000.00	660,968.75	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	949,097.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,410,000.00	1,415,640.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,150,000.00	1,195,629.70	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,061,653.32	

		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	1,010,000.00	1,008,287.04	
マレーシアリンギット小計			24,390,000.00	24,893,157.23 (830,249,026)	
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-25/08/25	24,000,000.00	24,133,916.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	32,000,000.00	32,582,336.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-25/11/25	20,000,000.00	20,160,910.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.22%-25/12/06	18,800,000.00	19,235,050.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.46%-26/02/15	10,900,000.00	11,025,317.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	17,000,000.00	17,385,959.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.3%-26/05/15	16,000,000.00	16,162,400.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-26/06/06	11,000,000.00	11,340,736.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	16,000,000.00	16,294,200.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-26/08/15	12,000,000.00	12,084,085.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.39%-26/11/15	6,000,000.00	6,072,968.70	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-26/12/05	23,000,000.00	23,740,508.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-27/01/20	10,000,000.00	10,118,240.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.04%-27/02/25	14,000,000.00	14,054,336.10	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	24,000,000.00	24,672,816.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	5,000,000.00	5,081,260.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.44%-27/10/15	5,000,000.00	5,074,721.75	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.28%-27/12/03	19,500,000.00	20,459,643.75	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.64%-28/01/15	10,000,000.00	10,218,322.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-28/04/15	11,000,000.00	11,239,860.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	13,000,000.00	13,516,028.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.4%-28/07/15	9,900,000.00	10,033,702.96	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.48%-28/09/25	3,000,000.00	3,051,318.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	22,000,000.00	22,807,565.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.55%-28/10/15	10,000,000.00	10,205,641.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-28/11/22	10,000,000.00	10,561,990.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-29/01/15	7,500,000.00	7,604,882.62	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-29/03/24	15,000,000.00	15,496,207.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-29/05/23	14,000,000.00	14,886,676.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-29/06/15	3,000,000.00	3,095,046.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-29/09/25	20,200,000.00	20,721,907.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.13%-29/11/21	2,700,000.00	2,850,437.25	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.79%-29/12/15	5,000,000.00	5,171,672.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-30/03/25	15,000,000.00	15,536,250.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	21,000,000.00	21,610,785.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-30/06/25	9,800,000.00	10,048,477.04	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-30/09/15	25,300,000.00	25,906,543.46	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	11,000,000.00	11,790,966.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.54%-30/12/25	6,200,000.00	6,331,245.94	

		CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-31/03/25	13,000,000.00	13,066,912.95	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	10,000,000.00	10,552,510.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.89%-31/11/18	9,000,000.00	9,416,534.85	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	10,000,000.00	10,354,028.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.76%-32/05/15	9,000,000.00	9,323,085.15	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-32/08/15	9,000,000.00	9,280,588.95	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-32/09/01	7,400,000.00	7,582,277.17	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-32/11/15	6,000,000.00	6,242,153.70	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-33/02/25	11,000,000.00	11,527,449.45	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/05/25	12,000,000.00	12,375,678.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.52%-33/08/25	12,800,000.00	13,035,683.84	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/11/25	19,700,000.00	20,320,068.33	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.35%-34/02/25	10,000,000.00	10,053,825.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	18,000,000.00	22,340,376.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	9,000,000.00	11,036,623.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.53%-51/10/18	10,000,000.00	11,920,810.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.32%-52/04/15	10,000,000.00	11,554,950.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-52/10/25	8,000,000.00	8,929,263.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-53/04/15	9,000,000.00	10,225,826.10	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.0%-53/10/15	7,800,000.00	8,597,347.59	
中国元小計			739,500,000.00	770,100,925.75 (16,711,652,149)	
イスラエルシュケル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-1.75%-25/08/31	1,190,000.00	1,154,206.84	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-26/02/27	1,080,000.00	1,011,528.03	
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	950,000.00	987,768.15	
		ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,270,000.00	1,189,154.68	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-27/09/30	320,000.00	312,194.58	
		ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,160,000.00	1,055,859.66	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-29/02/28	750,000.00	721,795.65	
		ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	1,645,000.00	1,340,297.71	
		ISRAEL FIXED BOND-1.3%-32/04/30	1,360,000.00	1,049,042.20	
		ISRAEL FIXED BOND-4.0%-35/03/30	220,000.00	202,600.35	
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	1,150,000.00	765,659.48	
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,160,000.00	1,199,910.46	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,300,000.00	1,028,641.57	
		ISRAEL FIXED BOND-2.8%-52/11/29	640,000.00	399,136.82	
イスラエルシュケル小計			14,195,000.00	12,417,796.18 (525,902,360)	
合計				168,779,266,015 (168,779,266,015)	

(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	216銘柄	100.0%	47.3%
加ドル	国債証券	40銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券	366銘柄	100.0%	30.8%
英ポンド	国債証券	61銘柄	100.0%	5.3%
スウェーデンクローナ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券	10銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券	14銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券	26銘柄	100.0%	1.3%
ニュージーランドドル	国債証券	13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券	21銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	27銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券	59銘柄	100.0%	9.9%
イスラエルシュケル	国債証券	14銘柄	100.0%	0.3%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 6月17日現在
資産の部	
流動資産	
預金	100,764,027
コール・ローン	1,291,740,400
国債証券	23,190,698,274
派生商品評価勘定	9,982,575
未収利息	183,332,556
前払費用	11,451,780
流動資産合計	24,787,969,612
資産合計	24,787,969,612
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	73,984,760
未払金	1,409,313,552
未払解約金	2,030,969
流動負債合計	1,485,329,281
負債合計	1,485,329,281
純資産の部	
元本等	
元本	17,805,941,392
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	5,496,698,939
元本等合計	23,302,640,331
純資産合計	23,302,640,331
負債純資産合計	24,787,969,612

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 6月17日現在
1．	期首	2023年 6月20日
	期首元本額	16,663,259,337円
	期首からの追加設定元本額	2,068,340,359円
	期首からの一部解約元本額	925,658,304円
	元本の内訳　※	
	インデックスファンド海外債券ヘッジあり（ＤＣ専用）	6,583,375,342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）	1,547,954,537円
	Ｔｒａｃｅｒｓ　グローバル３分法（おとなのバランス）	257,390,397円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	2,177,729円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）	4,887,646円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	8,254,358,182円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	130,384,354円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	198,229,162円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	217,738,979円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	172,380,008円
	インデックスファンド海外債券（ヘッジあり）１年決算型	437,065,056円
	計	17,805,941,392円
2．	受益権の総数	17,805,941,392口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2023年 6月20日 至 2024年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

	2024年 6月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引

	2024年 6月17日現在
	「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

（2024年 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	1,017,135,498
合計	1,017,135,498

(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	22,844,338,488	－	22,908,340,673	△64,002,185
	米ドル	10,691,917,324	－	10,709,217,870	△17,300,546
	加ドル	434,658,085	－	435,939,921	△1,281,836
	メキシコペソ	189,393,352	－	181,114,329	8,279,023
	ユーロ	6,980,223,300	－	6,986,280,456	△6,057,156
	英ポンド	1,181,920,159	－	1,185,608,989	△3,688,830
	スウェーデンクローナ	58,730,054	－	58,938,999	△208,945
	ノルウェークローネ	46,333,241	－	46,888,744	△555,503
	デンマーククローネ	76,175,812	－	77,640,930	△1,465,118
	ポーランドズロチ	114,447,082	－	113,223,816	1,223,266
	豪ドル	289,516,898	－	301,490,150	△11,973,252
	ニュージーランドドル	41,126,888	－	41,825,659	△698,771
	シンガポールドル	96,658,099	－	98,180,224	△1,522,125
	マレーシアリンギット	345,425,482	－	346,277,170	△851,688
	中国元	2,247,318,552	－	2,275,269,646	△27,951,094
	イスラエルシュケル	50,494,160	－	50,443,770	50,390
合計		22,844,338,488	－	22,908,340,673	△64,002,185

（注）1.時価の算定方法

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

①同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2024年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	1.3087円
(1万口当たり純資産額)	(13,087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%-25/05/31	600,000.00	587,589.60	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	700,000.00	683,983.30	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	500,000.00	474,443.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	2,000,000.00	1,933,124.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	3,200,000.00	3,085,747.20	
		US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	1,500,000.00	1,406,190.00	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	1,500,000.00	1,451,190.00	
		US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	550,000.00	531,308.25	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	1,600,000.00	1,519,374.40	
		US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	1,000,000.00	930,761.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	2,100,000.00	1,982,857.80	
		US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	900,000.00	842,589.00	
		US TREASURY N/B-1.375%-26/08/31	500,000.00	466,328.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,200,000.00	3,014,124.80	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	500,000.00	466,367.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	1,100,000.00	1,038,596.90	
		US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,000,000.00	915,234.00	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	2,200,000.00	1,968,054.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	1,500,000.00	1,415,331.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	1,100,000.00	1,030,240.20	
		US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	500,000.00	439,169.50	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	1,100,000.00	967,225.60	

		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	530,000.00	559,884.58	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	600,000.00	559,757.40	
		US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	1,990,000.00	1,753,182.04	
		US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	900,000.00	851,290.20	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	1,000,000.00	891,230.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	900,000.00	800,577.90	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	1,600,000.00	1,419,905.60	
		US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	400,000.00	350,546.80	
		US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	1,500,000.00	1,418,554.50	
		US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	500,000.00	439,501.50	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	500,000.00	440,849.50	
		US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	210,000.00	218,408.19	
		US TREASURY N/B-1.375%-28/12/31	650,000.00	573,167.40	
		US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	900,000.00	838,053.90	
		US TREASURY N/B-1.875%-29/02/28	1,000,000.00	899,257.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-29/03/31	500,000.00	459,609.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	1,600,000.00	1,468,593.60	
		US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	850,000.00	750,191.30	
		US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	2,100,000.00	1,814,284.50	
		US TREASURY N/B-4.0%-30/02/28	450,000.00	444,814.20	
		US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	1,700,000.00	1,383,672.50	
		US TREASURY N/B-3.75%-30/05/31	500,000.00	487,587.50	
		US TREASURY N/B-4.125%-30/08/31	500,000.00	497,343.50	
		US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	950,000.00	774,398.20	
		US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	900,000.00	965,425.50	
		US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	600,000.00	508,101.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	900,000.00	737,226.00	
		US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	800,000.00	657,000.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-32/02/15	1,000,000.00	848,671.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-32/05/15	900,000.00	819,808.20	
		US TREASURY N/B-4.125%-32/11/15	750,000.00	745,620.00	
		US TREASURY N/B-3.5%-33/02/15	800,000.00	758,640.00	
		US TREASURY N/B-3.375%-33/05/15	500,000.00	468,964.50	
		US TREASURY N/B-3.875%-33/08/15	900,000.00	876,532.50	
		US TREASURY N/B-4.5%-33/11/15	650,000.00	664,167.40	
		US TREASURY N/B-4.0%-34/02/15	700,000.00	688,351.30	
		US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	390,000.00	403,558.35	
		US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	170,000.00	173,008.15	
		US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	390,000.00	358,609.29	
		US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	100,000.00	101,064.40	
		US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	230,000.00	231,922.57	
		US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	350,000.00	331,741.20	
		US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	200,000.00	200,480.40	

		US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	200,000.00	184,835.80	
		US TREASURY N/B-3.125%-41/11/15	350,000.00	295,367.10	
		US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	300,000.00	235,581.90	
		US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	100,000.00	82,921.80	
		US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	250,000.00	198,896.25	
		US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	140,000.00	124,539.80	
		US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	200,000.00	180,929.60	
		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	450,000.00	399,216.60	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	120,000.00	102,360.84	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	450,000.00	360,026.10	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	350,000.00	256,197.20	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	450,000.00	358,821.90	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	700,000.00	545,261.50	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	200,000.00	158,960.80	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	850,000.00	615,983.95	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	150,000.00	108,363.15	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	950,000.00	652,270.95	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	300,000.00	231,714.60	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	750,000.00	562,998.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	550,000.00	412,112.80	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	650,000.00	508,599.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	1,000,000.00	668,828.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	350,000.00	220,158.05	
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	1,550,000.00	798,370.90	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	1,800,000.00	956,107.80	
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	400,000.00	227,132.80	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	1,000,000.00	605,507.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	400,000.00	272,718.40	
		US TREASURY N/B-2.875%-52/05/15	1,270,000.00	964,281.79	
		US TREASURY N/B-3.625%-53/02/15	300,000.00	263,882.70	
		US TREASURY N/B-4.125%-53/08/15	200,000.00	192,500.00	
		US TREASURY N/B-4.25%-54/02/15	250,000.00	246,054.50	
米ドル小計			79,390,000.00	69,774,882.70 (10,991,637,271)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	290,000.00	284,632.68	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-25/10/01	500,000.00	493,235.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	400,000.00	376,576.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	250,000.00	235,315.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-28/03/01	300,000.00	301,149.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	280,000.00	312,096.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	400,000.00	382,750.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	100,000.00	89,253.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	230,000.00	205,106.41	

		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-32/12/01	200,000.00	188,882.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	210,000.00	247,428.93	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	200,000.00	206,940.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	550,000.00	426,385.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	100,000.00	90,725.40	
加ドル小計			4,010,000.00	3,840,477.72 (440,464,389)	
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	4,000,000.00	3,681,250.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	3,000,000.00	2,649,375.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	2,000,000.00	1,846,250.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	4,000,000.00	3,738,750.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	2,500,000.00	2,204,687.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	4,500,000.00	3,943,125.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	3,000,000.00	2,398,125.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	980,000.00	791,350.00	
メキシコペソ小計			23,980,000.00	21,252,912.50 (180,881,412)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	60,000.00	25,150.20	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	150,000.00	153,756.00	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	100,000.00	94,119.50	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	130,000.00	142,358.58	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	200,000.00	185,129.80	
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	250,000.00	213,008.00	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	400,000.00	353,192.40	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	170,000.00	182,857.44	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	260,000.00	304,868.98	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	150,000.00	167,446.20	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	120,000.00	126,073.56	
		BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	200,000.00	140,508.80	
		BELGIUM KINGDOM-1.4%-53/06/22	50,000.00	31,346.75	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	50,000.00	38,266.65	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	110,000.00	81,314.97	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-71/10/31	100,000.00	49,106.70	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	200,000.00	202,874.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-26/04/30	350,000.00	342,956.25	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	400,000.00	422,933.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%-26/10/31	200,000.00	192,316.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%-27/04/30	350,000.00	336,017.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/04/30	300,000.00	283,418.10	

		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/07/30	100,000.00	94,164.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-28/10/31	550,000.00	599,399.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	430,000.00	486,643.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%-29/10/31	150,000.00	132,707.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-30/07/30	150,000.00	141,571.95	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%-30/10/31	300,000.00	270,107.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%-31/04/30	150,000.00	123,272.55	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.7%-32/04/30	200,000.00	167,005.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	200,000.00	237,493.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-33/04/30	200,000.00	199,340.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%-33/07/30	300,000.00	280,092.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.55%-33/10/31	200,000.00	204,933.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	430,000.00	463,125.48	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	300,000.00	340,179.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	150,000.00	180,434.55	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	300,000.00	262,302.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	250,000.00	208,006.25	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.9%-52/10/31	80,000.00	53,768.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	100,000.00	90,943.80	
		BUNDESOBLIGATION-2.4%-28/10/19	150,000.00	150,019.65	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15	400,000.00	390,578.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	750,000.00	722,076.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	400,000.00	376,762.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15	600,000.00	564,609.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	260,000.00	287,770.34	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-28/02/15	500,000.00	467,033.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	200,000.00	217,944.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-29/02/15	200,000.00	181,913.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.1%-29/11/15	150,000.00	148,172.55	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	430,000.00	516,131.15	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.4%-	100,000.00	100,426.00	

		30/11/15			
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	420,000.00	499,326.66	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.7%-32/08/15	550,000.00	525,946.85	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.3%-33/02/15	100,000.00	99,885.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.6%-33/08/15	350,000.00	357,647.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	300,000.00	363,300.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	260,000.00	302,818.36	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	150,000.00	182,211.45	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	270,000.00	348,641.01	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	200,000.00	220,151.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-44/07/04	150,000.00	148,875.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-46/08/15	330,000.00	328,038.15	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	200,000.00	105,248.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-52/08/15	200,000.00	100,596.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%-53/08/15	250,000.00	213,638.75	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%-53/08/15	100,000.00	85,628.90	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-54/08/15	100,000.00	99,762.50	
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.8%-25/06/12	100,000.00	99,631.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-25/06/01	400,000.00	392,514.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-25/11/15	300,000.00	296,279.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-26/03/01	550,000.00	559,768.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	550,000.00	598,565.55	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%-26/12/01	300,000.00	285,525.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.1%-27/04/01	300,000.00	282,363.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%-27/08/01	150,000.00	144,375.15	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	250,000.00	275,194.25	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-28/02/01	150,000.00	143,252.10	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%-28/03/15	150,000.00	133,847.25	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%-28/08/01	380,000.00	386,096.72	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-28/09/01	550,000.00	579,415.65	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	450,000.00	490,325.85	

		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-30/03/01	350,000.00	350,888.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-30/08/01	150,000.00	128,929.95	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%-31/04/01	350,000.00	294,341.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	350,000.00	402,103.45	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-32/03/01	300,000.00	260,690.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-32/06/01	100,000.00	81,564.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	250,000.00	286,411.25	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.4%-33/05/01	350,000.00	367,080.35	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.35%-33/11/01	200,000.00	208,497.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	250,000.00	273,828.75	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-35/04/30	200,000.00	202,026.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	260,000.00	261,066.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	300,000.00	327,754.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	300,000.00	327,661.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01	150,000.00	159,768.75	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-46/09/01	450,000.00	386,376.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%-48/03/01	400,000.00	351,990.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-52/09/01	140,000.00	92,272.18	
		BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	250,000.00	181,806.25	
		FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	150,000.00	151,230.45	
		FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	200,000.00	199,864.40	
		FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	100,000.00	87,236.40	
		FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	150,000.00	126,742.20	
		FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	100,000.00	92,918.30	
		FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	100,000.00	72,142.60	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	270,000.00	100,340.64	
		FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	450,000.00	466,067.70	
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	450,000.00	436,258.35	
		FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	400,000.00	403,008.80	
		FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	250,000.00	238,215.00	
		FRANCE (GOVT OF)-2.5%-26/09/24	300,000.00	296,536.80	
		FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	600,000.00	567,207.00	
		FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	500,000.00	496,459.50	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/02/25	150,000.00	138,640.95	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	250,000.00	229,947.00	

FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	400,000.00	364,287.20	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-29/02/25	150,000.00	148,744.50	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	490,000.00	544,918.22	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	200,000.00	178,029.40	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	750,000.00	732,936.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-30/11/25	100,000.00	82,996.10	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	550,000.00	500,541.25	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	850,000.00	1,015,820.55	
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-32/11/25	200,000.00	184,647.80	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	300,000.00	252,470.10	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	180,000.00	205,676.64	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	300,000.00	241,699.50	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	460,000.00	494,707.00	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	150,000.00	122,332.65	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-40/05/25	270,000.00	175,362.57	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	250,000.00	284,883.75	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	370,000.00	358,782.34	
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	200,000.00	152,237.60	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-52/05/25	300,000.00	155,490.90	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	320,000.00	347,007.36	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	350,000.00	383,818.05	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	300,000.00	295,191.60	
IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	300,000.00	246,147.90	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	100,000.00	86,197.40	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	100,000.00	83,647.50	
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	50,000.00	35,856.55	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	150,000.00	145,457.55	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	250,000.00	238,780.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	270,000.00	296,384.94	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	200,000.00	177,862.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-32/07/15	150,000.00	127,086.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	230,000.00	227,647.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	300,000.00	337,875.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	200,000.00	142,271.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	50,000.00	56,376.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	200,000.00	199,459.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-54/01/15	100,000.00	84,997.90	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	130,000.00	98,212.79	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	150,000.00	146,349.45	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	100,000.00	103,276.90	
REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	200,000.00	219,994.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	370,000.00	333,757.76	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	200,000.00	190,332.00	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	200,000.00	222,540.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	100,000.00	100,240.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	50,000.00	29,016.05	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	80,000.00	91,815.76	
ユーロ小計			42,680,000.00	41,668,861.35 (7,027,036,778)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.5%-26/07/22	350,000.00	331,151.80	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	250,000.00	229,932.00	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	150,000.00	150,930.00	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	120,000.00	129,996.24	
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	350,000.00	299,747.00	
		UK TREASURY-0.375%-30/10/22	200,000.00	160,886.40	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	200,000.00	209,509.00	
		UK TREASURY-1.0%-32/01/31	100,000.00	80,805.50	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	280,000.00	286,342.00	
		UK TREASURY-3.25%-33/01/31	200,000.00	189,306.20	
		UK TREASURY-0.875%-33/07/31	280,000.00	213,470.32	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	300,000.00	310,552.50	
		UK TREASURY-0.625%-35/07/31	220,000.00	152,182.80	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	100,000.00	100,990.00	
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	250,000.00	188,219.50	
		UK TREASURY-3.75%-38/01/29	200,000.00	189,460.80	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	170,000.00	178,364.00	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	100,000.00	98,468.20	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	120,000.00	120,912.00	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	350,000.00	294,422.10	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	50,000.00	43,355.00	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	350,000.00	337,424.15	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	100,000.00	57,231.00	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	100,000.00	59,424.20	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	560,000.00	536,088.00	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	400,000.00	367,337.20	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	300,000.00	248,752.20	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	550,000.00	532,980.25	
英ポンド小計			6,700,000.00	6,098,240.36 (1,218,855,300)	
スウェーデンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	1,500,000.00	1,450,431.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,750,000.00	1,764,603.75	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	700,000.00	811,846.00	
スウェーデンクローナ小計			3,950,000.00	4,026,880.75 (60,282,404)	
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	1,000,000.00	962,216.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	1,300,000.00	1,232,030.80	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-33/08/15	1,000,000.00	963,255.00	

ノルウェークローネ小計			3,300,000.00	3,157,501.80 (46,636,301)	
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	500,000.00	492,515.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	2,300,000.00	2,854,948.60	
デンマーククローネ小計			2,800,000.00	3,347,463.60 (75,652,677)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,200,000.00	1,070,625.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	500,000.00	478,906.25	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	1,000,000.00	872,500.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.0%-33/10/25	500,000.00	509,843.75	
ポーランドズロチ小計			3,200,000.00	2,931,875.00 (112,934,359)	
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	150,000.00	142,126.05	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	380,000.00	382,277.34	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	150,000.00	153,760.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	200,000.00	193,247.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	350,000.00	340,763.85	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	300,000.00	277,882.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	300,000.00	249,722.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	150,000.00	127,451.25	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	250,000.00	208,790.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-33/11/21	200,000.00	182,834.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	300,000.00	286,084.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	370,000.00	290,591.71	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-54/06/21	100,000.00	104,094.50	
豪ドル小計			3,200,000.00	2,939,626.35 (306,220,876)	
ニュージーランドドル	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.0%-29/04/20	150,000.00	140,529.60	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.5%-33/04/14	190,000.00	175,392.04	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-37/04/15	150,000.00	121,301.70	
ニュージーランドドル小計			490,000.00	437,223.34 (42,262,008)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	400,000.00	402,560.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	100,000.00	101,600.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	150,000.00	142,275.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	190,000.00	178,112.65	
シンガポールドル小計			840,000.00	824,547.65 (96,035,064)	
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,000,000.00	1,007,850.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	1,000,000.00	1,010,550.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,400,000.00	1,415,470.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,000,000.00	1,011,000.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,000,000.00	996,500.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	500,000.00	550,882.00	

		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	2,250,000.00	2,287,968.75	
マレーシアリンギット小計			8,150,000.00	8,280,220.75 (276,166,062)	
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-2.0%-25/06/15	1,000,000.00	1,003,157.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-25/08/25	1,000,000.00	1,005,579.85	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.22%-25/09/25	4,000,000.00	4,026,652.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	2,000,000.00	2,036,396.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-25/11/25	3,000,000.00	3,024,136.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.33%-25/12/15	2,000,000.00	2,019,070.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.46%-26/02/15	3,000,000.00	3,034,491.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	1,000,000.00	1,022,703.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.3%-26/05/15	3,000,000.00	3,030,450.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	1,000,000.00	1,018,387.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-26/08/15	3,000,000.00	3,021,021.45	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.39%-26/11/15	2,000,000.00	2,024,322.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-27/01/20	2,000,000.00	2,023,648.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.04%-27/02/25	1,000,000.00	1,003,881.15	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.48%-27/04/15	3,000,000.00	3,049,533.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.85%-27/05/15	2,000,000.00	1,997,923.70	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	3,000,000.00	3,048,756.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.64%-28/01/15	2,000,000.00	2,043,664.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-28/04/15	3,000,000.00	3,065,416.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	4,000,000.00	4,158,778.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.48%-28/09/25	3,000,000.00	3,051,318.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	1,000,000.00	1,036,707.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-29/01/15	1,000,000.00	1,013,984.35	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-29/03/24	4,000,000.00	4,132,322.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-29/06/15	3,000,000.00	3,095,046.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.79%-29/12/15	4,000,000.00	4,137,338.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-30/03/25	2,000,000.00	2,071,500.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-30/06/25	1,000,000.00	1,025,354.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-30/09/15	3,000,000.00	3,071,922.15	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.54%-30/12/25	3,000,000.00	3,063,506.10	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-31/03/25	1,000,000.00	1,005,147.15	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	2,000,000.00	2,110,502.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.89%-31/11/18	1,000,000.00	1,046,281.65	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	3,000,000.00	3,106,208.55	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-32/09/01	1,000,000.00	1,024,632.05	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-33/02/25	3,000,000.00	3,143,849.85	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/05/25	3,000,000.00	3,093,919.65	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.52%-33/08/25	1,000,000.00	1,018,412.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/11/25	2,000,000.00	2,062,951.10	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.35%-34/02/25	2,000,000.00	2,010,765.10	

		CHINA GOVERNMENT BOND-2.49%-44/05/25	2,000,000.00	2,018,432.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	1,000,000.00	1,241,132.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	1,000,000.00	1,226,291.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.32%-52/04/15	4,000,000.00	4,621,980.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-52/10/25	1,000,000.00	1,116,157.95	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-53/04/15	1,000,000.00	1,136,202.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.0%-53/10/15	1,000,000.00	1,102,224.05	
中国元小計			101,000,000.00	104,442,058.85 (2,266,455,342)	
イスラエルシュケル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	500,000.00	519,877.97	
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	620,000.00	641,331.45	
イスラエルシュケル小計			1,120,000.00	1,161,209.42 (49,178,031)	
合計				23,190,698,274 (23,190,698,274)	

(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	97銘柄	100.0%	47.3%
加ドル	国債証券	14銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券	165銘柄	100.0%	30.3%
英ポンド	国債証券	28銘柄	100.0%	5.3%
スウェーデンクローナ	国債証券	3銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券	3銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券	4銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券	13銘柄	100.0%	1.3%
ニュージーランドドル	国債証券	3銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券	4銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	7銘柄	100.0%	1.2%
中国元	国債証券	47銘柄	100.0%	9.8%
イスラエルシュケル	国債証券	2銘柄	100.0%	0.2%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

海外新興国債券インデックスＬｏｃａｌ（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

資産の部	
流動資産	

	2024年 6月17日現在
預金	46,161,769
コール・ローン	79,444,741
国債証券	13,427,654,288
派生商品評価勘定	102,280
未収利息	238,387,565
前払費用	19,853,843
流動資産合計	13,811,604,486
資産合計	13,811,604,486
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	7,742,903,961
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	6,068,700,525
元本等合計	13,811,604,486
純資産合計	13,811,604,486
負債純資産合計	13,811,604,486

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 6月17日現在
1．	期首	2023年 6月20日
	期首元本額	6,603,340,024円
	期首からの追加設定元本額	1,381,066,604円
	期首からの一部解約元本額	241,502,667円
	元本の内訳　※	
	インデックスファンド海外新興国（エマージング）債券（１年決算型）	7,739,897,806円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	1,581,593円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）	1,424,562円
	計	7,742,903,961円
2．	受益権の総数	7,742,903,961口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

	自 2023年 6月20日 至 2024年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

（2024年 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	△48,140,428
合計	△48,140,428

(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				
	買建	62,900,000	－	63,002,280	102,280
	米ドル	62,900,000	－	63,002,280	102,280
合計		62,900,000	－	63,002,280	102,280

（注）1.時価の算定方法

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

①同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2024年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	1.7838円
(1万口当たり純資産額)	(17,838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
メキシコペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-25/03/06	5,900,000.00	5,671,375.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	16,900,000.00	15,553,281.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.0%-26/09/03	9,000,000.00	8,325,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	16,200,000.00	14,306,625.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	13,130,000.00	12,120,631.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/03/01	6,900,000.00	6,449,343.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	11,760,000.00	10,991,925.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	15,550,000.00	13,713,156.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-33/05/26	13,000,000.00	11,029,687.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	6,700,000.00	5,684,531.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-35/05/24	1,000,000.00	862,835.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	3,330,000.00	3,305,025.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	8,190,000.00	7,176,487.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	14,560,000.00	11,638,900.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	10,380,000.00	8,381,850.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-53/07/31	10,400,000.00	8,303,750.00	
メキシコペソ小計			162,900,000.00	143,514,403.75 (1,221,436,738)	
ブラジルレアル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-25/07/01	5,400,000.00	4,851,393.74	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-26/01/01	7,650,000.00	6,486,004.67	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-26/07/01	8,600,000.00	6,896,662.48	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-27/07/01	4,550,000.00	3,251,828.12	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-28/01/01	1,650,000.00	1,109,521.87	
		LETRA TESOURO NACIONAL-0.0%-30/01/01	1,000,000.00	531,062.50	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-25/01/01	5,040,000.00	5,020,785.00	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-27/01/01	5,570,000.00	5,396,633.75	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-29/01/01	6,490,000.00	6,096,949.37	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-31/01/01	2,950,000.00	2,696,760.93	

		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-33/01/01	2,800,000.00	2,517,462.50	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL-10.0%-35/01/01	550,000.00	488,726.56	
ブラジルレアル小計			52,250,000.00	45,343,791.49 (1,327,752,368)	
チリペソ	国債証券	BONOS TESORERIA PESOS-2.5%-25/03/01	215,000,000.00	212,178,125.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-4.5%-26/03/01	285,000,000.00	285,000,000.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-5.0%-28/10/01	65,000,000.00	63,842,187.50	
		BONOS TESORERIA PESOS-2.3%-28/10/01	100,000,000.00	88,187,500.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-4.7%-30/09/01	180,000,000.00	170,493,750.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-6.0%-33/04/01	175,000,000.00	176,203,125.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-7.0%-34/05/01	75,000,000.00	81,093,750.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-5.0%-35/03/01	320,000,000.00	297,900,000.00	
		BONOS TESORERIA PESOS-6.0%-43/01/01	145,000,000.00	146,359,375.00	
チリペソ小計			1,560,000,000.00	1,521,257,812.50 (256,269,569)	
コロンビアペソ	国債証券	TITULOS DE TESORERIA-5.75%-27/11/03	1,300,000,000.00	1,144,000,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA-7.0%-31/03/26	1,410,000,000.00	1,172,062,500.00	
		TITULOS DE TESORERIA-13.25%-33/02/09	1,300,000,000.00	1,468,187,500.00	
		TITULOS DE TESORERIA-6.25%-36/07/09	1,050,000,000.00	716,953,125.00	
		TITULOS DE TESORERIA-9.25%-42/05/28	2,430,000,000.00	1,989,562,500.00	
		TITULOS DE TESORERIA-7.25%-50/10/26	1,450,000,000.00	928,906,250.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-6.25%-25/11/26	1,350,000,000.00	1,301,062,500.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.5%-26/08/26	1,720,000,000.00	1,647,975,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-6.0%-28/04/28	1,580,000,000.00	1,379,537,500.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.75%-30/09/18	1,335,000,000.00	1,178,554,687.50	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.0%-32/06/30	1,320,000,000.00	1,062,600,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA B-7.25%-34/10/18	1,820,000,000.00	1,413,343,750.00	
コロンビアペソ小計			18,065,000,000.00	15,402,745,312.50 (586,151,472)	
ペルーヌエボソル	国債証券	BONOS DE TESORERIA-6.35%-28/08/12	810,000.00	831,515.62	
		BONOS DE TESORERIA-5.94%-29/02/12	1,200,000.00	1,204,500.00	
		BONOS DE TESORERIA-6.15%-32/08/12	1,050,000.00	1,011,609.37	
		BONOS DE TESORERIA-7.3%-33/08/12	400,000.00	410,750.00	
		BONOS DE TESORERIA-5.4%-34/08/12	800,000.00	708,000.00	
		BONOS DE TESORERIA-5.35%-40/08/12	950,000.00	779,000.00	
		PERU BONO SOBERANO-8.2%-26/08/12	640,000.00	675,800.00	
		PERU BONO SOBERANO-6.95%-31/08/12	840,000.00	859,687.50	
		PERU BONO SOBERANO-6.9%-37/08/12	1,200,000.00	1,164,374.99	
ペルーヌエボソル小計			7,890,000.00	7,645,237.48 (318,068,637)	
ウルグアイペソ	国債証券	REPUBLICA ORIENT URUGUAY-8.5%-28/03/15	1,300,000.00	1,271,562.50	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY-8.25%-31/05/21	4,500,000.00	4,273,593.75	

ウルグアイペソ小計			5,800,000.00	5,545,156.25 (22,242,730)	
ドミニカペソ	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC-13.625%-33/02/03	8,000,000.00	9,517,500.00	
ドミニカペソ小計			8,000,000.00	9,517,500.00 (25,327,019)	
セルビアディナール	国債証券	SERBIA TREASURY BONDS-4.5%-26/01/11	7,800,000.00	7,751,250.00	
		SERBIA TREASURY BONDS-5.875%-28/02/08	9,300,000.00	9,561,562.50	
		SERBIA TREASURY BONDS-7.0%-31/10/26	8,000,000.00	8,557,500.00	
		SERBIA TREASURY BONDS-4.5%-32/08/20	10,500,000.00	9,597,656.25	
セルビアディナール小計			35,600,000.00	35,467,968.75 (51,038,477)	
トルコリラ	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND-8.0%-25/03/12	820,000.00	660,356.25	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-12.6%-25/10/01	6,300,000.00	4,681,687.50	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.6%-26/02/11	2,160,000.00	1,509,975.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-16.9%-26/09/02	3,000,000.00	2,237,812.50	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-11.0%-27/02/24	810,000.00	521,184.37	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-10.5%-27/08/11	3,640,000.00	2,281,825.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-12.4%-28/03/08	4,650,000.00	2,955,656.25	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-17.3%-28/07/19	7,500,000.00	5,489,062.50	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-11.7%-30/11/13	1,950,000.00	1,131,000.00	
		TURKEY GOVERNMENT BOND-17.8%-33/07/13	3,700,000.00	2,657,062.50	
		TURKIYE GOVERNMENT BOND-31.08%-28/11/08	7,000,000.00	7,080,937.50	
		TURKIYE GOVERNMENT BOND-26.2%-33/10/05	9,800,000.00	9,588,687.50	
トルコリラ小計			51,330,000.00	40,795,246.87 (197,277,654)	
チェココルナ	国債証券	CZECH REPUBLIC-1.25%-25/02/14	6,200,000.00	6,070,187.50	
		CZECH REPUBLIC-2.4%-25/09/17	8,100,000.00	7,910,156.25	
		CZECH REPUBLIC-6.0%-26/02/26	5,900,000.00	6,073,312.50	
		CZECH REPUBLIC-1.0%-26/06/26	8,100,000.00	7,593,750.00	
		CZECH REPUBLIC-0.25%-27/02/10	8,300,000.00	7,485,562.50	
		CZECH REPUBLIC-2.5%-28/08/25	8,970,000.00	8,400,965.62	
		CZECH REPUBLIC-5.5%-28/12/12	5,500,000.00	5,802,500.00	
		CZECH REPUBLIC-5.75%-29/03/29	4,000,000.00	4,272,500.00	
		CZECH REPUBLIC-2.75%-29/07/23	7,900,000.00	7,393,906.25	
		CZECH REPUBLIC-0.05%-29/11/29	4,800,000.00	3,855,000.00	
		CZECH REPUBLIC-0.95%-30/05/15	8,650,000.00	7,217,343.75	
		CZECH REPUBLIC-5.0%-30/09/30	8,100,000.00	8,469,562.50	
		CZECH REPUBLIC-1.2%-31/03/13	8,300,000.00	6,876,031.25	
		CZECH REPUBLIC-6.2%-31/06/16	2,300,000.00	2,579,593.75	
		CZECH REPUBLIC-1.75%-32/06/23	8,200,000.00	6,859,812.50	
		CZECH REPUBLIC-4.5%-32/11/11	4,100,000.00	4,174,312.50	
		CZECH REPUBLIC-2.0%-33/10/13	8,200,000.00	6,821,375.00	
		CZECH REPUBLIC-4.9%-34/04/14	3,600,000.00	3,780,000.00	

		CZECH REPUBLIC-3.5%-35/05/30	4,500,000.00	4,199,062.50	
		CZECH REPUBLIC-4.2%-36/12/04	5,300,000.00	5,270,187.50	
		CZECH REPUBLIC-1.95%-37/07/30	2,500,000.00	1,917,187.50	
		CZECH REPUBLIC-1.5%-40/04/24	4,000,000.00	2,722,500.00	
チェココルナ小計			135,520,000.00	125,744,809.37 (857,126,918)	
ハンガリーフォリント	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND-5.5%-25/06/24	64,800,000.00	64,071,000.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-1.0%-25/11/26	85,000,000.00	78,545,312.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-1.5%-26/04/22	70,000,000.00	63,896,875.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-1.5%-26/08/26	47,000,000.00	42,197,187.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-9.5%-26/10/21	46,000,000.00	48,645,000.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.75%-26/12/22	51,000,000.00	46,457,812.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-27/10/27	72,000,000.00	64,147,500.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-4.5%-28/03/23	32,000,000.00	29,680,000.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-6.75%-28/10/22	105,300,000.00	105,135,468.75	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.0%-29/05/23	54,000,000.00	43,402,500.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-30/08/21	71,000,000.00	57,487,812.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.25%-31/10/22	87,000,000.00	69,137,812.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-4.75%-32/11/24	77,000,000.00	66,556,875.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.25%-33/04/20	78,000,000.00	54,526,875.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-2.25%-34/06/22	30,000,000.00	20,128,125.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-7.0%-35/10/24	28,000,000.00	28,113,750.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-38/10/27	57,500,000.00	37,195,312.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND-3.0%-41/04/25	34,000,000.00	20,814,375.00	
ハンガリーフォリント小計			1,089,600,000.00	940,139,593.75 (398,070,146)	
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	1,550,000.00	1,499,625.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,300,000.00	2,261,187.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-25/10/25	1,490,000.00	1,395,478.12	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,610,000.00	2,471,343.75	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,900,000.00	1,695,156.25	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	1,830,000.00	1,752,796.87	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	1,770,000.00	1,628,400.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,140,000.00	1,946,731.25	
		POLAND GOVERNMENT BOND-7.5%-28/07/25	2,600,000.00	2,787,687.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-29/07/25	600,000.00	576,937.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	2,890,000.00	2,521,525.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	2,570,000.00	1,984,521.86	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-32/04/25	2,380,000.00	1,799,875.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.0%-33/10/25	2,880,000.00	2,936,699.99	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-34/10/25	350,000.00	329,109.37	

ポーランドズロチ小計			29,860,000.00	27,587,074.96 (1,062,640,333)	
ロシアルーブル	国債証券	※RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-24/07/25	7,400,000.00	—	
		※RUSSIA GOVT BOND - OFZ-0.0%-24/07/16	12,400,000.00	—	
ロシアルーブル小計			19,800,000.00	— (—)	
ルーマニアレイ	国債証券	ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%-25/02/24	730,000.00	723,612.50	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.65%-25/07/28	610,000.00	595,131.25	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.5%-25/11/25	650,000.00	628,468.75	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.85%-26/04/22	750,000.00	735,000.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.25%-26/06/24	800,000.00	759,000.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-7.2%-26/10/28	600,000.00	612,750.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-7.2%-27/05/31	490,000.00	502,862.50	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.8%-27/07/26	870,000.00	860,212.50	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-2.5%-27/10/25	650,000.00	579,109.37	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.15%-28/01/26	650,000.00	607,953.12	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-8.75%-28/10/30	900,000.00	974,531.25	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-5.0%-29/02/12	960,000.00	903,900.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.85%-29/07/25	820,000.00	759,012.50	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-8.0%-30/04/29	680,000.00	723,137.50	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.15%-30/10/24	690,000.00	603,534.37	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-7.35%-31/04/28	730,000.00	754,409.37	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-3.65%-31/09/24	720,000.00	594,900.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-6.7%-32/02/25	800,000.00	796,000.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-8.25%-32/09/29	850,000.00	927,031.25	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-7.2%-33/10/30	600,000.00	616,875.00	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.75%-34/10/11	740,000.00	627,612.50	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-4.25%-36/04/28	630,000.00	498,487.50	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND-7.9%-38/02/24	630,000.00	684,337.50	
ルーマニアレイ小計			16,550,000.00	16,067,868.73 (544,491,867)	
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	900,000.00	903,915.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	2,420,000.00	2,438,997.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	1,900,000.00	1,917,575.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	1,870,000.00	1,889,728.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,840,000.00	1,860,332.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.519%-28/04/20	570,000.00	568,005.00	

		MALAYSIA GOVERNMENT-4.504%-29/04/30	600,000.00	622,500.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,540,000.00	1,556,940.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	1,860,000.00	1,731,102.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.582%-32/07/15	1,800,000.00	1,766,700.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	1,270,000.00	1,347,470.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,220,000.00	1,215,730.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	850,000.00	872,950.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	2,415,000.00	2,597,332.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	1,050,000.00	1,148,175.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	3,330,000.00	3,206,790.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.696%-42/10/15	1,500,000.00	1,609,500.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	1,130,000.00	1,249,215.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	1,470,000.00	1,433,250.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.457%-53/03/31	700,000.00	727,020.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.128%-25/08/15	700,000.00	706,370.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.726%-26/03/31	850,000.00	853,867.50	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.258%-27/07/26	430,000.00	438,879.50	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.422%-27/09/30	570,000.00	567,805.50	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.369%-28/10/31	730,000.00	750,440.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.13%-29/07/09	570,000.00	582,454.50	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.465%-30/10/15	1,720,000.00	1,692,480.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-3.447%-36/07/15	480,000.00	457,200.00	
		MALAYSIA INVESTMNT ISSUE-4.291%-43/08/14	750,000.00	767,062.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	1,300,000.00	1,298,765.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	2,750,000.00	2,761,000.00	
マレーシアリンギット小計			41,085,000.00	41,539,551.50 (1,385,447,891)	
タイバーツ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND-0.95%-25/06/17	13,300,000.00	13,109,810.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.85%-25/12/12	11,370,000.00	11,608,770.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.35%-26/06/17	12,500,000.00	12,501,250.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.125%-26/12/17	13,800,000.00	13,711,680.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.25%-27/03/17	13,400,000.00	13,346,400.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.0%-27/06/17	17,600,000.00	16,904,800.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.65%-28/06/17	15,700,000.00	15,836,590.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.875%-28/12/17	11,700,000.00	11,897,730.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.4%-29/03/17	10,000,000.00	9,954,000.00	

		THAILAND GOVERNMENT BOND-4.875%-29/06/22	13,180,000.00	14,635,072.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.6%-29/12/17	11,700,000.00	11,139,570.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.65%-31/06/20	10,500,000.00	11,188,800.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.0%-31/12/17	19,000,000.00	18,186,800.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.775%-32/06/25	14,000,000.00	15,064,000.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.35%-33/06/17	14,600,000.00	15,297,880.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.8%-34/06/17	6,100,000.00	6,120,740.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.6%-35/06/17	6,500,000.00	5,755,750.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-1.585%-35/12/17	11,200,000.00	9,817,920.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.4%-36/06/17	10,950,000.00	11,446,035.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.39%-37/06/17	13,900,000.00	14,542,180.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.3%-38/06/17	14,100,000.00	14,606,190.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.0%-42/06/17	8,400,000.00	7,104,720.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-3.45%-43/06/17	11,600,000.00	11,887,680.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND-2.875%-46/06/17	9,800,000.00	8,969,940.00	
タイバーツ小計			294,900,000.00	294,634,307.00 (1,263,981,177)	
インドネシアルピア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT-6.5%-25/06/15	5,500,000,000.00	5,493,552,900.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-11.0%-25/09/15	1,060,000,000.00	1,113,530,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.5%-26/04/15	6,200,000,000.00	6,076,000,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-26/09/15	5,690,000,000.00	5,869,235,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-5.125%-27/04/15	5,700,000,000.00	5,443,534,200.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-27/05/15	4,500,000,000.00	4,533,976,800.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.125%-28/05/15	4,300,000,000.00	4,188,200,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.375%-28/08/15	4,700,000,000.00	4,618,504,820.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.0%-29/03/15	2,850,000,000.00	3,082,275,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.875%-29/04/15	2,000,000,000.00	1,984,244,200.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-29/05/15	6,100,000,000.00	6,382,157,940.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-10.5%-30/08/15	1,710,000,000.00	2,015,235,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-30/09/15	6,300,000,000.00	6,286,861,350.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.5%-31/02/15	7,500,000,000.00	7,271,250,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.75%-31/05/15	3,000,000,000.00	3,265,589,400.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-9.5%-31/07/15	1,120,000,000.00	1,277,560,480.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.375%-32/04/15	7,900,000,000.00	7,600,533,910.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-32/06/15	2,400,000,000.00	2,564,400,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-32/08/15	2,100,000,000.00	2,147,250,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.0%-33/02/15	5,200,000,000.00	5,195,430,760.00	

		INDONESIA GOVERNMENT-6.625%-33/05/15	4,330,000,000.00	4,228,245,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.625%-34/02/15	2,000,000,000.00	1,932,227,600.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-34/03/15	10,100,000,000.00	10,953,593,420.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-35/06/15	5,450,000,000.00	5,640,477,500.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.25%-36/05/15	4,160,000,000.00	4,541,390,464.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-6.25%-36/06/15	2,800,000,000.00	2,667,000,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-38/05/15	3,100,000,000.00	3,219,350,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.125%-38/06/15	2,600,000,000.00	2,598,052,080.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-8.375%-39/04/15	1,950,000,000.00	2,164,500,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.5%-40/04/15	5,400,000,000.00	5,575,500,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.125%-42/06/15	4,800,000,000.00	4,824,000,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT-7.125%-43/06/15	3,100,000,000.00	3,099,747,660.00	
		PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-8.875%-31/11/15	1,090,000,000.00	1,227,310,570.00	
インドネシアルピア小計			136,710,000,000.00	139,080,716,054.00 (1,335,174,874)	
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-2.26%-25/02/24	1,000,000.00	1,004,616.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.99%-25/04/09	2,300,000.00	2,306,549.59	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	4,000,000.00	4,072,792.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.22%-25/12/06	2,300,000.00	2,353,224.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.3%-26/05/15	2,000,000.00	2,020,300.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-26/06/06	2,100,000.00	2,165,049.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-26/08/15	1,600,000.00	1,611,211.43	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-26/12/05	2,300,000.00	2,374,050.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	3,000,000.00	3,084,102.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.28%-27/12/03	3,000,000.00	3,147,637.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	2,000,000.00	2,079,389.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	500,000.00	518,353.75	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.55%-28/10/15	1,000,000.00	1,020,564.10	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-28/11/22	2,200,000.00	2,323,637.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-29/05/23	2,100,000.00	2,233,001.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.13%-29/11/21	2,100,000.00	2,217,006.75	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-30/03/25	2,000,000.00	2,071,500.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	3,000,000.00	3,087,255.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-30/09/15	1,300,000.00	1,331,166.26	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	2,100,000.00	2,251,002.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.54%-30/12/25	1,000,000.00	1,021,168.70	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	2,000,000.00	2,110,502.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.89%-31/11/18	500,000.00	523,140.82	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	3,000,000.00	3,106,208.55	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-32/08/15	4,000,000.00	4,124,706.20	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-33/02/25	1,000,000.00	1,047,949.95	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/05/25	1,000,000.00	1,031,306.55	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.52%-33/08/25	1,000,000.00	1,018,412.80	

		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/11/25	1,000,000.00	1,031,475.55	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.35%-34/02/25	500,000.00	502,691.27	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	3,000,000.00	3,723,396.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	400,000.00	490,516.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-53/04/15	1,100,000.00	1,249,823.19	
中国元小計			61,400,000.00	64,253,708.56 (1,394,344,027)	
南アフリカランド	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-10.5%-26/12/21	20,000,000.00	20,700,000.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.0%-30/01/31	19,530,000.00	17,790,609.37	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-7.0%-31/02/28	11,340,000.00	9,398,025.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.25%-32/03/31	17,550,000.00	15,087,515.62	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.875%-35/02/28	18,000,000.00	14,934,375.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.25%-36/03/31	5,690,000.00	3,707,390.62	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.5%-37/01/31	16,410,000.00	12,640,828.12	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-9.0%-40/01/31	13,170,000.00	10,157,362.50	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-6.5%-41/02/28	5,090,000.00	3,046,046.87	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%-44/01/31	15,230,000.00	11,175,012.50	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-8.75%-48/02/28	22,850,000.00	16,623,375.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA-11.625%-53/03/31	2,500,000.00	2,363,281.25	
南アフリカランド小計			167,360,000.00	137,623,821.85 (1,180,812,391)	
合計				13,427,654,288 (13,427,654,288)	

(注1)当銘柄（※）の償還日につきましては、決算日時点で知りうる情報に基づいて記載しており、前回掲載時と異なる場合があります。

(注2)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3)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
メキシコペソ	国債証券	16銘柄	100.0%	9.1%
ブラジルレアル	国債証券	12銘柄	100.0%	9.9%
チリペソ	国債証券	9銘柄	100.0%	1.9%
コロンビアペソ	国債証券	12銘柄	100.0%	4.4%
ペルーヌエボソル	国債証券	9銘柄	100.0%	2.4%
ウルグアイペソ	国債証券	2銘柄	100.0%	0.2%
ドミニカペソ	国債証券	1銘柄	100.0%	0.2%
セルビアディナール	国債証券	4銘柄	100.0%	0.4%
トルコリラ	国債証券	12銘柄	100.0%	1.5%
チェココルナ	国債証券	22銘柄	100.0%	6.4%
ハンガリーフォリント	国債証券	18銘柄	100.0%	3.0%

ポーランドズロチ	国債証券	15銘柄	100.0%	7.9%
ロシアルーブル	国債証券	2銘柄	—	—
ルーマニアレイ	国債証券	23銘柄	100.0%	4.1%
マレーシアリンギット	国債証券	31銘柄	100.0%	10.3%
タイバーツ	国債証券	24銘柄	100.0%	9.4%
インドネシアルピア	国債証券	33銘柄	100.0%	9.9%
中国元	国債証券	33銘柄	100.0%	10.2%
南アフリカランド	国債証券	12銘柄	100.0%	8.8%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

【中間財務諸表】

（１）　当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2024年 6月18日から2024年12月17日まで）の中間財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前計算期間末 2024年 6月17日現在	当中間計算期間末 2024年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	746,754	995,709
親投資信託受益証券	25,593,043	35,580,367
未収利息	1	6
流動資産合計	26,339,798	36,576,082
資産合計	26,339,798	36,576,082
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,232	12,887
未払受託者報酬	2,692	27
未払委託者報酬	45,101	451
その他未払費用	16,527	15,287
流動負債合計	65,552	28,652
負債合計	65,552	28,652
純資産の部		
元本等		
元本	24,321,881	33,318,544
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,952,365	3,228,886
（分配準備積立金）	1,377,961	1,264,347
元本等合計	26,274,246	36,547,430
純資産合計	26,274,246	36,547,430
負債純資産合計	26,339,798	36,576,082

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自　2023年 6月20日 至　2023年12月19日	当中間計算期間 自　2024年 6月18日 至　2024年12月17日
営業収益		
受取利息	-	870
有価証券売買等損益	380,886	608,102
営業収益合計	380,886	608,972
営業費用		
支払利息	43	-
受託者報酬	1,856	4,356
委託者報酬	31,674	72,393
その他費用	6,874	15,932
営業費用合計	40,447	92,681
営業利益又は営業損失（△）	340,439	516,291
経常利益又は経常損失（△）	340,439	516,291
中間純利益又は中間純損失（△）	340,439	516,291
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	17,624	28,180
期首剰余金又は期首欠損金（△）	-	1,952,365
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,266	998,053
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	134	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,132	998,053
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	209,643
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	209,643
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	327,081	3,228,886

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

		前計算期間末 2024年 6月17日現在	当中間計算期間末 2024年12月17日現在
１．	期首元本額	10,000,000円	24,321,881円
	期中追加設定元本額	17,474,160円	11,582,241円
	期中一部解約元本額	3,152,279円	2,585,578円
２．	受益権の総数	24,321,881口	33,318,544口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

前中間計算期間 自 2023年 6月20日 至 2023年12月19日	当中間計算期間 自 2024年 6月18日 至 2024年12月17日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（１口当たり情報）

前計算期間末 2024年 6月17日現在		当中間計算期間末 2024年12月17日現在	
1口当たり純資産額	1.0803円	1口当たり純資産額	1.0969円
(1万口当たり純資産額)	(10,803円)	(1万口当たり純資産額)	(10,969円)

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

（参考）

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
資産の部		
流動資産		

コール・ローン	299,696,528	114,609,243
株式	58,888,845,740	62,606,807,782
未収入金	-	80,711,370
未収配当金	404,352,660	8,238,535
未収利息	676	736
前払金	2,920,000	-
流動資産合計	59,595,815,604	62,810,367,666
資産合計	59,595,815,604	62,810,367,666
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	13,541,000	363,650
前受金	-	139,100
未払金	165,983,820	-
未払解約金	11,544,635	70,210,480
流動負債合計	191,069,455	70,713,230
負債合計	191,069,455	70,713,230
純資産の部		
元本等		
元本	21,236,631,163	21,944,066,613
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	38,168,114,986	40,795,587,823
元本等合計	59,404,746,149	62,739,654,436
純資産合計	59,404,746,149	62,739,654,436
負債純資産合計	59,595,815,604	62,810,367,666

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
1．	期首	2023年 6月20日	2024年 6月18日
	期首元本額	21,757,908,489円	21,236,631,163円
	期首からの追加設定元本額	2,017,601,008円	1,925,072,177円
	期首からの一部解約元本額	2,538,878,334円	1,217,636,727円
	元本の内訳　※		
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	681,338,410円	716,696,082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	6,005,695,809円
	インデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）	1,844,251,733円	1,907,821,926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	2,233,040,282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

		2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
	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	1,352,915,114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
	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	21,944,066,613円
２．	受益権の総数	21,236,631,163口	21,944,066,613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	760,160,500円

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

（2024年 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	552,230,000	－	538,700,000	△13,530,000
合計		552,230,000	－	538,700,000	△13,530,000

（2024年12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	136,960,900	－	136,600,000	△360,900
合計		136,960,900	－	136,600,000	△360,900

（注）1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（１口当たり情報）

2024年 6月17日現在		2024年12月17日現在	
1口当たり純資産額	2.7973円	1口当たり純資産額	2.8591円
(1万口当たり純資産額)	(27,973円)	(1万口当たり純資産額)	(28,591円)

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	2,287,799,228	286,304,859
コール・ローン	4,669,439,542	6,458,187,570
株式	412,973,561,923	454,391,505,094
投資証券	7,633,035,032	8,343,627,472
派生商品評価勘定	136,347,249	162,392,738
未収入金	5,687,657	3,160,762
未収配当金	445,848,034	352,396,002
未収利息	10,538	41,518
差入委託証拠金	697,047,301	750,609,650
流動資産合計	428,848,776,504	470,748,225,665
資産合計	428,848,776,504	470,748,225,665
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,091,535	14,264,864
未払金	2,119,499,366	-
未払解約金	115,627,728	169,996,264
流動負債合計	2,247,218,629	184,261,128
負債合計	2,247,218,629	184,261,128
純資産の部		
元本等		
元本	63,890,308,192	64,936,257,353
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	362,711,249,683	405,627,707,184
元本等合計	426,601,557,875	470,563,964,537
純資産合計	426,601,557,875	470,563,964,537
負債純資産合計	428,848,776,504	470,748,225,665

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
１．	期首	2023年 6月20日	2024年 6月18日
	期首元本額	60,695,048,185円	63,890,308,192円
	期首からの追加設定元本額	10,256,311,431円	4,588,351,998円
	期首からの一部解約元本額	7,061,051,424円	3,542,402,837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	36,578,787,291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	931,557,448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・カントリー（全世界株式）	3,052,926,149円	4,269,099,060円
	Ｔｒａｃｅｒｓ　ＭＳＣＩオール・カントリー・インデックス（全世界株式）	515,065,720円	648,205,153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	910,460,302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
	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	4,095,654,093円
	計	63,890,308,192円	64,936,257,353円
２．	受益権の総数	63,890,308,192口	64,936,257,353口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2024年 6月17日現在	2024年12月17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	(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

	2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
	短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

（2024年 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	7,820,733,872	－	7,884,629,051	63,895,179
合計		7,820,733,872	－	7,884,629,051	63,895,179

（注）1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

（2024年 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	6,822,018,835	－	6,906,519,510	84,500,675
	米ドル	5,977,684,730	－	6,056,720,530	79,035,800
	ユーロ	844,334,105	－	849,798,980	5,464,875
	売建	93,921,000	－	94,188,980	△267,980
	米ドル	61,556,000	－	61,699,880	△143,880
	ユーロ	32,365,000	－	32,489,100	△124,100
合計		6,915,939,835	－	7,000,708,490	84,232,695

（注）1.時価の算定方法

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

①同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（１口当たり情報）

2024年 6月17日現在		2024年12月17日現在	
1口当たり純資産額	6.6771円	1口当たり純資産額	7.2466円
(1万口当たり純資産額)	(66,771円)	(1万口当たり純資産額)	(72,466円)

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	31,171,910	40,865,431
コール・ローン	1,116,312,298	1,509,870,224
株式	23,685,631,742	26,555,400,551
投資証券	442,413,901	491,236,585
派生商品評価勘定	22,235,329	20,682,482
未収入金	341,158	205,581
未収配当金	26,131,943	20,870,006
未収利息	2,519	9,706
差入委託証拠金	480,353,201	497,837,624
流動資産合計	25,804,594,001	29,136,978,190
資産合計	25,804,594,001	29,136,978,190
負債の部		
流動負債		

	2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
派生商品評価勘定	728,556,704	453,545,179
未払金	3,063,061	250,025,526
未払解約金	410,816	403,434
流動負債合計	732,030,581	703,974,139
負債合計	732,030,581	703,974,139
純資産の部		
元本等		
元本	8,961,693,680	9,340,881,117
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	16,110,869,740	19,092,122,934
元本等合計	25,072,563,420	28,433,004,051
純資産合計	25,072,563,420	28,433,004,051
負債純資産合計	25,804,594,001	29,136,978,190

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
1．	期首	2023年 6月20日	2024年 6月18日
	期首元本額	8,609,327,960円	8,961,693,680円
	期首からの追加設定元本額	1,024,062,363円	656,409,192円
	期首からの一部解約元本額	671,696,643円	277,221,755円
	元本の内訳　※		
	インデックスファンド海外株式ヘッジあり（ＤＣ専用）	7,590,398,629円	8,012,839,554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）	289,849,081円	283,193,664円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	1,025,011円	1,385,216円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）	458,325円	577,535円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	30,596,002円	28,042,717円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	93,428,989円	88,773,558円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	154,809,200円	146,586,857円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	162,101,019円	151,788,804円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジあり）	639,027,424円	627,693,212円
	計	8,961,693,680円	9,340,881,117円
2．	受益権の総数	8,961,693,680口	9,340,881,117口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（デリバティブ取引等に関する注記）
取引の時価等に関する事項
(株式関連)

（2024年 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	936,371,445	－	957,191,149	20,819,704
合計		936,371,445	－	957,191,149	20,819,704

（2024年12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	1,686,838,272	－	1,693,483,227	6,644,955
合計		1,686,838,272	－	1,693,483,227	6,644,955

（注）1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

（2024年 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	23,640,011,696	－	24,367,152,775	△727,141,079
	米ドル	18,029,442,167	－	18,546,857,638	△517,415,471
	加ドル	728,173,174	－	748,156,707	△19,983,533
	ユーロ	2,211,798,799	－	2,273,358,047	△61,559,248

	英ポンド	922,349,414	－	967,386,433	△45,037,019
	スイスフラン	603,490,495	－	633,647,469	△30,156,974
	スウェーデンクローナ	194,702,280	－	206,332,790	△11,630,510
	ノルウェークローネ	36,129,555	－	38,238,190	△2,108,635
	デンマーククローネ	250,578,407	－	257,079,125	△6,500,718
	豪ドル	449,157,480	－	474,440,478	△25,282,998
	ニュージーランドドル	7,527,258	－	8,090,241	△562,983
	香港ドル	112,219,400	－	116,150,428	△3,931,028
	シンガポールドル	71,614,081	－	74,021,755	△2,407,674
	イスラエルシュケル	22,829,186	－	23,393,474	△564,288
合計		23,640,011,696	－	24,367,152,775	△727,141,079

（2024年12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	26,874,051,015	－	27,313,558,667	△439,507,652
	米ドル	20,951,459,246	－	21,367,293,814	△415,834,568
	加ドル	861,114,290	－	861,509,789	△395,499
	ユーロ	2,288,622,025	－	2,297,622,859	△9,000,834
	英ポンド	962,866,531	－	976,200,739	△13,334,208
	スイスフラン	617,009,799	－	615,295,350	1,714,449
	スウェーデンクローナ	201,170,860	－	201,081,392	89,468
	ノルウェークローネ	39,028,938	－	39,263,639	△234,701
	デンマーククローネ	216,835,000	－	218,105,737	△1,270,737
	豪ドル	496,003,106	－	491,271,139	4,731,967
	ニュージーランドドル	8,332,892	－	8,273,688	59,204
	香港ドル	119,654,493	－	122,966,084	△3,311,591
	シンガポールドル	83,745,281	－	84,360,876	△615,595
	イスラエルシュケル	28,208,554	－	30,313,561	△2,105,007
合計		26,874,051,015	－	27,313,558,667	△439,507,652

（注）1.時価の算定方法

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

①同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（１口当たり情報）

2024年 6月17日現在		2024年12月17日現在	
1口当たり純資産額	2.7977円	1口当たり純資産額	3.0439円
(1万口当たり純資産額)	(27,977円)	(1万口当たり純資産額)	(30,439円)

海外新興国株式インデックスＭＳＣＩエマージング（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	311,121,246	174,410,451
コール・ローン	245,939,316	230,901,157
株式	120,619,745,465	121,537,261,801
投資証券	96,118,756	98,121,518
派生商品評価勘定	1,736,037	17,931,425
未収入金	1,130,137	-
未収配当金	367,706,443	152,708,603
未収利息	37,098	1,484
差入委託証拠金	5,916,574,464	9,052,971,393
流動資産合計	127,560,108,962	131,264,307,832
資産合計	127,560,108,962	131,264,307,832
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	10,775,840	49,493,344
未払金	120,399,923	-
未払解約金	25,640,857	28,302,937
流動負債合計	156,816,620	77,796,281
負債合計	156,816,620	77,796,281
純資産の部		
元本等		
元本	43,369,368,369	43,990,434,534
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	84,033,923,973	87,196,077,017
元本等合計	127,403,292,342	131,186,511,551
純資産合計	127,403,292,342	131,186,511,551
負債純資産合計	127,560,108,962	131,264,307,832

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
1．	期首	2023年 6月20日	2024年 6月18日
	期首元本額	44,618,770,595円	43,369,368,369円
	期首からの追加設定元本額	7,896,564,098円	3,845,416,990円
	期首からの一部解約元本額	9,145,966,324円	3,224,350,825円
	元本の内訳　※		
	日興五大陸株式ファンド	1,923,435,277円	2,020,256,094円
	インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	20,237,475,250円	21,285,002,500円
	インデックスファンド新興国株式（適格機関投資家向け）	3,192,053,880円	3,312,328,335円
	グローバル３倍３分法ファンド（適格機関投資家向け）	17,036,807,408円	15,988,975,735円
	Ｔｒａｃｅｒｓ　グローバル３分法（おとなのバランス）	3,967,763円	6,558,633円
	インデックスファンドＭＳＣＩオール・カントリー（全世界株式）	833,557,714円	1,193,973,784円
	Ｔｒａｃｅｒｓ　ＭＳＣＩオール・カントリー・インデックス（全世界株式）	140,647,892円	181,288,830円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	981,209円	1,435,213円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）	441,976円	615,410円
	計	43,369,368,369円	43,990,434,534円
2．	受益権の総数	43,369,368,369口	43,990,434,534口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

（2024年 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	6,746,588,507	－	6,737,246,978	△9,341,529
合計		6,746,588,507	－	6,737,246,978	△9,341,529

（2024年12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	9,600,949,483	－	9,569,011,736	△31,937,747
合計		9,600,949,483	－	9,569,011,736	△31,937,747

（注）1.時価の算定方法

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

（2024年 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	185,555,000	－	185,856,726	301,726
	米ドル	185,555,000	－	185,856,726	301,726
合計		185,555,000	－	185,856,726	301,726

（2024年12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	161,584,500	－	161,962,185	377,685
	米ドル	161,584,500	－	161,962,185	377,685
	売建	45,453,965	－	45,455,822	△1,857
	米ドル	23,137,500	－	23,134,410	3,090
	メキシコペソ	9,422,415	－	9,422,292	123
	香港ドル	12,894,050	－	12,899,120	△5,070
合計		207,038,465	－	207,418,007	375,828

（注）1.時価の算定方法

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

①同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（１口当たり情報）

2024年 6月17日現在		2024年12月17日現在	
1口当たり純資産額	2.9376円	1口当たり純資産額	2.9822円
(1万口当たり純資産額)	(29,376円)	(1万口当たり純資産額)	(29,822円)

日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	214,999,838	217,660,987
投資証券	59,683,122,100	56,115,724,100
未収配当金	335,386,878	358,795,775
未収利息	485	1,399
流動資産合計	60,233,509,301	56,692,182,261
資産合計	60,233,509,301	56,692,182,261
負債の部		
流動負債		
未払金	179,233,450	-
未払解約金	1,431,980	2,207,183
流動負債合計	180,665,430	2,207,183
負債合計	180,665,430	2,207,183
純資産の部		
元本等		
元本	24,754,972,956	24,086,073,081
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	35,297,870,915	32,603,901,997
元本等合計	60,052,843,871	56,689,975,078
純資産合計	60,052,843,871	56,689,975,078
負債純資産合計	60,233,509,301	56,692,182,261

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
１．	期首	2023年 6月20日	2024年 6月18日
	期首元本額	23,888,659,299円	24,754,972,956円
	期首からの追加設定元本額	4,084,291,051円	345,003,623円
	期首からの一部解約元本額	3,217,977,394円	1,013,903,498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	764,719,645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つみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	1,160,932円	1,743,729円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界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	24,086,073,081円
２．	受益権の総数	24,754,972,956口	24,086,073,081口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（１口当たり情報）

2024年 6月17日現在		2024年12月17日現在	
1口当たり純資産額	2.4259円	1口当たり純資産額	2.3536円
(1万口当たり純資産額)	(24,259円)	(1万口当たり純資産額)	(23,536円)

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	342,192,595	299,698,988
コール・ローン	21,161,575	24,826,139
投資証券	55,931,087,801	51,291,995,135
未収入金	1,339,882	18,442,911
未収配当金	146,414,243	160,307,353
未収利息	47	159
流動資産合計	56,442,196,143	51,795,270,685
資産合計	56,442,196,143	51,795,270,685
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,033,914	8,234,951
流動負債合計	6,033,914	8,234,951
負債合計	6,033,914	8,234,951
純資産の部		
元本等		
元本	16,493,547,462	13,960,227,491
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	39,942,614,767	37,826,808,243

	2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
元本等合計	56,436,162,229	51,787,035,734
純資産合計	56,436,162,229	51,787,035,734
負債純資産合計	56,442,196,143	51,795,270,685

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17日現在
１．	期首	2023年 6月20日	2024年 6月18日
	期首元本額	20,076,486,597円	16,493,547,462円
	期首からの追加設定元本額	1,493,576,470円	147,899,800円
	期首からの一部解約元本額	5,076,515,605円	2,681,219,771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	1,727,700,817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	13,960,227,491円
２．	受益権の総数	16,493,547,462口	13,960,227,491口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（１口当たり情報）

2024年 6月17日現在		2024年12月17日現在	
1口当たり純資産額	3.4217円	1口当たり純資産額	3.7096円
(1万口当たり純資産額)	(34,217円)	(1万口当たり純資産額)	(37,096円)

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	239,990,104	274,137,165
国債証券	48,934,876,410	48,489,468,870
地方債証券	1,921,804,621	2,677,578,704
特殊債券	2,096,553,711	1,984,806,462
社債券	1,504,194,000	2,115,678,000
未収利息	150,392,527	159,027,699
前払費用	7,044,677	7,938,321
流動資産合計	54,854,856,050	55,708,635,221
資産合計	54,854,856,050	55,708,635,221
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,062,299	7,875,989
流動負債合計	11,062,299	7,875,989
負債合計	11,062,299	7,875,989
純資産の部		
元本等		
元本	41,634,998,227	42,586,949,113
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	13,208,795,524	13,113,810,119
元本等合計	54,843,793,751	55,700,759,232
純資産合計	54,843,793,751	55,700,759,232
負債純資産合計	54,854,856,050	55,708,635,221

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
１．	期首	2023年 6月20日	2024年 6月18日
	期首元本額	37,185,676,902円	41,634,998,227円
	期首からの追加設定元本額	5,785,918,151円	3,300,193,529円
	期首からの一部解約元本額	1,336,596,826円	2,348,242,643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	6,816,249,837円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	6,335,058,393円	6,623,471,464円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	5,298,425,593円	5,576,882,964円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	1,028,653,945円	1,081,604,270円

	インデックスファンド日本債券（ＤＣ専用）	2,175,942,211円	2,187,190,147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	50,013,731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	1,688,749,070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	1,793,979,658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	1,113,881,957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	174,357,296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	5,637,024,380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	42,586,949,113円
２．	受益権の総数	41,634,998,227口	42,586,949,113口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

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

（１口当たり情報）

2024年 6月17日現在		2024年12月17日現在	
1口当たり純資産額	1.3173円	1口当たり純資産額	1.3079円
(1万口当たり純資産額)	(13,173円)	(1万口当たり純資産額)	(13,079円)

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17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	115,540,209	100,110,233
コール・ローン	86,680,360	135,950,565
国債証券	168,779,266,015	164,221,166,531
派生商品評価勘定	57,938	8,652
未収入金	80,078,161	377,826,807
未収利息	1,228,981,169	1,177,774,492
前払費用	75,582,557	74,529,113
流動資産合計	170,366,186,409	166,087,366,393
資産合計	170,366,186,409	166,087,366,393
負債の部		
流動負債		

	2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
派生商品評価勘定	76,617	505,787
未払解約金	162,365,840	221,236,183
流動負債合計	162,442,457	221,741,970
負債合計	162,442,457	221,741,970
純資産の部		
元本等		
元本	55,620,468,481	54,455,404,034
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	114,583,275,471	111,410,220,389
元本等合計	170,203,743,952	165,865,624,423
純資産合計	170,203,743,952	165,865,624,423
負債純資産合計	170,366,186,409	166,087,366,393

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
1．	期首	2023年 6月20日	2024年 6月18日
	期首元本額	58,231,039,162円	55,620,468,481円
	期首からの追加設定元本額	3,685,158,911円	1,556,895,723円
	期首からの一部解約元本額	6,295,729,592円	2,721,960,170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	20,948,499,529円
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	425,726,925円	454,750,614円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	612,613,905円	638,805,627円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	919,335,691円	969,526,253円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	891,421,308円	939,563,839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	11,524,870,958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	2,100,803,621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	801,903,209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	359,219,247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	41,143,228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	56,342,320円

		2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
	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	86,955,382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	96,728,205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	75,627,676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	3,328,254,102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	356,108,750円
	計	55,620,468,481円	54,455,404,034円
２．	受益権の総数	55,620,468,481口	54,455,404,034口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

(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	278,051,727	－	278,548,862	△497,135
	米ドル	64,785,000	－	64,776,348	8,652
	加ドル	9,860,760	－	9,861,670	△910
	ユーロ	97,087,320	－	97,458,600	△371,280
	英ポンド	21,732,401	－	21,741,037	△8,636

	豪ドル	7,132,950	—	7,134,801	△1,851
	中国元	77,453,296	—	77,576,406	△123,110
合計		278,051,727	—	278,548,862	△497,135

（注）1.時価の算定方法

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

①同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（１口当たり情報）

2024年 6月17日現在		2024年12月17日現在	
1口当たり純資産額	3.0601円	1口当たり純資産額	3.0459円
(1万口当たり純資産額)	(30,601円)	(1万口当たり純資産額)	(30,459円)

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	100,764,027	143,052,541
コール・ローン	1,291,740,400	228,911,083
国債証券	23,190,698,274	23,912,729,887
派生商品評価勘定	9,982,575	8,925,608
未収利息	183,332,556	193,736,189
前払費用	11,451,780	13,992,148
流動資産合計	24,787,969,612	24,501,347,456
資産合計	24,787,969,612	24,501,347,456
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	73,984,760	444,910,551
未払金	1,409,313,552	-
未払解約金	2,030,969	4,623,944
流動負債合計	1,485,329,281	449,534,495
負債合計	1,485,329,281	449,534,495
純資産の部		
元本等		
元本	17,805,941,392	18,393,651,857
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	5,496,698,939	5,658,161,104
元本等合計	23,302,640,331	24,051,812,961
純資産合計	23,302,640,331	24,051,812,961
負債純資産合計	24,787,969,612	24,501,347,456

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
1．	期首	2023年 6月20日	2024年 6月18日
	期首元本額	16,663,259,337円	17,805,941,392円
	期首からの追加設定元本額	2,068,340,359円	1,817,217,251円
	期首からの一部解約元本額	925,658,304円	1,229,506,786円
	元本の内訳　※		
	インデックスファンド海外債券ヘッジあり（ＤＣ専用）	6,583,375,342円	7,414,717,750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）	1,547,954,537円	1,518,073,694円
	Ｔｒａｃｅｒｓ　グローバル３分法（おとなのバランス）	257,390,397円	443,562,659円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	2,177,729円	3,171,424円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）	4,887,646円	6,691,740円
	国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	8,254,358,182円	7,852,340,891円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	130,384,354円	129,792,051円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	198,229,162円	199,135,773円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	217,738,979円	222,784,031円
	年金積立　アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	172,380,008円	174,263,420円
	インデックスファンド海外債券（ヘッジあり）１年決算型	437,065,056円	429,118,424円
	計	17,805,941,392円	18,393,651,857円
2．	受益権の総数	17,805,941,392口	18,393,651,857口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2024年 6月17日現在	2024年12月17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

	2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（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	22,844,338,488	－	22,908,340,673	△64,002,185
	米ドル	10,691,917,324	－	10,709,217,870	△17,300,546
	加ドル	434,658,085	－	435,939,921	△1,281,836
	メキシコペソ	189,393,352	－	181,114,329	8,279,023
	ユーロ	6,980,223,300	－	6,986,280,456	△6,057,156
	英ポンド	1,181,920,159	－	1,185,608,989	△3,688,830
	スウェーデンクローナ	58,730,054	－	58,938,999	△208,945
	ノルウェークローネ	46,333,241	－	46,888,744	△555,503
	デンマーククローネ	76,175,812	－	77,640,930	△1,465,118
	ポーランドズロチ	114,447,082	－	113,223,816	1,223,266
	豪ドル	289,516,898	－	301,490,150	△11,973,252
	ニュージーランドドル	41,126,888	－	41,825,659	△698,771
	シンガポールドル	96,658,099	－	98,180,224	△1,522,125
	マレーシアリンギット	345,425,482	－	346,277,170	△851,688
	中国元	2,247,318,552	－	2,275,269,646	△27,951,094
	イスラエルシュケル	50,494,160	－	50,443,770	50,390
合計		22,844,338,488	－	22,908,340,673	△64,002,185

（2024年12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	23,745,856,583	－	24,181,841,526	△435,984,943
	米ドル	11,035,092,726	－	11,277,060,295	△241,967,569
	加ドル	446,137,714	－	451,791,422	△5,653,708
	メキシコペソ	165,779,216	－	170,710,552	△4,931,336
	ユーロ	7,082,459,361	－	7,202,649,965	△120,190,604
	英ポンド	1,237,585,669	－	1,257,820,556	△20,234,887
	スウェーデンクローナ	57,320,262	－	58,536,877	△1,216,615

	ノルウェークローネ	44,503,568	—	45,280,437	△776,869
	デンマーククローネ	65,369,993	—	65,693,670	△323,677
	ポーランドズロチ	114,484,059	—	116,682,584	△2,198,525
	豪ドル	286,505,475	—	283,784,388	2,721,087
	ニュージーランドドル	41,348,871	—	40,849,088	499,783
	シンガポールドル	101,133,926	—	102,036,543	△902,617
	マレーシアリンギット	353,389,035	—	365,714,520	△12,325,485
	中国元	2,662,737,636	—	2,688,973,760	△26,236,124
	イスラエルシュケル	52,009,072	—	54,256,869	△2,247,797
合計		23,745,856,583	—	24,181,841,526	△435,984,943

（注）1.時価の算定方法

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

①同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（１口当たり情報）

2024年 6月17日現在		2024年12月17日現在	
1口当たり純資産額	1.3087円	1口当たり純資産額	1.3076円
(1万口当たり純資産額)	(13,087円)	(1万口当たり純資産額)	(13,076円)

海外新興国債券インデックスＬｏｃａｌ（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17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	46,161,769	77,301,595
コール・ローン	79,444,741	103,432,636
国債証券	13,427,654,288	14,249,911,064
派生商品評価勘定	102,280	143,880
未収利息	238,387,565	216,323,039
前払費用	19,853,843	11,211,255
流動資産合計	13,811,604,486	14,658,323,469
資産合計	13,811,604,486	14,658,323,469
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-

	2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
純資産の部		
元本等		
元本	7,742,903,961	8,102,263,315
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	6,068,700,525	6,556,060,154
元本等合計	13,811,604,486	14,658,323,469
純資産合計	13,811,604,486	14,658,323,469
負債純資産合計	13,811,604,486	14,658,323,469

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

		2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
１．	期首	2023年 6月20日	2024年 6月18日
	期首元本額	6,603,340,024円	7,742,903,961円
	期首からの追加設定元本額	1,381,066,604円	520,864,286円
	期首からの一部解約元本額	241,502,667円	161,504,932円
	元本の内訳　※		
	インデックスファンド海外新興国（エマージング）債券（１年決算型）	7,739,897,806円	8,097,909,262円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	1,581,593円	2,348,282円
	Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）	1,424,562円	2,005,771円
	計	7,742,903,961円	8,102,263,315円
２．	受益権の総数	7,742,903,961口	8,102,263,315口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2024年 6月17日現在	2024年12月17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

	2024年 6月17日現在	2024年12月17日現在
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（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				
	買建	62,900,000	－	63,002,280	102,280
	米ドル	62,900,000	－	63,002,280	102,280
合計		62,900,000	－	63,002,280	102,280

（2024年12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	61,556,000	－	61,699,880	143,880
	米ドル	61,556,000	－	61,699,880	143,880
合計		61,556,000	－	61,699,880	143,880

（注）1.時価の算定方法

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

①同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（１口当たり情報）

2024年 6月17日現在		2024年12月17日現在	
1口当たり純資産額	1.7838円	1口当たり純資産額	1.8092円
(1万口当たり純資産額)	(17,838円)	(1万口当たり純資産額)	(18,092円)

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。

【Ｎｉつみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	39,593,883円
Ⅱ　負債総額	196,066円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	39,397,817円
Ⅳ　発行済口数	35,842,211口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0992円

（参考）

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	64,153,777,380円
Ⅱ　負債総額	27,677,904円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	64,126,099,476円
Ⅳ　発行済口数	21,943,287,658口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	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

Ⅰ　資産総額	471,425,418,006円
Ⅱ　負債総額	117,901,039円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	471,307,516,967円
Ⅳ　発行済口数	64,710,993,411口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	7.2833円

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジあり）マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	29,004,157,639円
Ⅱ　負債総額	1,095,953,828円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	27,908,203,811円
Ⅳ　発行済口数	9,349,698,310口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.9849円

海外新興国株式インデックスＭＳＣＩエマージング（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	128,648,561,617円

Ⅱ　負債総額	141,396,805円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	128,507,164,812円
Ⅳ　発行済口数	42,832,122,950口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.0003円

日本リートインデックスＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

純資産額計算書

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

Ⅰ　資産総額	50,944,836,388円
Ⅱ　負債総額	13,170,077円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	50,931,666,311円
Ⅳ　発行済口数	13,837,262,669口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	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

Ⅰ　資産総額	56,201,766,416円
Ⅱ　負債総額	309,435,429円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	55,892,330,987円
Ⅳ　発行済口数	42,735,864,195口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	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

Ⅰ　資産総額	167,198,515,018円
Ⅱ　負債総額	251,904,926円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	166,946,610,092円
Ⅳ　発行済口数	54,138,692,479口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.0837円

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	24,824,162,578円

Ⅱ　負債総額	970,186,993円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	23,853,975,585円
Ⅳ　発行済口数	18,415,865,559口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2953円

海外新興国債券インデックスＬｏｃａｌ（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	15,103,683,355円
Ⅱ　負債総額	51,665,250円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	15,052,018,105円
Ⅳ　発行済口数	8,228,435,847口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8293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
①　譲渡制限はありません。
②　受益権の譲渡
・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
③　受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

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

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

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

第三部【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）

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

２【事業の内容及び営業の概況】

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

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

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

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第65期事業年度（2023年４月１日から2024年３月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。
　また、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第66期中間会計期間（2024年４月１日から2024年９月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

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

（2）【損益計算書】

（単位：百万円）

		第64期 (自　2022年４月１日 至　2023年３月31日)		第65期 (自　2023年４月１日 至　2024年３月31日)
営業収益				
委託者報酬		73,998		75,874
その他営業収益		3,479	※1	3,714
営業収益合計		77,477		79,588
営業費用				
支払手数料		30,699		32,917
広告宣伝費		755		711
公告費		3		3

調査費	17,479	17,736
調査費	1,170	1,266
委託調査費	16,282	16,445
図書費	26	23
委託計算費	581	610
営業雑経費	948	881
通信費	139	135
印刷費	309	308
協会費	56	48
諸会費	16	11
その他	427	375
営業費用計	50,469	52,860
一般管理費		
給料	9,818	10,550
役員報酬	314	459
役員賞与引当金繰入額	234	273
給料・手当	6,544	6,791
賞与	147	277
賞与引当金繰入額	2,577	2,747
交際費	56	71
寄付金	24	22
旅費交通費	205	260
租税公課	433	389
不動産賃借料	938	906
退職給付費用	383	388
退職金	155	36
固定資産減価償却費	183	199
福利費	1,097	1,208
諸経費	4,291	4,661
一般管理費計	17,588	18,694
営業利益	9,420	8,033

（単位：百万円）

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

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第64期（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

（単位：百万円）

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

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

第65期（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本				
		資本剰余金	利益剰余金		

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

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

[注記事項]

（重要な会計方針）

項目	第65期 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）
1　資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 ①　子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 ②　その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 市場価格のない株式等 総平均法による原価法 (2) 金銭の信託 時価法 (3) デリバティブ 時価法
2　固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年４月１日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物　３年～15年 器具備品　３年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウエア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(５年)に基づく定額法によっております。
3　引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。

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

（重要な会計上の見積り）

第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)

該当事項はありません。

第65期(自　2023年４月１日　至　2024年３月31日)

該当事項はありません。

（貸借対照表関係）

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

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

（損益計算書関係）

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

（株主資本等変動計算書関係）
第64期（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）
１　発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２　自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

３　新株予約権等に関する事項

		新株予約権の目的となる株式の数(株)	

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

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

4　配当に関する事項
(1) 配当金支払額

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

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

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

第65期（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）
1　発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2　自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3　新株予約権等に関する事項

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

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

4　配当に関する事項
(1) 配当金支払額

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

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

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

(リース取引関係)

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

（金融商品関係）

第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)

１　金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

② 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

２　金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

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

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

資　産

有価証券

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

デリバティブ取引

株式関連

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

通貨関連

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

（注２）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

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

３　金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については金銭の信託及び短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

② 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

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

（※１）デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、△で示しております。
（※２）株式関連のデリバティブ取引の△309百万円は、貸借対照表上流動資産及び流動負債のその他に含まれております。
（※３）通貨関連のデリバティブ取引の△367百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

資　産

金銭の信託

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

有価証券

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

デリバティブ取引

株式関連

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

通貨関連

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

（注２）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

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

３　金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

（有価証券関係）

第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)

１　子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

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

２　その他有価証券

（単位：百万円）

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

(注) １　減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。
２　非上場株式等（貸借対照表計上額　16百万円）については、市場価格のない株式等であることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

３　当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：百万円）

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

第65期(自　2023年４月１日　至　2024年３月31日)

１　子会社株式及び関連会社株式

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	19,011
関連会社株式	18,635

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

２　その他有価証券

（単位：百万円）

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

(注) １　減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。
２　非上場株式等（貸借対照表計上額2,540百万円）については、市場価格のない株式等であることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

３　当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：百万円）

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

４　保有目的を変更した有価証券

注記事項「（損益計算書関係）※３　有価証券評価益」をご参照ください。

（金銭の信託関係）

第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)

該当事項はありません。

第65期(自　2023年４月１日　至　2024年３月31日)

運用目的の金銭の信託

（単位：百万円）

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

（デリバティブ取引関係）

第64期(2023年３月31日)

１　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）株式関連

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

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

２　時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

（2）通貨関連

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

(注) １　時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

２　ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

(注) １　時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第65期(2024年３月31日)

１　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）株式関連

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

(注) 1　上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。
2　時価の算定方法
金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連
該当事項はありません。

2　ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
通貨関連

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

(注) 1　時価の算定方法
取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

（持分法損益等）

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

（退職給付関係）
第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)
1　採用している退職給付制度の概要
当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2　確定給付制度
(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

退職給付引当金	1,424
貸借対照表に計上された負債の額	1,424

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	133
利息費用	4
数理計算上の差異の費用処理額	△1

確定給付制度に係る退職給付費用	136

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

割引率	0.6%

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

第65期(自 2023年４月１日 至 2024年３月31日)
1 採用している退職給付制度の概要
当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2 確定給付制度
(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

退職給付引当金	1,448
貸借対照表に計上された負債の額	1,448

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

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

割引率	0.7%

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

（ストックオプション等関係）
第64期(自 2022年４月１日 至 2023年３月31日)
1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況
(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

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

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

(注)　株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

①　ストックオプション（新株予約権）の数

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

	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2018年４月27日

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

(注)　株式数に換算して記載しております。

②　単価情報

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

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

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

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

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

(注)　株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

①　ストックオプション（新株予約権）の数

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

(注)　株式数に換算して記載しております。

②　単価情報

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

(注)　1　公正な評価単価に代え、本源的価値（評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。
2　ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額　　104百万円

(税効果会計関係)

第64期 (2023年３月31日)	第65期 (2024年３月31日)

1　繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1　繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
	（単位：百万円）		（単位：百万円）
繰延税金資産		繰延税金資産	
賞与引当金	918	賞与引当金	975
投資有価証券評価損	97	投資有価証券評価損	8
関係会社株式評価損	52	関係会社株式評価損	52
退職給付引当金	436	退職給付引当金	443
固定資産減価償却費	83	固定資産減価償却費	80
繰延ヘッジ損益	215	繰延ヘッジ損益	510
その他	672	その他	679
繰延税金資産小計	2,478	繰延税金資産小計	2,750
評価性引当金	△52	評価性引当金	△52
繰延税金資産合計	2,425	繰延税金資産合計	2,697
繰延税金負債		繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	1,028	その他有価証券評価差額金	2,044
その他	948	その他	948
繰延税金負債合計	1,977	繰延税金負債合計	2,992
繰延税金資産の純額	448	繰延税金負債の純額	295

2　法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳		2　法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率	30.6%	法定実効税率	30.6%
（調整）		（調整）	
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.0%	交際費等永久に損金に算入されない項目	1.2%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△12.0%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	△10.9%
その他	0.8%	その他	1.1%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	20.5%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	22.0%

（関連当事者情報）
第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)
１　関連当事者との取引
(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引
(ア) 財務諸表提出会社の親会社
重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

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

(注)　取引条件及び取引条件の決定方針等

1．融資枠55百万シンガポールドル、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。

2．融資枠5,300百万円（若しくは5,300百万円相当額の外国通貨）、返済期間１年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しておりました（決定方針等を2022年8月26日付にて上記1に変更しております）。

3．Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

２　親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

第65期(自　2023年４月１日　至　2024年３月31日)

１　関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注)　取引条件及び取引条件の決定方針等

１．融資枠55百万シンガポールドル、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しておりました。

２．Nikko Asset Management International Limitedが保有する関連会社AHAM Asset Management Berhadの20%の株式を、2023年４月19日に13,412百万円で取得しました。

３．Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

４．Nikko AM Global Holdings Limitedの行った1,828,000,000株の新株発行増資を、1株につき1円で当社が引受けたものであります。

２　親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

資産合計	41,322百万円
負債合計	8,314百万円
純資産合計	33,008百万円
営業収益	18,682百万円
税引前当期純利益	6,005百万円
当期純利益	4,538百万円

（セグメント情報等）

セグメント情報

第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)

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

第65期(自　2023年４月１日　至　2024年３月31日)

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

関連情報

第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)

１　製品及びサービスごとの情報

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

２　地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

３　主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第65期(自　2023年４月１日　至　2024年３月31日)

１　製品及びサービスごとの情報

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

２　地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

３　主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

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

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報
第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)
該当事項はありません。

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

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報
第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)
該当事項はありません。

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

(収益認識関係)
第64期(自　2022年４月１日　至　2023年３月31日)
１　顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

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

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

第65期(自　2023年４月１日　至　2024年３月31日)
１　顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

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

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

（１株当たり情報）

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

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

２　１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

３　１株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

（重要な後発事象）
該当事項はありません。

中間財務諸表等

（１）中間貸借対照表

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

	第66期中間会計期間 (2024年９月30日)
負債の部	
流動負債	

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

（２）中間損益計算書

（単位：百万円）

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

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

（３）中間株主資本等変動計算書

第66期中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024年９月30日）

（単位：百万円）

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

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	4,523	△ 1,155	3,367	106,475
当中間期変動額				
剰余金の配当				△ 11,183
中間純利益				5,116
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 1,310	525	△ 784	△ 784
当中間期変動額合計	△ 1,310	525	△ 784	△ 6,851
当中間期末残高	3,213	△ 629	2,583	99,624

注記事項
（重要な会計方針）

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

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

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

（中間貸借対照表関係）

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

（中間損益計算書関係）

第66期中間会計期間 (自　2024年４月１日 至　2024年９月30日)

※１　減価償却実施額

有形固定資産	46百万円
無形固定資産	48百万円

※２　営業外収益のうち主要なもの

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

有価証券評価益について、保有している一部の有価証券の区分を、運用方針の変更のためその他有価証券から売買目的有価証券に振り替え、金銭の信託に移管したことに伴い、振替時の評価差額を営業外収益に計上しております。

※３　営業外費用のうち主要なもの

支払利息	420百万円

※４　特別利益のうち主要なもの

投資有価証券売却益	172百万円

※５　特別損失のうち主要なもの

投資有価証券売却損	42百万円

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

第66期中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024年９月30日）

１　発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２　自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

３　新株予約権等に関する事項

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

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

４　配当に関する事項

(1)配当金支払額

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

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

該当事項はありません。

(リース取引関係)

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

（金融商品関係）

第66期中間会計期間(2024年９月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

（１）時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

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

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

（２）時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

資　産

金銭の信託

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

有価証券

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

デリバティブ取引

株式関連

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

通貨関連

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

（注２）市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額は次のとおりであります。

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

第66期中間会計期間(2024年９月30日)

１　子会社株式及び関連会社株式

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

２　その他有価証券

（単位：百万円）

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

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

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

（金銭の信託関係）

第66期中間会計期間(2024年９月30日)

運用目的の金銭の信託

（単位：百万円）

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

（デリバティブ取引関係）

第66期中間会計期間(2024年９月30日)

１　ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（1）株式関連

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

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

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

（2）通貨関連

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

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

２　ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

（持分法損益等）

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

（収益認識関係）

第66期中間会計期間(2024年９月30日)

１　顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

２　顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（ストックオプション等関係）

第66期中間会計期間(自　2024年４月１日　至　2024年９月30日)

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

セグメント情報

第66期中間会計期間(自　2024年４月１日　至　2024年９月30日)

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

関連情報

第66期中間会計期間(自　2024年４月１日　至　2024年９月30日)

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

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

（２）有形固定資産
国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

３　主要な顧客ごとの情報
営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第66期中間会計期間(自　2024年４月１日　至　2024年９月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第66期中間会計期間(自　2024年４月１日　至　2024年９月30日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第66期中間会計期間(自　2024年４月１日　至　2024年９月30日)

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

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

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

２　１株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第66期中間会計期間 (自　2024年４月１日 至　2024年９月30日)
中間純利益（百万円）	5,116
普通株主に帰属しない金額（百万円）	－
普通株式に係る中間純利益（百万円）	5,116
普通株式の期中平均株式数（千株）	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後１株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2017年度ストックオプション(1)192,000株

３　１株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第66期中間会計期間 (2024年９月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額（百万円）	99,624
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	－
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額（百万円）	99,624
１株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数（千株）	194,152

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

４【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

５【その他】

（１）定款の変更
委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
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ないます。
・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
インタラクティブ・ブローカーズ証券株式会社　※1	1,600百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	54,323百万円	
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	
日興アセットマネジメント株式会社	17,363百万円	証券投資信託の設定を行なうとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また金融商品取引法に定める投資助言業務を行なっています。

※1　2025年5月1日より取扱開始予定です。

２【関係業務の概要】

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

３【資本関係】

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

第３【その他】

（１）目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用します。
（２）目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。
①　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
②　ファンドの基本的性格など
③　委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など
④　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
⑤　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。
①　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。
②　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。
③　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。
④　「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。
⑤　「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。
⑥　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。
⑦　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。
⑧　「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。
⑨　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。
⑩　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。
⑪　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。
⑫　委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。

（４）有価証券届出書本文「第一部　証券情報」、「第二部　ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
（５）目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部　ファンド情報」中「第１　ファンドの状況」「２　投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
（６）投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用する場合があります。
（７）目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
（８）交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
①　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。
②　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。
③　ファンドは、大量の解約が発生し、短期間で解約資金の手当てをする必要が生じた場合や、主たる取引市場において市場が急変した場合などに、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがある旨。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金の申込みの受付を中止する可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性がある旨の記載。
④　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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。
監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。
・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連

する注記事項の妥当性を評価する。

・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

(注)1.上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2024年9月4日

日興アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

PwC Japan有限責任監査法人
東京事務所

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

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているNiつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）の2023年6月20日から2024年6月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）の2024年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2024年12月５日

日興アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　秋 宗 勝 彦

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　三 上 和 彦

中間監査意見

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

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)1.上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2.ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2025年1月29日

日興アセットマネジメント株式会社

取 締 役 会 御 中

PwC Japan有限責任監査法人
東京事務所

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているNiつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）の2024年6月18日から2024年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）の2024年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年6月18日から2024年12月17日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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