

【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8月6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】	050-5785-6187
【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】	ＤＣインデックスバランス（株式６０）
【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】

ＤＣインデックスバランス（株式60）（以下「ファンド」といいます。）

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位

（７）【申込期間】

2025年8月7日から2026年2月6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】

ファンドの目的

4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

1）商品分類

単位型投信・ 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国 内	株 式
	海 外	債 券
追加型投信		不動産投信
	内 外	その他資産 ()
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来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	年 1 回	グローバル (含む日本)		
一般	年 2 回			
大型株	年 4 回	日本		
中小型株				
債券		北米	ファミリーファンド	あり
一般	年 6 回			()
公債	(隔月)	欧州		
社債				
その他債券	年 12 回	アジア		
クレジット属性 ()	(毎月)	オセアニア		
	日々			
不動産投信		中南米	ファンド・オブ・	なし
	その他 ()	アフリカ	ファンズ	
その他資産 (投資信託証券(資 産複合 資産配分 固定型(株式、債 券)))		中近東 (中東)		
		エマージング		
資産複合 ()				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券)))

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式および債券に投資を行ないます。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。

為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

ファンドの特色

1.

4つの異なる資産に国際分散投資します。

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

2.

インデックスファンドで構成しています。

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

<国内株式>

「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

<海外株式>

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

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

<国内債券>

「日本債券インデックスマザーファンド」

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

<海外債券>

「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

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

著作権などについて

- ※TOPIX(東証株価指数):TOPIXの指数値およびTOPIXに係る標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利/ノウハウおよびTOPIXに係る標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
- ※MSCI-KOKUSAIインデックス:同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- ※NOMURA-BPI総合:同指数は、野村フィデューシャリーリサーチ&コンサルティング株式会社(以下「NFRIC」)が公表している指数で、その知的財産権はNFRICに帰属します。なお、NFRICは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行なわれる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- ※FTSE世界国債インデックス(除く日本):同指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

3.

株式に60%、債券などに40%投資します。

資産の標準実質組入比率は、株式60%、債券など40%とします。

組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンドへの投資比率を調整することで行ないます。

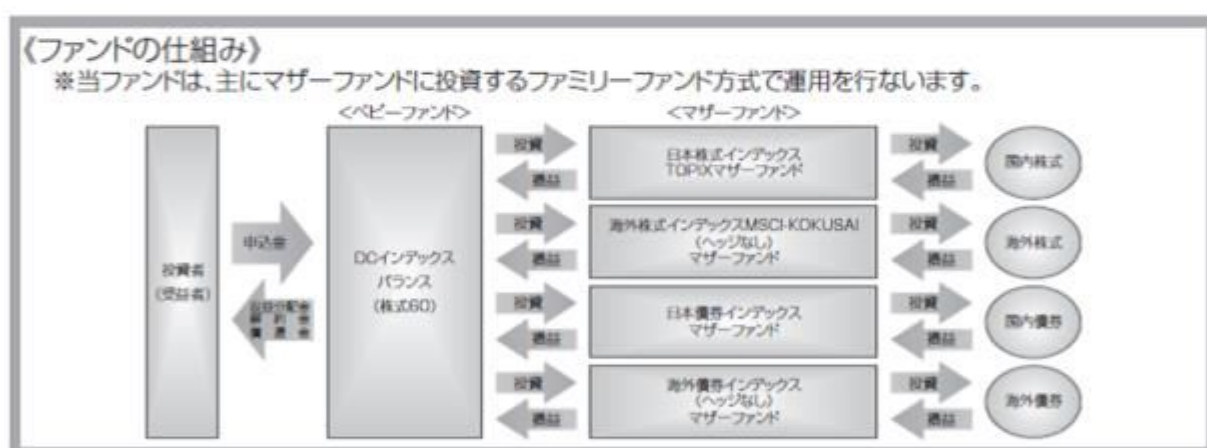
各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

投資対象	基本投資比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	45%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	15%
日本債券インデックスマザーファンド	25%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	10%
短期金融資産	5%

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

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

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



主な投資制限

- ・株式への実質投資割合は、信託財産の総額の70%未満とします。
- ・外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。

分配方針

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

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

信託金限度額

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

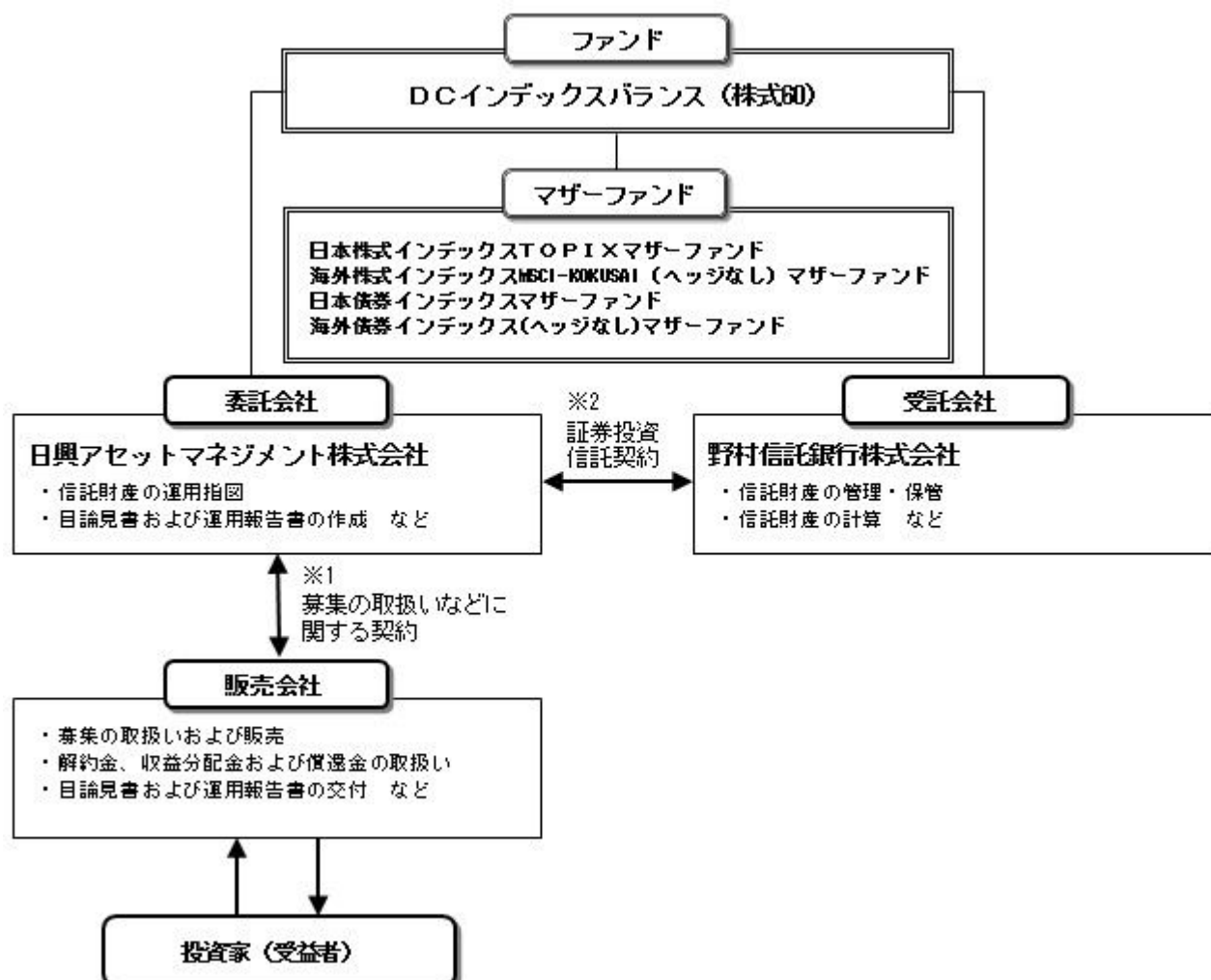
(2) 【ファンドの沿革】

2002年12月10日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したもの。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。

委託会社の概況（2025年5月末現在）

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

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

社名変更後URL：www.amova-am.com

amova
アモーヴァ・アセットマネジメント

3）大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

- ・主として、以下に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。
証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

- 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
- ・純資産総額に対する株式ならびに公社債および短期金融資産の実質組入比率については、次の標準実質組入比率を目処として投資を行ないます。
株式の標準実質組入比率.....60%
公社債および短期金融資産の標準実質組入比率.....40%
 - ・組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないますが、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。
 - ・また、資金動向などによっては組入比率を引き下げることもあります。
 - ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

< D C インデックスバランス（株式60） >

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

- 証券投資信託「日本株式インデックス T O P I X マザーファンド」
- 証券投資信託「海外株式インデックス M S C I - K O K U S A I（ヘッジなし）マザーファンド」
- 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
- 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

- 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)～7)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 11) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12)に定めるものの以外のも
 - 12) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 13) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 - 15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
- 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

次の取引ができます。

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。

- 1) 国債証券
 - 2) 地方債証券
 - 3) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限ります。）
 - 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 6) コマーシャル・ペーパー
 - 7) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
 - 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
 - 9) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 10) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 次の取引ができます。

- 1) 先物取引等

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

その他

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

* 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	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社 2025年9月1日より「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に変更
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2000年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、NOMURA-BPI 総合 [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	・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	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

その他

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

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

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >**運用の基本方針**

基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	・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	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

その他

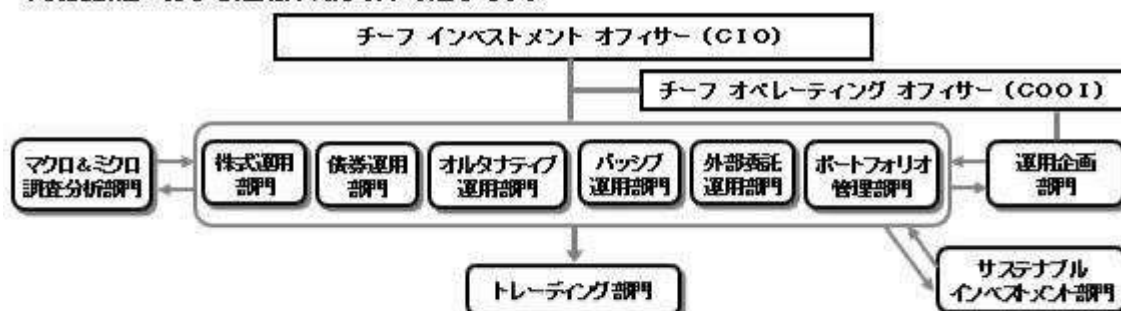
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社 2025年9月1日より「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に変更
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

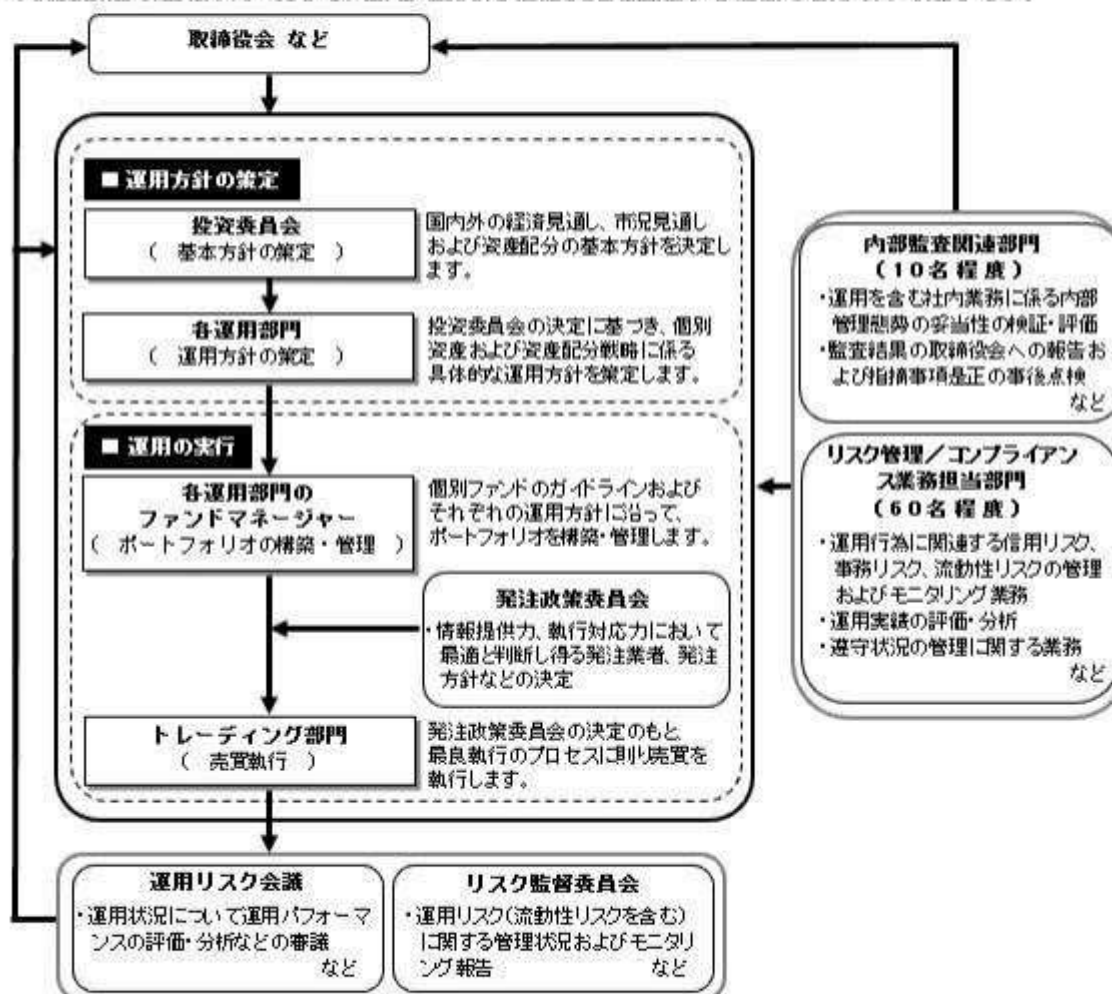
(3) 【運用体制】

< 委託会社における運用体制 >

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



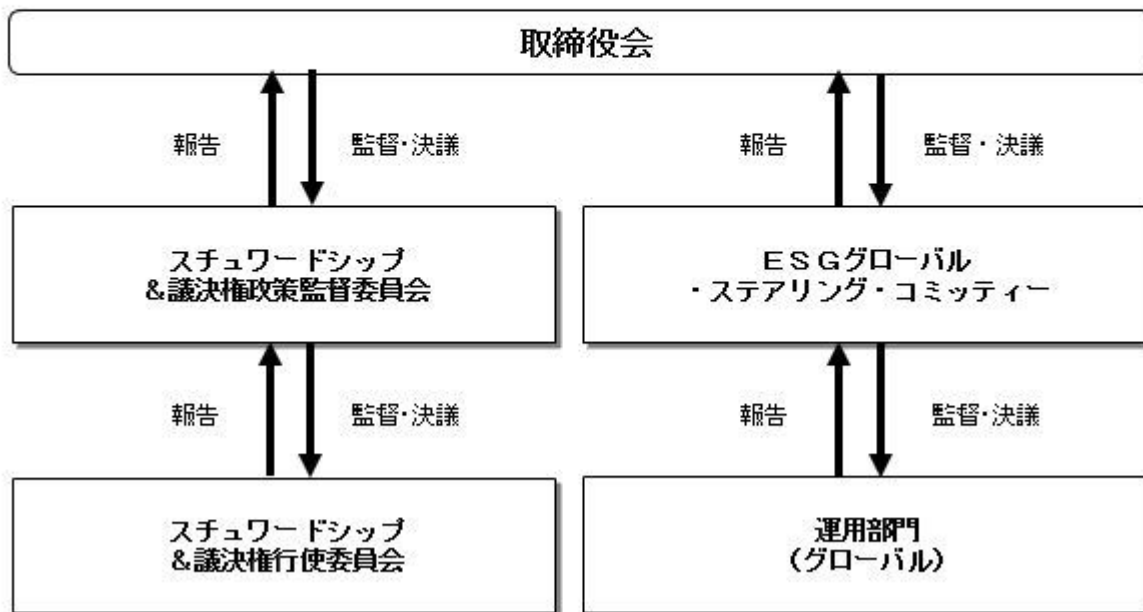
委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG／フィデューシャリー・デューティー

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2025年5月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

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

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

< D C インデックスバランス（株式60） >

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の70%未満とします。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付け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、公社債の借入の指図をすることができます。公社債の借入の指図は、当該借入にかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入れ額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
- イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- 二) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
- ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 16) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 17) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
- <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、金利先渡し取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡し取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうものとします。
- < 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド >
- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡し取引および為替先渡し取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
- ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 16) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

<海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

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

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

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

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

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

流動性リスク

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

信用リスク

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

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

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

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

為替変動リスク

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

< その他の留意事項 >

- ・ システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

- ・ 投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

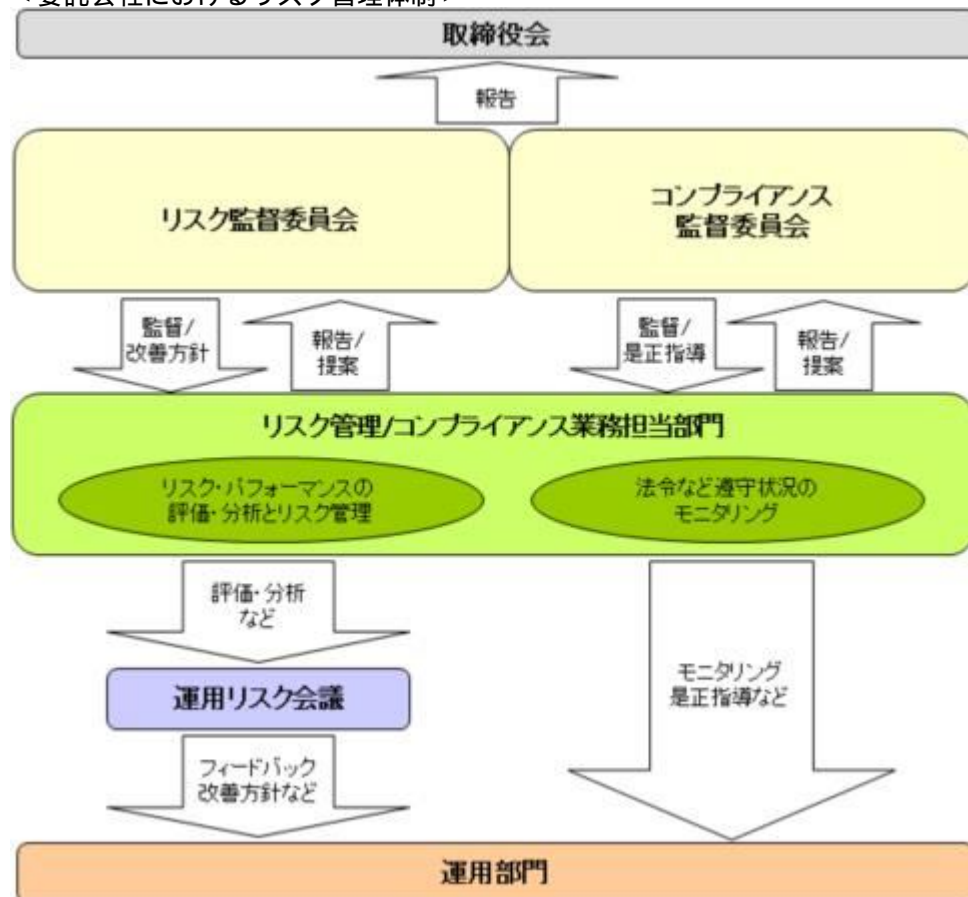
- ・ 解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

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

（２）リスク管理体制

< 委託会社におけるリスク管理体制 >



■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。

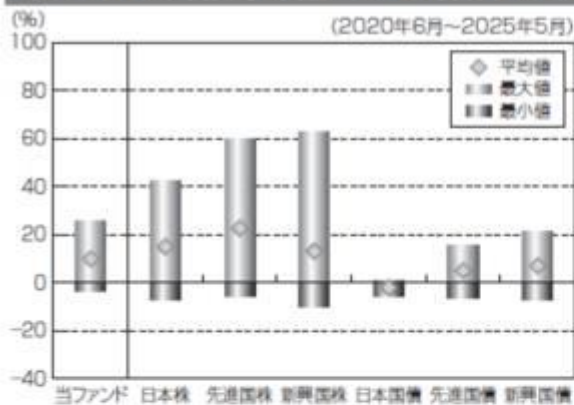
■法令など遵守状況のモニタリング

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2025年5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	9.9%	15.0%	22.7%	13.1%	-2.1%	5.0%	7.0%
最大値	25.8%	42.1%	59.8%	62.7%	0.6%	15.3%	21.5%
最小値	-3.5%	-7.1%	-5.8%	-9.7%	-5.5%	-6.1%	-7.0%

※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6月から2025年5月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

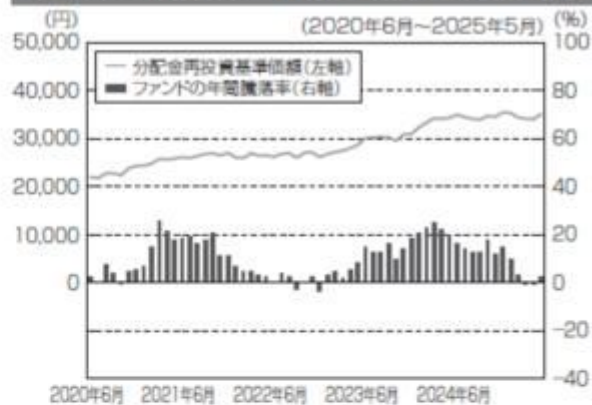
<各資産クラスの指数>

日本株……TOPIX(東証株価指数)配当込み

先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

新興国株……MSCIエマージングマーケットインデックス(配当込み、円ベース)

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
※分配金再投資基準価額は、2020年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計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

日本国債……NOMURA-BPI国債

先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバルディバースファイド(円ヘッジなし、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

TOPIX(東証株価指数)配当込み

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬

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

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

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

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。

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

< 投資対象とするマザーファンドに係る費用 >

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

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

・公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に少額投資非課税制度（NISA）の適用対象となります。

・当ファンドは、NISAの対象ではありません。

確定拠出年金の場合

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

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

確定拠出年金でない場合

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。

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

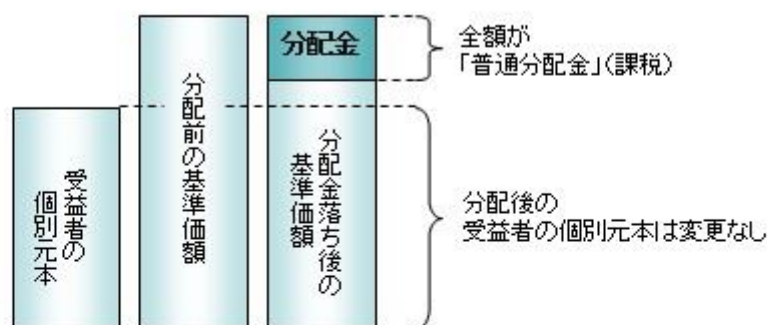
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

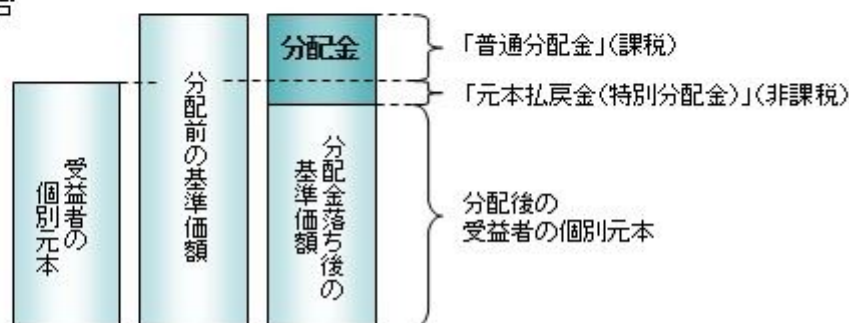
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

上記は2025年8月6日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

(参考情報)ファンドの総経費率

対象期間:2023年11月7日～2024年11月6日

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

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

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

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

5【運用状況】

【DCインデックスバランス(株式60)】

以下の運用状況は2025年 5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	28,981,935,162	95.09
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)	—	1,496,760,116	4.91
合計(純資産総額)		30,478,695,278	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	4,667,161,019	2.8266	13,192,197,337	2.9766	13,892,271,489	45.58
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	5,894,367,469	1.3092	7,717,219,982	1.2686	7,477,594,571	24.53
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	672,994,983	6.8590	4,616,137,610	6.8443	4,606,179,562	15.11
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	1,016,464,744	3.0263	3,076,182,771	2.9572	3,005,889,540	9.86

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.09
合 計	95.09

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額(百万円)	1口当たり純資産額(円)
--	------------	--------------

期別		分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第13計算期間末	(2015年11月 6日)	3,898	3,900	1.9758	1.9768
第14計算期間末	(2016年11月 7日)	3,878	3,880	1.8341	1.8351
第15計算期間末	(2017年11月 6日)	5,724	5,727	2.2197	2.2207
第16計算期間末	(2018年11月 6日)	7,503	7,506	2.1621	2.1631
第17計算期間末	(2019年11月 6日)	9,913	9,917	2.2665	2.2675
第18計算期間末	(2020年11月 6日)	11,841	11,846	2.3048	2.3058
第19計算期間末	(2021年11月 8日)	16,104	16,110	2.7243	2.7253
第20計算期間末	(2022年11月 7日)	18,269	18,275	2.6835	2.6845
第21計算期間末	(2023年11月 6日)	23,400	23,400	3.0481	3.0481
第22計算期間末	(2024年11月 6日)	29,015	29,015	3.4725	3.4725
	2024年 5月末日	27,775	—	3.4297	—
	6月末日	28,507	—	3.4976	—
	7月末日	28,258	—	3.4451	—
	8月末日	28,167	—	3.4073	—
	9月末日	28,212	—	3.3922	—
	10月末日	29,004	—	3.4693	—
	11月末日	29,075	—	3.4514	—
	12月末日	29,985	—	3.5441	—
	2025年 1月末日	30,020	—	3.5336	—
	2月末日	29,314	—	3.4317	—
	3月末日	29,313	—	3.4121	—
	4月末日	29,254	—	3.4019	—
	5月末日	30,478	—	3.5074	—

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	0.0010
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	0.0010
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	0.0010
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	0.0010
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	0.0010
第18期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	0.0010
第19期	2020年11月 7日～2021年11月 8日	0.0010
第20期	2021年11月 9日～2022年11月 7日	0.0010
第21期	2022年11月 8日～2023年11月 6日	0.0000
第22期	2023年11月 7日～2024年11月 6日	0.0000
当中間期	2024年11月 7日～2025年 5月 6日	—

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	9.75
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	7.12

第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	21.08
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	2.55
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	4.87
第18期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	1.73
第19期	2020年11月 7日～2021年11月 8日	18.24
第20期	2021年11月 9日～2022年11月 7日	1.46
第21期	2022年11月 8日～2023年11月 6日	13.59
第22期	2023年11月 7日～2024年11月 6日	13.92
当中間期	2024年11月 7日～2025年 5月 6日	1.03

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第13期	2014年11月 7日～2015年11月 6日	380,095,839	264,656,068
第14期	2015年11月 7日～2016年11月 7日	371,339,540	230,013,327
第15期	2016年11月 8日～2017年11月 6日	878,324,252	413,874,113
第16期	2017年11月 7日～2018年11月 6日	1,237,064,109	345,671,921
第17期	2018年11月 7日～2019年11月 6日	1,312,172,027	408,686,802
第18期	2019年11月 7日～2020年11月 6日	1,522,648,131	758,698,697
第19期	2020年11月 7日～2021年11月 8日	1,520,961,203	747,212,137
第20期	2021年11月 9日～2022年11月 7日	1,560,945,797	664,485,648
第21期	2022年11月 8日～2023年11月 6日	1,566,341,628	697,214,513
第22期	2023年11月 7日～2024年11月 6日	1,565,250,665	886,420,443
当中間期	2024年11月 7日～2025年 5月 6日	728,421,234	440,009,182

（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2025年 5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	63,778,697,670	98.62
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	890,435,392	1.38
合計（純資産総額）		64,669,133,062	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	867,225,000	1.34

(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	852,500	2,692.23	2,295,126,075	2,769.00	2,360,572,500	3.65
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	553,200	2,739.49	1,515,485,868	3,810.00	2,107,692,000	3.26
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	1,013,200	1,577.49	1,598,312,868	2,025.50	2,052,236,600	3.17
日本	株式	日立製作所	電気機器	412,000	3,973.75	1,637,185,000	4,046.00	1,666,952,000	2.58
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	326,100	3,174.76	1,035,289,236	3,700.00	1,206,570,000	1.87
日本	株式	任天堂	その他製品	101,200	8,281.25	838,062,500	11,835.00	1,197,702,000	1.85
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	121,900	9,160.84	1,116,706,396	8,689.00	1,059,189,100	1.64
日本	株式	キーエンス	電気機器	16,000	65,591.89	1,049,470,240	60,740.00	971,840,000	1.50
日本	株式	三菱重工業	機械	283,300	2,096.55	593,952,615	3,352.00	949,621,600	1.47
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	150,800	5,497.31	828,994,348	6,112.00	921,689,600	1.43
日本	株式	三菱商事	卸売業	313,600	2,781.98	872,428,928	2,935.00	920,416,000	1.42
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	114,100	7,467.05	851,990,405	7,740.00	883,134,000	1.37
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	211,100	3,145.34	663,981,274	4,002.00	844,822,200	1.31
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	34,000	23,564.73	801,200,820	23,000.00	782,000,000	1.21
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4,784,200	146.72	701,937,824	160.40	767,385,680	1.19
日本	株式	三井物産	卸売業	243,900	3,120.36	761,055,804	3,029.00	738,773,100	1.14
日本	株式	信越化学工業	化学	142,900	5,491.58	784,746,782	4,641.00	663,198,900	1.03
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	143,100	4,138.89	592,275,159	4,314.00	617,333,400	0.95
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	79,300	8,875.33	703,813,669	7,614.00	603,790,200	0.93
日本	株式	K D D I	情報・通信業	236,600	2,383.22	563,869,852	2,499.00	591,263,400	0.91
日本	株式	第一三共	医薬品	148,800	4,800.57	714,324,816	3,842.00	571,689,600	0.88
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,578,400	189.31	488,128,179	221.40	570,857,760	0.88
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	380,000	1,561.16	593,240,800	1,468.00	557,840,000	0.86
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	11,500	49,651.83	570,996,045	48,350.00	556,025,000	0.86
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	31,100	19,820.74	616,425,014	17,115.00	532,276,500	0.82
日本	株式	富士通	電気機器	149,000	2,951.03	439,703,470	3,318.00	494,382,000	0.76
日本	株式	三菱電機	電気機器	164,700	2,353.06	387,548,982	2,904.00	478,288,800	0.74
日本	株式	日本電気	電気機器	114,500	2,681.32	307,011,140	3,785.00	433,382,500	0.67
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	95,900	4,125.24	395,610,516	4,438.00	425,604,200	0.66
日本	株式	丸紅	卸売業	139,400	2,335.11	325,514,334	2,945.00	410,533,000	0.63

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	0.24
		建設業	2.23
		食料品	3.05
		繊維製品	0.39
		パルプ・紙	0.13
		化学	4.76

	医薬品	4.05
	石油・石炭製品	0.42
	ゴム製品	0.63
	ガラス・土石製品	0.61
	鉄鋼	0.77
	非鉄金属	0.88
	金属製品	0.48
	機械	5.78
	電気機器	17.13
	輸送用機器	7.22
	精密機器	2.02
	その他製品	3.05
	電気・ガス業	1.20
	陸運業	2.34
	海運業	0.65
	空運業	0.36
	倉庫・運輸関連業	0.16
	情報・通信業	7.74
	卸売業	6.90
	小売業	4.74
	銀行業	8.92
	証券、商品先物取引業	0.84
	保険業	3.39
	その他金融業	1.10
	不動産業	1.89
	サービス業	4.47
合 計		98.62

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06月	買建	31	日本円	823,371,850	867,225,000	1.34

(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2025年 5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	321,059,731,646	70.75

	カナダ	15,436,624,408	3.40
	ドイツ	12,360,420,873	2.72
	イタリア	3,141,103,242	0.69
	フランス	12,305,359,754	2.71
	オランダ	7,640,855,539	1.68
	スペイン	3,748,935,544	0.83
	ベルギー	912,292,875	0.20
	オーストリア	249,496,658	0.05
	ルクセンブルク	836,763,651	0.18
	フィンランド	1,263,050,217	0.28
	アイルランド	8,422,521,218	1.86
	ポルトガル	172,453,478	0.04
	イギリス	17,125,969,814	3.77
	スイス	12,845,095,358	2.83
	スウェーデン	3,720,261,330	0.82
	ノルウェー	754,947,918	0.17
	デンマーク	2,785,639,018	0.61
	ケイマン	764,577,076	0.17
	オーストラリア	7,392,990,633	1.63
	バミューダ	390,077,451	0.09
	ニュージーランド	333,434,731	0.07
	香港	1,893,978,228	0.42
	シンガポール	1,495,946,544	0.33
	イスラエル	1,115,168,679	0.25
	ジャージー	571,168,189	0.13
	アラブ首長国連邦	0	0.00
	マン島	36,396,359	0.01
	小計	438,775,260,431	96.69
新株予約権証券	カナダ	0	0.00
投資証券	アメリカ	7,029,099,058	1.55
	フランス	163,321,234	0.04
	イギリス	122,008,211	0.03
	オーストラリア	510,489,699	0.11
	香港	109,910,739	0.02
	シンガポール	92,516,321	0.02
	小計	8,027,345,262	1.77
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	6,984,264,473	1.54
合計（純資産総額）		453,786,870,166	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	5,964,742,297	1.31
	買建	ドイツ	1,036,444,948	0.23

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建	—	5,780,018,240	1.27

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半 導体製造装 置	1,111,010	20,228.12	22,473,645,823	20,025.26	22,248,270,001	4.90
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェ ア・サービ ス	320,424	61,383.57	19,668,770,380	65,990.29	21,144,873,196	4.66
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	682,354	33,238.28	22,680,277,473	28,766.80	19,629,145,482	4.33
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費 財・サービ ス流通・小 売り	429,220	27,125.24	11,642,699,719	29,594.05	12,702,362,004	2.80
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・ 娯楽	98,860	82,650.43	8,170,822,261	92,803.34	9,174,538,538	2.02
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半 導体製造装 置	202,040	24,987.34	5,048,442,497	34,812.22	7,033,461,717	1.55
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自 動車部品	131,065	38,925.46	5,101,766,358	51,567.32	6,758,671,333	1.49
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・ 娯楽	265,200	23,774.51	6,305,002,041	24,725.49	6,557,202,123	1.44
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・ 娯楽	225,780	24,011.90	5,421,407,459	24,883.75	5,618,254,249	1.24
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	127,820	32,077.25	4,100,114,760	38,034.91	4,861,622,439	1.07
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービ ス	60,410	65,742.83	3,971,524,675	72,824.11	4,399,304,884	0.97
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービ ス	78,472	41,555.41	3,260,936,196	52,138.48	4,091,411,430	0.90
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	36,604	128,126.30	4,689,935,302	103,956.14	3,805,210,765	0.84
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・ 娯楽	19,380	109,794.39	2,127,815,288	170,465.80	3,303,627,363	0.73
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービ ス	37,230	73,182.35	2,724,578,998	83,125.20	3,094,751,516	0.68
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	199,659	17,163.69	3,426,885,381	14,774.01	2,949,764,122	0.65
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品 流通・小売 り	20,109	128,914.71	2,592,345,974	145,127.42	2,918,367,365	0.64
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品 流通・小売 り	200,136	11,941.21	2,389,866,005	13,969.77	2,795,855,290	0.62
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・ パーソナル 用品	107,019	24,201.81	2,590,053,654	24,250.72	2,595,288,574	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	109,381	23,134.29	2,530,452,431	22,095.55	2,416,833,858	0.53

アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	44,985	57,287.59	2,577,082,474	52,985.88	2,383,569,915	0.53
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	80,236	27,080.65	2,172,843,041	26,705.14	2,142,714,367	0.47
ドイツ	株式	SAP SE	ソフトウェア・サービス	47,302	36,363.24	1,720,054,295	42,928.94	2,030,625,027	0.45
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	311,629	6,019.52	1,875,857,248	6,364.80	1,983,459,002	0.44
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	17,882	108,414.19	1,938,662,652	108,855.83	1,946,560,041	0.43
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	185,792	9,649.36	1,792,774,060	10,285.26	1,910,920,196	0.42
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	118,760	14,801.50	1,757,826,140	15,314.25	1,818,720,330	0.40
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	70,578	18,811.00	1,327,642,935	25,590.15	1,806,102,094	0.40
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	41,680	80,902.41	3,372,012,745	42,897.71	1,787,976,882	0.39
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	76,093	24,836.27	1,889,866,909	23,436.42	1,783,347,735	0.39

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	3.61
		素材	3.23
		資本財	7.54
		商業・専門サービス	1.63
		運輸	1.42
		自動車・自動車部品	2.01
		耐久消費財・アパレル	1.02
		消費者サービス	1.94
		メディア・娯楽	6.82
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.90
		生活必需品流通・小売り	1.89
		食品・飲料・タバコ	2.99
		家庭用品・パーソナル用品	1.39
		ヘルスケア機器・サービス	3.53
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.28
		銀行	6.26
		金融サービス	7.38
		保険	3.28
		ソフトウェア・サービス	10.41
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.86
		電気通信サービス	1.27
		公益事業	2.71
		半導体・半導体製造装置	9.04

		不動産管理・開発	0.27
新株予約権証券	—	—	—
投資証券	—	—	1.77
合 計			98.46

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 EMINI2506	買建	140	米ドル	39,300,887.5	5,654,218,684	41,459,250	5,964,742,297	1.31
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	DJSTX5 2506	買建	140	ユーロ	6,026,390	985,736,612	6,336,400	1,036,444,948	0.23

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資 比率 （%）
為替予約取引	米ドル	買建	34,800,000.00	5,040,605,370	4,985,112,870	1.10
	加ドル	買建	1,200,000.00	124,897,800	124,884,720	0.03
	ユーロ	買建	4,100,000.00	664,660,569	670,020,650	0.15

(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2025年 5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	48,091,920,610	87.48
地方債証券	日本	2,521,804,392	4.59
特殊債券	日本	1,879,004,000	3.42
社債券	日本	2,280,884,000	4.15
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	199,471,002	0.36
合計（純資産総額）		54,973,084,004	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3 4 4 回利付国債（1 0 年）	700,000,000	99.36	695,527,000	99.27	694,939,000	0.100	2026/9/20	1.26
日本	国債証券	第3 4 5 回利付国債（1 0 年）	660,000,000	99.26	655,162,200	99.08	653,974,200	0.100	2026/12/20	1.19
日本	国債証券	第3 4 7 回利付国債（1 0 年）	630,000,000	99.08	624,204,000	98.69	621,797,400	0.100	2027/6/20	1.13

日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	540,000,000	98.85	533,790,000	98.29	530,814,600	0.100	2027/12/20	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	98.07	529,583,400	0.100	2028/3/20	0.96
日本	国債証券	第368回利付国債（10年）	530,000,000	95.42	505,778,900	93.09	493,424,700	0.200	2032/9/20	0.90
日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	500,000,000	98.97	494,860,000	98.49	492,480,000	0.100	2027/9/20	0.90
日本	国債証券	第363回利付国債（10年）	500,000,000	96.46	482,335,000	94.24	471,235,000	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	93.91	469,565,000	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	97.39	477,226,700	94.85	464,804,200	0.500	2032/12/20	0.85
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	460,000,000	99.18	456,246,400	98.89	454,898,600	0.100	2027/3/20	0.83
日本	国債証券	第372回利付国債（10年）	470,000,000	99.27	466,606,500	96.07	451,543,100	0.800	2033/9/20	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	93.86	450,537,600	0.200	2032/3/20	0.82
日本	国債証券	第377回利付国債（10年）	460,000,000	98.35	452,418,600	97.65	449,217,600	1.200	2034/12/20	0.82
日本	国債証券	第359回利付国債（10年）	470,000,000	97.12	456,509,700	95.49	448,803,000	0.100	2030/6/20	0.82
日本	国債証券	第371回利付国債（10年）	480,000,000	96.57	463,540,800	93.33	448,027,200	0.400	2033/6/20	0.81
日本	国債証券	第357回利付国債（10年）	460,000,000	97.55	448,730,000	96.08	441,977,200	0.100	2029/12/20	0.80
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	460,000,000	96.89	445,712,400	94.89	436,503,200	0.100	2030/12/20	0.79
日本	国債証券	第374回利付国債（10年）	450,000,000	98.85	444,837,200	95.33	429,016,500	0.800	2034/3/20	0.78
日本	国債証券	第375回利付国債（10年）	440,000,000	100.34	441,530,200	97.47	428,881,200	1.100	2034/6/20	0.78
日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	435,000,000	98.56	428,775,150	97.85	425,682,300	0.100	2028/6/20	0.77
日本	国債証券	第365回利付国債（10年）	450,000,000	95.83	431,265,100	93.57	421,087,500	0.100	2031/12/20	0.77
日本	国債証券	第370回利付国債（10年）	440,000,000	97.52	429,091,000	94.47	415,668,000	0.500	2033/3/20	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	94.10	414,066,400	0.600	2033/12/20	0.75
日本	国債証券	第367回利付国債（10年）	440,000,000	95.99	422,393,400	93.50	411,400,000	0.200	2032/6/20	0.75
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	420,000,000	98.39	413,267,400	97.59	409,882,200	0.100	2028/9/20	0.75
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	430,000,000	97.09	417,487,000	95.20	409,381,500	0.100	2030/9/20	0.74
日本	国債証券	第378回利付国債（10年）	410,000,000	100.02	410,104,400	99.14	406,494,500	1.400	2035/3/20	0.74
日本	国債証券	第376回利付国債（10年）	420,000,000	97.03	407,534,000	95.37	400,570,800	0.900	2034/9/20	0.73
日本	国債証券	第150回利付国債（5年）	400,000,000	99.06	396,241,000	98.94	395,764,000	0.005	2026/12/20	0.72

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	87.48
地方債証券	4.59
特殊債券	3.42
社債券	4.15
合 計	99.64

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2025年 5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	71,963,616,607	45.51
	カナダ	3,079,090,999	1.95
	メキシコ	1,212,333,135	0.77
	ドイツ	9,104,132,594	5.76
	イタリア	10,815,998,809	6.84
	フランス	11,655,345,164	7.37
	オランダ	2,074,545,898	1.31
	スペイン	7,222,499,931	4.57
	ベルギー	2,455,328,558	1.55
	オーストリア	1,751,137,492	1.11
	フィンランド	774,051,607	0.49
	アイルランド	752,727,299	0.48
	ポルトガル	957,143,337	0.61
	イギリス	8,709,145,745	5.51
	スウェーデン	296,682,648	0.19
	ノルウェー	253,862,843	0.16
	デンマーク	342,461,268	0.22
	ポーランド	963,918,395	0.61
	オーストラリア	1,883,053,344	1.19
	ニュージーランド	465,586,274	0.29
	シンガポール	638,655,316	0.40
	マレーシア	810,269,835	0.51
	中国	17,879,293,880	11.31
	イスラエル	534,569,600	0.34
小計		156,595,450,578	99.02
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	1,544,021,967	0.98
合計（純資産総額）		158,139,472,545	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	—	128,857,786	0.08
	売建	—	64,711,890	0.04

(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	10,550,000	13,693.94	1,444,710,961	13,807.86	1,456,729,832	1.500	2027/1/31	0.92
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,450,000	14,592.67	1,233,081,169	14,578.07	1,231,847,232	4.625	2027/6/15	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,750,000	14,274.03	963,497,246	14,310.43	965,954,186	3.625	2026/5/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,940,000	12,898.27	895,140,383	13,102.55	909,317,485	1.750	2029/11/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	14,340.06	876,178,253	14,291.16	873,190,377	4.125	2032/11/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,950,000	14,413.40	857,597,309	14,473.82	861,192,620	4.125	2028/7/31	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	14,080.71	844,842,978	14,348.77	860,926,424	4.125	2031/11/30	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,540,000	14,686.24	813,618,228	14,562.33	806,753,324	4.500	2033/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	14,032.86	799,873,388	14,018.04	799,028,587	4.000	2034/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,020,000	12,328.98	742,204,766	12,506.00	752,861,228	1.625	2031/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,901.07	745,053,781	14,617.40	730,870,390	4.625	2035/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,490.11	724,505,582	14,532.82	726,641,332	4.250	2029/2/28	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,418.79	720,939,763	14,456.67	722,833,812	4.375	2026/12/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,099.82	704,991,054	14,194.22	709,711,429	3.250	2027/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,900,000	14,310.56	701,217,532	14,361.70	703,723,675	4.000	2030/7/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,980,000	13,881.75	691,311,515	13,996.96	697,049,028	3.250	2029/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	14,544.35	699,583,265	14,388.12	692,068,677	4.375	2034/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,850,000	14,328.40	694,927,420	14,208.28	689,101,807	4.250	2034/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,750,000	14,411.38	684,540,669	14,465.39	687,106,251	4.125	2029/10/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	14,537.60	683,267,346	14,529.73	682,897,471	4.500	2027/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	13,847.48	670,218,395	14,042.90	679,676,656	1.625	2026/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,480,000	11,957.03	655,245,556	12,119.63	664,156,139	1.375	2031/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,930,000	13,002.52	641,024,463	13,246.71	653,063,057	1.500	2028/11/30	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,370,000	11,931.13	640,702,169	12,159.25	652,952,228	0.875	2030/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	13,385.52	643,843,556	13,558.33	652,156,037	2.375	2029/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,590,000	13,571.81	622,946,455	13,733.95	630,388,749	2.625	2029/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,090,000	11,820.37	601,657,016	12,094.63	615,616,818	0.625	2030/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,450,000	13,017.97	579,299,943	13,329.32	593,154,976	0.375	2027/7/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	13,786.78	579,045,127	13,931.49	585,122,714	2.875	2028/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,450,000	13,025.98	579,656,546	13,075.02	581,838,421	2.750	2032/8/15	0.37

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	99.02
合 計	99.02

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	400,000.00	58,376,000	57,528,240	0.04
	加ドル	買建	100,000.00	10,538,500	10,407,060	0.01
	メキシコペソ	買建	985,000.00	7,417,050	7,328,892	0.00
	ユーロ	買建	266,000.00	43,643,152	43,502,677	0.03
	英ポンド	買建	52,000.00	10,198,947	10,090,917	0.01
	米ドル	売建	450,000.00	64,620,000	64,711,890	0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

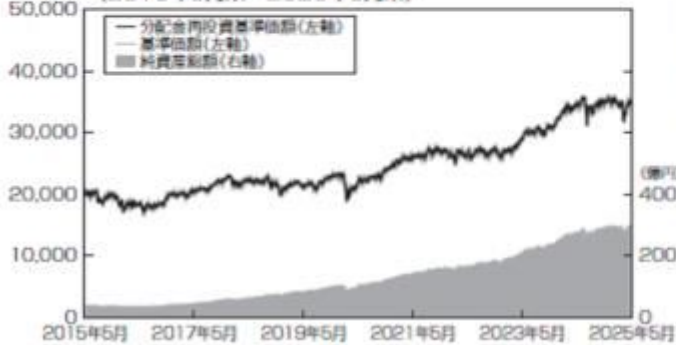
参考情報

運用実績

2025年5月30日現在

基準価額・純資産の推移

(2015年5月末～2025年5月末)



基準価額……………35,074円

純資産総額……………304.78億円

※基準価額は、運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
 ※分配金再投資基準価額は、2015年5月末の基準価額を起点として算出しています。
 ※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

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

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比 率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	45.58%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	15.11%
日本債券インデックスマザーファンド	24.53%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	9.86%
現金その他	4.91%

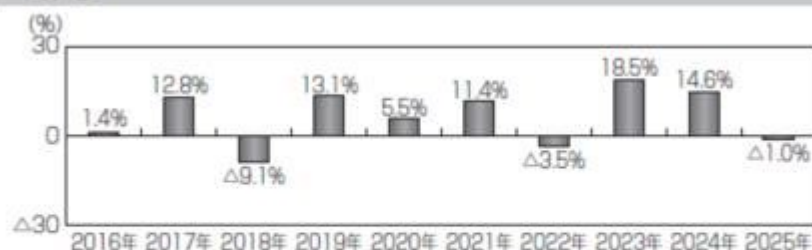
※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産	銘柄		業 種	比 率	
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.65%	
	2	ソニーグループ	電気機器	3.26%	
	3	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	3.17%	
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	1	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	4.90%	
	2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.66%	
	3	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.33%	
組入資産	銘柄		種 類	償還期限	比 率
日本債券インデックス マザーファンド	1	第344回利付国債(10年)	国債証券	2026/9/20	1.26%
	2	第345回利付国債(10年)	国債証券	2026/12/20	1.19%
	3	第347回利付国債(10年)	国債証券	2027/6/20	1.13%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	1	US TREASURY N/B (クーポン1.500%)	国債証券	2027/1/31	0.92%
	2	US TREASURY N/B (クーポン4.625%)	国債証券	2027/6/15	0.78%
	3	US TREASURY N/B (クーポン3.625%)	国債証券	2026/5/15	0.61%

※各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2025年は、2025年5月末までの騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

- ・確定拠出年金制度の規定に従い、販売会社所定の方法でお申し込みください。
- ・当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて取得の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関に限るものとします。

(2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(3) 取扱時間

原則として、午後3時30分までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。

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

- (4) 申込金額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。
- (5) 申込単位
1円以上1円単位
- (6) 申込代金の支払い
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
- (7) 受付の中止および取消

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。

2【換金（解約）手続等】

< 解約請求による換金 >

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

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

2025年9月1日より「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に変更

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

2025年9月1日よりwww.amova-am.comに変更

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

- (5) 手取額
1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。
上記の手取額は、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関の場合を記載しています。
税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、課税上の取扱いが変更になる場合があります。
- (6) 解約単位
1口単位
販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。
- (7) 解約代金の支払い
原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。
- (8) 受付の中止および取消
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

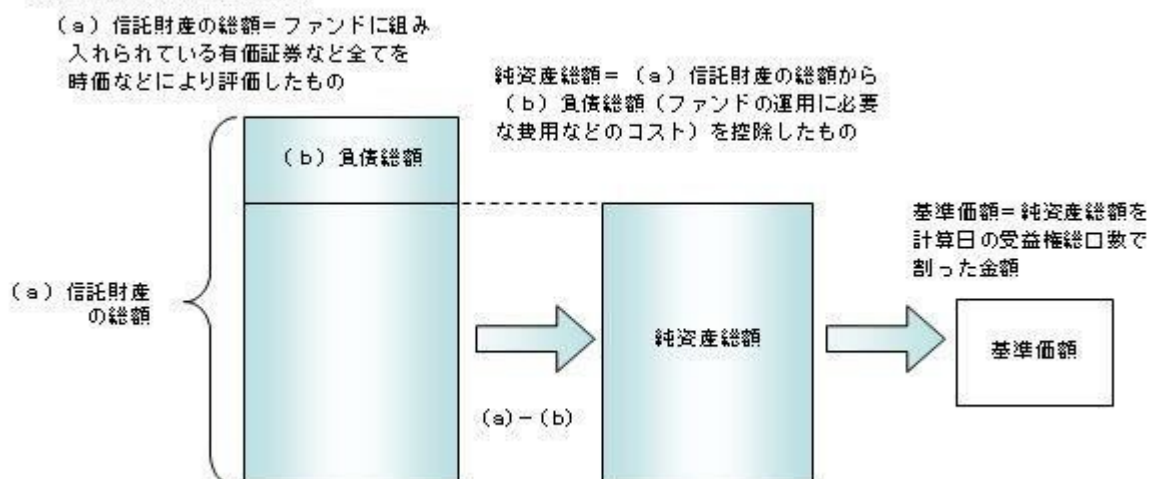
3【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日^{*}における以下のいずれかの価額で評価します。

- ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- ・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
- ・価格情報会社の提供する価額

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

^{*} 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

2025年9月1日より「アモーヴァ・アセットマネジメント株式会社」に変更

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

2025年9月1日よりwww.amova-am.comに変更

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

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

(5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させること

ができます。

イ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ロ) やむを得ない事情が発生したとき

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

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

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

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

ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

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

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

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

償還金について

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

・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

信託約款の変更

1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

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

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

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

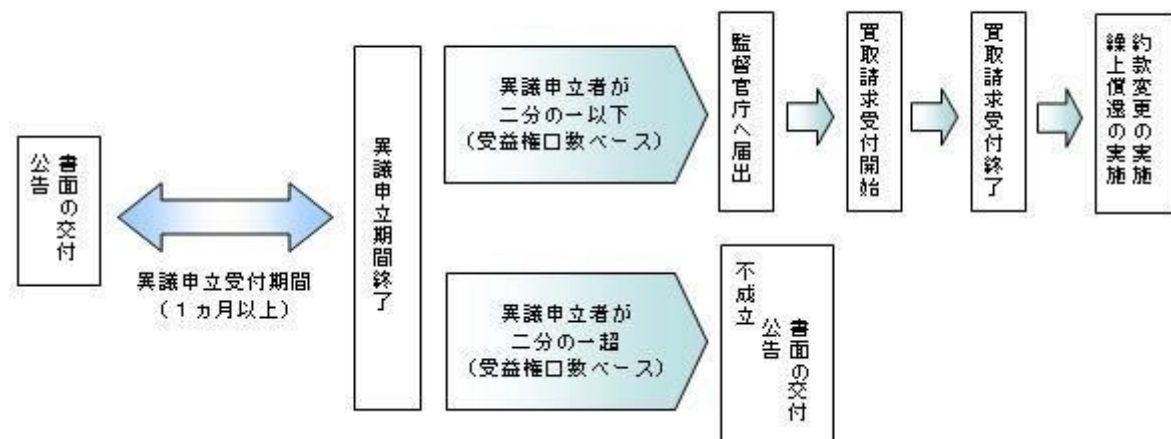
異議の申立て

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

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

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

＜繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ＞



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

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

・ 交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して提供されます。

・ 法令で定められた所要の要件¹を満たすことにより、交付運用報告書は電磁的方法²により提供されます。ただし、受益者から交付請求があった場合には、書面にて交付します。

1 あらかじめ、受益者からの承諾の取得または受益者への告知を行いません。

2 販売会社が受益者のために開設している取引専用ページ内で提供する方法やメールにて送信する方法などがあります。詳しくは、販売会社へお問い合わせください。

・ 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、受益者から交付請求があった場合には、書面にて交付します。

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

関係法人との契約について

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

1【財務諸表】

【ＤＣインデックスバランス（株式６０）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第21期 2023年11月 6日現在	第22期 2024年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,176,991,175	1,469,406,094
親投資信託受益証券	22,255,282,664	27,591,666,415
未収入金	5,314,063	15,697,222
未収利息	-	9,409
流動資産合計	23,437,587,902	29,076,779,140
資産合計	23,437,587,902	29,076,779,140
負債の部		
流動負債		
未払解約金	19,092,229	38,915,190
未払受託者報酬	2,444,765	3,085,074
未払委託者報酬	14,668,981	18,510,838
未払利息	217	-
その他未払費用	488,901	616,968
流動負債合計	36,695,093	61,128,070
負債合計	36,695,093	61,128,070
純資産の部		
元本等		
元本	7,677,089,236	8,355,919,458
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	15,723,803,573	20,659,731,612
（分配準備積立金）	5,165,483,253	7,747,873,233
元本等合計	23,400,892,809	29,015,651,070
純資産合計	23,400,892,809	29,015,651,070
負債純資産合計	23,437,587,902	29,076,779,140

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第21期 自 2022年11月 8日 至 2023年11月 6日	第22期 自 2023年11月 7日 至 2024年11月 6日
営業収益		
受取利息	-	1,298,868
有価証券売買等損益	2,714,560,661	3,389,523,577
営業収益合計	2,714,560,661	3,390,822,445
営業費用		
支払利息	376,317	25,592
受託者報酬	4,537,775	5,881,333
委託者報酬	27,227,383	35,288,766
その他費用	908,696	1,176,186
営業費用合計	33,050,171	42,371,877
営業利益又は営業損失（ ）	2,681,510,490	3,348,450,568
経常利益又は経常損失（ ）	2,681,510,490	3,348,450,568
当期純利益又は当期純損失（ ）	2,681,510,490	3,348,450,568
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（ ）	119,568,833	225,087,645
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	11,461,185,106	15,723,803,573
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,880,496,181	3,646,030,673
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	2,880,496,181	3,646,030,673
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,179,819,371	1,833,465,557
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,179,819,371	1,833,465,557
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（ ）	15,723,803,573	20,659,731,612

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	第21期 2023年11月 6日現在	第22期 2024年11月 6日現在
1. 期首元本額	6,807,962,121円	7,677,089,236円
期中追加設定元本額	1,566,341,628円	1,565,250,665円
期中一部解約元本額	697,214,513円	886,420,443円
2. 受益権の総数	7,677,089,236口	8,355,919,458口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第21期 自 2022年11月 8日 至 2023年11月 6日		第22期 自 2023年11月 7日 至 2024年11月 6日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	380,494,349円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	475,360,748円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	1,771,582,752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	2,648,002,175円
C 信託約款に定める収益調整金	10,558,320,320円	C 信託約款に定める収益調整金	12,911,858,379円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	3,013,406,152円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	4,624,510,310円
E 分配対象収益（A+B+C+D）	15,723,803,573円	E 分配対象収益（A+B+C+D）	20,659,731,612円
F 分配対象収益(1万口当たり)	20,481円	F 分配対象収益(1万口当たり)	24,724円
G 分配金額	0円	G 分配金額	0円
H 分配金額(1万口当たり)	0円	H 分配金額(1万口当たり)	0円

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

第21期（2023年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,617,580,374
合計	2,617,580,374

第22期（2024年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	3,150,231,729
合計	3,150,231,729

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

第21期 2023年11月 6日現在	第22期 2024年11月 6日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.0481円 (30,481円)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.4725円 (34,725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	647,947,867	4,469,414,796	
	日本債券インデックスマザーファンド	5,406,430,000	7,109,455,450	
	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	955,585,847	2,902,592,010	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	4,607,508,315	13,110,204,159	
合計		11,617,472,029	27,591,666,415	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

（参考）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
---------------	---------------

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

		2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
1.	期首	2022年11月 8日	2023年11月 7日
	期首元本額	22,926,701,557円	22,068,149,455円
	期首からの追加設定元本額	1,858,025,433円	2,870,263,745円
	期首からの一部解約元本額	2,716,577,535円	2,958,944,835円
	元本の内訳		
	ＤＣインデックスバランス（株式２０）	755,738,246円	728,847,667円
	ＤＣインデックスバランス（株式４０）	2,089,899,653円	2,052,607,854円
	ＤＣインデックスバランス（株式６０）	4,435,189,354円	4,607,508,315円
	ＤＣインデックスバランス（株式８０）	5,263,753,438円	5,933,248,779円
	インデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）	1,836,216,644円	1,946,857,824円
	世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,697,793,534円	2,251,785,274円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	493,098,615円	433,981,686円

		2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	1,080,203円	2,577,917円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	580,812円	1,402,475円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	323,980円	592,331円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,753,076,468円	1,382,191,474円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	209,312,833円	180,906,001円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	606,085,095円	565,181,303円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	961,417,051円	928,199,296円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	964,583,529円	963,580,169円
	計	22,068,149,455円	21,979,468,365円
2.	受益権の総数	22,068,149,455口	21,979,468,365口
3.	担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	736,825,000円	734,851,500円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

（2023年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（2024年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（2023年11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	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	615,933,900	-	637,470,000	21,536,100
合計		615,933,900	-	637,470,000	21,536,100

（2024年11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等	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	726,335,800	-	736,020,000	9,684,200
合計		726,335,800	-	736,020,000	9,684,200

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2023年11月 6日現在		2024年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	2.4153円	1口当たり純資産額	2.8454円
(1万口当たり純資産額)	(24,153円)	(1万口当たり純資産額)	(28,454円)

附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1)株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	

極洋	900	4,035.00	3,631,500	
ニッスイ	22,200	913.40	20,277,480	
マルハニチロ	3,300	2,922.00	9,642,600	
雪国まいたけ	1,900	1,039.00	1,974,100	
カネコ種苗	700	1,381.00	966,700	
サカタのタネ	2,500	3,480.00	8,700,000	
ホクト	2,000	1,815.00	3,630,000	
ホクリヨウ	100	1,044.00	104,400	
住石ホールディングス	2,500	1,069.00	2,672,500	
日鉄鉱業	900	4,445.00	4,000,500	
I N P E X	67,300	2,020.00	135,946,000	
石油資源開発	12,200	1,135.00	13,847,000	
K & O エナジーグループ	1,000	3,090.00	3,090,000	
ショーボンドホールディングス	2,900	5,324.00	15,439,600	
ミライト・ワン	7,300	2,222.00	16,220,600	
タマホーム	1,400	3,800.00	5,320,000	
日本アクア	200	805.00	161,000	
キャンディル	100	531.00	53,100	
ダイセキ環境ソリューション	100	1,195.00	119,500	
第一カッター興業	600	1,492.00	895,200	
安藤・間	12,900	1,125.00	14,512,500	
東急建設	7,000	690.00	4,830,000	
コムシスホールディングス	7,900	3,149.00	24,877,100	
ビーアールホールディングス	3,300	346.00	1,141,800	
高松コンストラクショングループ	1,700	2,895.00	4,921,500	
東建コーポレーション	600	10,600.00	6,360,000	
ヤマウラ	1,100	1,200.00	1,320,000	
オリエンタル白石	8,200	379.00	3,107,800	
大成建設	14,100	6,485.00	91,438,500	
大林組	51,400	1,905.00	97,917,000	
清水建設	44,200	989.10	43,718,220	
長谷工コーポレーション	14,300	1,833.00	26,211,900	
松井建設	1,500	823.00	1,234,500	
鹿島建設	34,500	2,660.00	91,770,000	
不動テトラ	1,000	2,062.00	2,062,000	
鉄建建設	1,000	2,382.00	2,382,000	
西松建設	2,500	5,104.00	12,760,000	
三井住友建設	12,500	388.00	4,850,000	
大豊建設	400	3,450.00	1,380,000	
奥村組	2,800	4,305.00	12,054,000	
東鉄工業	1,700	3,210.00	5,457,000	
イチケン	100	2,521.00	252,100	

浅沼組	6,200	658.00	4,079,600	
戸田建設	19,100	929.90	17,761,090	
熊谷組	2,600	3,485.00	9,061,000	
植木組	100	1,500.00	150,000	
矢作建設工業	2,100	1,533.00	3,219,300	
ピーエス・コンストラクション	1,100	986.00	1,084,600	
日本ハウスホールディングス	3,300	322.00	1,062,600	
新日本建設	2,200	1,555.00	3,421,000	
東亜道路工業	2,700	1,261.00	3,404,700	
日本道路	1,600	1,635.00	2,616,000	
東亜建設工業	4,700	963.00	4,526,100	
日本国土開発	4,400	518.00	2,279,200	
若築建設	500	3,565.00	1,782,500	
東洋建設	4,500	1,313.00	5,908,500	
五洋建設	20,400	636.10	12,976,440	
世紀東急工業	2,200	1,497.00	3,293,400	
福田組	600	5,570.00	3,342,000	
住友林業	13,500	5,658.00	76,383,000	
巴コーポレーション	400	864.00	345,600	
大和ハウス工業	47,000	4,566.00	214,602,000	
ライト工業	3,200	2,195.00	7,024,000	
積水ハウス	47,200	3,667.00	173,082,400	
日特建設	1,500	1,024.00	1,536,000	
北陸電気工事	1,100	1,106.00	1,216,600	
ユアテック	3,000	1,455.00	4,365,000	
日本リーテック	1,200	1,077.00	1,292,400	
四電工	2,000	1,470.00	2,940,000	
中電工	2,400	3,400.00	8,160,000	
関電工	8,500	2,163.00	18,385,500	
きんでん	10,800	3,056.00	33,004,800	
東京エネシス	1,600	1,069.00	1,710,400	
トーエネック	2,600	927.00	2,410,200	
住友電設	1,300	4,775.00	6,207,500	
日本電設工業	2,900	1,837.00	5,327,300	
エクシオグループ	16,500	1,545.50	25,500,750	
新日本空調	1,000	3,505.00	3,505,000	
九電工	3,400	5,526.00	18,788,400	
三機工業	3,200	2,411.00	7,715,200	
日揮ホールディングス	15,400	1,365.50	21,028,700	
中外炉工業	500	2,888.00	1,444,000	
ヤマト	300	960.00	288,000	
太平電業	1,000	5,080.00	5,080,000	

高砂熱学工業	3,700	5,413.00	20,028,100	
朝日工業社	1,400	1,324.00	1,853,600	
明星工業	2,700	1,334.00	3,601,800	
大気社	2,000	4,910.00	9,820,000	
ダイダン	2,000	3,265.00	6,530,000	
日比谷総合設備	1,300	3,560.00	4,628,000	
飛島ホールディングス	1,600	1,517.00	2,427,200	
テスホールディングス	3,400	270.00	918,000	
インフロニア・ホールディングス	16,300	1,137.50	18,541,250	
東洋エンジニアリング	2,300	752.00	1,729,600	
レイズネクスト	2,200	1,565.00	3,443,000	
ニッポン	5,200	2,166.00	11,263,200	
日清製粉グループ本社	16,300	1,810.50	29,511,150	
日東富士製粉	300	6,770.00	2,031,000	
昭和産業	1,300	2,825.00	3,672,500	
中部飼料	2,200	1,361.00	2,994,200	
フィード・ワン	2,300	850.00	1,955,000	
東洋精糖	100	1,372.00	137,200	
日本甜菜製糖	800	2,512.00	2,009,600	
D M三井製糖ホールディングス	1,500	3,195.00	4,792,500	
塩水港精糖	500	274.00	137,000	
ウェルネオシュガー	900	2,226.00	2,003,400	
森永製菓	6,500	2,771.00	18,011,500	
中村屋	400	3,255.00	1,302,000	
江崎グリコ	4,500	4,391.00	19,759,500	
名糖産業	700	1,822.00	1,275,400	
井村屋グループ	900	2,427.00	2,184,300	
不二家	1,100	2,658.00	2,923,800	
山崎製パン	10,500	2,924.50	30,707,250	
モロゾフ	500	4,640.00	2,320,000	
亀田製菓	1,000	4,340.00	4,340,000	
寿スピリッツ	9,200	2,049.50	18,855,400	
カルビー	7,200	3,198.00	23,025,600	
森永乳業	6,000	3,393.00	20,358,000	
六甲バター	1,100	1,423.00	1,565,300	
ヤクルト本社	22,400	3,290.00	73,696,000	
明治ホールディングス	20,900	3,483.00	72,794,700	
雪印メグミルク	4,200	2,566.00	10,777,200	
プリマハム	2,100	2,207.00	4,634,700	
日本ハム	6,700	4,760.00	31,892,000	
林兼産業	200	461.00	92,200	
丸大食品	1,600	1,653.00	2,644,800	

S Foods	1,700	2,752.00	4,678,400	
柿安本店	600	2,670.00	1,602,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	2,400	3,770.00	9,048,000	
サッポロホールディングス	5,100	7,131.00	36,368,100	
アサヒグループホールディングス	117,400	1,793.00	210,498,200	
キリンホールディングス	65,100	2,199.00	143,154,900	
シマダヤ	600	1,439.00	863,400	
宝ホールディングス	10,500	1,197.50	12,573,750	
オエノンホールディングス	5,000	418.00	2,090,000	
養命酒製造	500	2,496.00	1,248,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,000	1,943.00	21,373,000	
ライフドリンク カンパニー	3,400	1,789.00	6,082,600	
サントリー食品インターナショナル	11,000	5,064.00	55,704,000	
ダイドーグループホールディングス	1,800	3,070.00	5,526,000	
伊藤園	5,200	3,311.00	17,217,200	
キーコーヒー	1,700	2,013.00	3,422,100	
ユニカフェ	100	935.00	93,500	
日清オイリオグループ	2,200	5,060.00	11,132,000	
不二製油グループ本社	3,100	3,145.00	9,749,500	
J - オイルミルズ	1,800	2,064.00	3,715,200	
キッコーマン	51,800	1,802.50	93,369,500	
味の素	36,700	5,839.00	214,291,300	
ブルドックソース	800	1,803.00	1,442,400	
キューピー	8,400	3,547.00	29,794,800	
ハウス食品グループ本社	5,300	2,887.50	15,303,750	
カゴメ	6,700	3,020.00	20,234,000	
アリアケジャパン	1,600	5,190.00	8,304,000	
エバラ食品工業	400	2,980.00	1,192,000	
ニチレイ	6,400	4,156.00	26,598,400	
東洋水産	7,200	8,906.00	64,123,200	
イートアンドホールディングス	800	2,136.00	1,708,800	
大冷	100	1,897.00	189,700	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	900	1,368.00	1,231,200	
日清食品ホールディングス	20,200	4,023.00	81,264,600	
フジッコ	1,600	1,727.00	2,763,200	
ロック・フィールド	1,900	1,451.00	2,756,900	
日本たばこ産業	95,000	4,123.00	391,685,000	
ケンコーマヨネーズ	1,000	2,184.00	2,184,000	
わらべや日洋ホールディングス	1,000	2,023.00	2,023,000	
なとり	1,000	2,120.00	2,120,000	
イフジ産業	100	1,545.00	154,500	
ファーマフーズ	2,100	985.00	2,068,500	

ユーグレナ	9,800	408.00	3,998,400	
紀文食品	1,400	1,096.00	1,534,400	
ピクルスホールディングス	900	1,059.00	953,100	
理研ビタミン	1,300	2,678.00	3,481,400	
片倉工業	1,500	2,015.00	3,022,500	
ゲンゼ	1,100	5,060.00	5,566,000	
東洋紡	6,900	973.00	6,713,700	
ユニチカ	5,400	289.00	1,560,600	
富士紡ホールディングス	600	4,780.00	2,868,000	
倉敷紡績	1,100	4,675.00	5,142,500	
シキボウ	1,200	1,005.00	1,206,000	
日本毛織	4,100	1,275.00	5,227,500	
ダイドーリミテッド	400	855.00	342,000	
帝国繊維	1,800	2,672.00	4,809,600	
帝人	15,300	1,371.00	20,976,300	
東レ	116,300	845.50	98,331,650	
住江織物	100	2,061.00	206,100	
セーレン	3,100	2,583.00	8,007,300	
小松マテーレ	2,300	782.00	1,798,600	
ワコールホールディングス	3,300	4,621.00	15,249,300	
ホギメディカル	2,100	4,600.00	9,660,000	
クラウドシアホールディングス	300	331.00	99,300	
T S I ホールディングス	5,300	882.00	4,674,600	
マツオカコーポレーション	100	1,800.00	180,000	
ワールド	2,500	1,903.00	4,757,500	
三陽商会	800	2,599.00	2,079,200	
オンワードホールディングス	10,400	520.00	5,408,000	
ルックホールディングス	500	2,530.00	1,265,000	
ゴールドウイン	2,800	7,829.00	21,921,200	
デサント	2,700	4,330.00	11,691,000	
特種東海製紙	800	3,695.00	2,956,000	
王子ホールディングス	60,200	572.50	34,464,500	
日本製紙	8,200	891.00	7,306,200	
三菱製紙	400	491.00	196,400	
北越コーポレーション	8,900	1,542.00	13,723,800	
中越パルプ工業	100	1,232.00	123,200	
大王製紙	8,000	869.00	6,952,000	
レンゴー	14,400	889.00	12,801,600	
トーモク	900	2,286.00	2,057,400	
ザ・パックス	1,200	3,740.00	4,488,000	
北の達人コーポレーション	6,700	158.00	1,058,600	
クラレ	23,200	2,092.00	48,534,400	

旭化成	107,600	1,117.50	120,243,000	
レゾナック・ホールディングス	14,300	3,698.00	52,881,400	
住友化学	128,000	399.50	51,136,000	
住友精化	700	5,090.00	3,563,000	
日産化学	8,200	5,287.00	43,353,400	
ラサ工業	600	2,756.00	1,653,600	
クレハ	3,300	2,823.00	9,315,900	
多木化学	600	3,655.00	2,193,000	
テイカ	1,100	1,619.00	1,780,900	
石原産業	2,600	1,498.00	3,894,800	
日本曹達	3,400	2,530.00	8,602,000	
東ソー	21,200	2,083.00	44,159,600	
トクヤマ	5,100	2,737.00	13,958,700	
セントラル硝子	2,000	3,460.00	6,920,000	
東亜合成	7,600	1,535.00	11,666,000	
大阪ソーダ	5,600	1,647.00	9,223,200	
関東電化工業	3,400	986.00	3,352,400	
デンカ	5,800	2,170.50	12,588,900	
信越化学工業	142,600	5,866.00	836,491,600	代用有価証券 24,000株
日本カーバイド工業	900	1,652.00	1,486,800	
堺化学工業	1,100	2,816.00	3,097,600	
第一稀元素化学工業	1,800	746.00	1,342,800	
エア・ウォーター	15,000	1,897.00	28,455,000	
日本酸素ホールディングス	15,400	5,046.00	77,708,400	
日本化学工業	600	2,611.00	1,566,600	
東邦アセチレン	400	346.00	138,400	
日本パーカラライジング	7,100	1,301.00	9,237,100	
高压ガス工業	2,300	904.00	2,079,200	
四国化成ホールディングス	1,800	2,170.00	3,906,000	
戸田工業	400	1,711.00	684,400	
ステラ ケミファ	900	4,410.00	3,969,000	
保土谷化学工業	500	4,370.00	2,185,000	
日本触媒	10,200	1,692.50	17,263,500	
大日精化工業	1,100	2,931.00	3,224,100	
カネカ	3,900	3,708.00	14,461,200	
三菱瓦斯化学	12,900	2,667.50	34,410,750	
三井化学	14,300	3,591.00	51,351,300	
東京応化工業	7,600	3,619.00	27,504,400	
大阪有機化学工業	1,300	2,967.00	3,857,100	
三菱ケミカルグループ	116,300	848.80	98,715,440	
KHネオケム	2,900	2,079.00	6,029,100	
ダイセル	18,100	1,371.50	24,824,150	

住友ベークライト	5,000	4,016.00	20,080,000	
積水化学工業	31,700	2,325.00	73,702,500	
日本ゼオン	12,200	1,453.50	17,732,700	
アイカ工業	4,000	3,370.00	13,480,000	
U B E	8,200	2,509.00	20,573,800	
積水樹脂	2,200	2,273.00	5,000,600	
旭有機材	1,100	4,195.00	4,614,500	
ニチバン	1,000	1,922.00	1,922,000	
リケンテクノス	3,000	1,058.00	3,174,000	
大倉工業	700	2,721.00	1,904,700	
積水化成成品工業	2,600	367.00	954,200	
群栄化学工業	400	2,777.00	1,110,800	
タイガースポリマー	200	724.00	144,800	
ダイキョーニシカワ	3,500	636.00	2,226,000	
森六ホールディングス	900	2,311.00	2,079,900	
恵和	1,000	1,032.00	1,032,000	
日本化薬	11,100	1,195.50	13,270,050	
カーリット	1,600	1,312.00	2,099,200	
日本精化	1,100	2,417.00	2,658,700	
扶桑化学工業	1,500	3,625.00	5,437,500	
トリケミカル研究所	1,700	3,060.00	5,202,000	
A D E K A	5,500	2,793.00	15,361,500	
日油	18,700	2,544.00	47,572,800	
ハリマ化成グループ	1,200	874.00	1,048,800	
花王	38,700	6,511.00	251,975,700	
第一工業製薬	600	3,765.00	2,259,000	
石原ケミカル	700	2,259.00	1,581,300	
三洋化成工業	1,000	4,125.00	4,125,000	
大日本塗料	1,800	1,015.00	1,827,000	
日本ペイントホールディングス	70,400	1,106.50	77,897,600	
関西ペイント	13,300	2,425.00	32,252,500	
中国塗料	3,600	2,535.00	9,126,000	
日本特殊塗料	300	1,172.00	351,600	
藤倉化成	2,000	486.00	972,000	
太陽ホールディングス	2,800	4,060.00	11,368,000	
D I C	5,600	3,253.00	18,216,800	
サカタインクス	3,500	1,553.00	5,435,500	
a r t i e n c e	2,800	3,685.00	10,318,000	
富士フイルムホールディングス	96,000	3,637.00	349,152,000	
資生堂	33,300	3,118.00	103,829,400	
ライオン	20,300	1,655.50	33,606,650	
高砂香料工業	1,100	5,020.00	5,522,000	

マンダム	3,200	1,225.00	3,920,000	
ミルボン	2,600	3,185.00	8,281,000	
ファンケル	3,800	2,792.00	10,609,600	
コーセー	3,200	7,998.00	25,593,600	
コタ	1,600	1,636.00	2,617,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	8,200	1,463.00	11,996,600	
ノエビアホールディングス	1,400	5,080.00	7,112,000	
新日本製薬	900	1,715.00	1,543,500	
I - n e	500	2,057.00	1,028,500	
アクシージア	1,300	580.00	754,000	
エステー	1,300	1,479.00	1,922,700	
アグロ カネショウ	700	1,320.00	924,000	
コニシ	5,000	1,348.00	6,740,000	
長谷川香料	3,000	3,320.00	9,960,000	
小林製薬	4,200	5,572.00	23,402,400	
荒川化学工業	1,500	1,190.00	1,785,000	
メック	1,300	3,530.00	4,589,000	
日本高純度化学	400	3,175.00	1,270,000	
タカラバイオ	5,000	1,030.00	5,150,000	
J C U	1,800	3,495.00	6,291,000	
O A T アグリオ	700	1,848.00	1,293,600	
デクセリアルズ	13,900	2,470.00	34,333,000	
アース製薬	1,400	5,190.00	7,266,000	
北興化学工業	1,400	1,284.00	1,797,600	
大成ラミック	500	2,561.00	1,280,500	
クミアイ化学工業	6,300	817.00	5,147,100	
日本農薬	2,400	662.00	1,588,800	
アキレス	900	1,514.00	1,362,600	
有沢製作所	2,400	1,396.00	3,350,400	
日東電工	50,400	2,580.50	130,057,200	
レック	2,000	1,297.00	2,594,000	
三光合成	2,000	607.00	1,214,000	
Z A C R O S	1,300	4,270.00	5,551,000	
前澤化成工業	1,100	1,806.00	1,986,600	
未来工業	600	3,615.00	2,169,000	
J S P	1,300	1,943.00	2,525,900	
エフピコ	3,500	2,632.00	9,212,000	
天馬	1,300	2,849.00	3,703,700	
信越ポリマー	3,400	1,652.00	5,616,800	
東リ	800	462.00	369,600	
ニフコ	5,900	3,650.00	21,535,000	
バルカー	1,200	3,295.00	3,954,000	

ユニ・チャーム	33,200	4,760.00	158,032,000	
協和キリン	19,300	2,572.00	49,639,600	
武田薬品工業	141,700	4,282.00	606,759,400	
アステラス製薬	139,700	1,743.00	243,497,100	
住友ファーマ	14,200	590.00	8,378,000	
塩野義製薬	52,800	2,148.00	113,414,400	
日本新薬	4,200	4,097.00	17,207,400	
中外製薬	49,800	7,229.00	360,004,200	
科研製薬	2,700	3,862.00	10,427,400	
エーザイ	21,100	5,058.00	106,723,800	
ロート製薬	16,800	3,401.00	57,136,800	
小野薬品工業	32,600	1,935.00	63,081,000	
久光製薬	3,500	4,438.00	15,533,000	
持田製薬	2,000	3,265.00	6,530,000	
参天製薬	30,300	1,784.00	54,055,200	
扶桑薬品工業	600	2,630.00	1,578,000	
ツムラ	5,500	4,920.00	27,060,000	
キッセイ薬品工業	2,600	3,685.00	9,581,000	
生化学工業	3,100	853.00	2,644,300	
栄研化学	2,500	2,207.00	5,517,500	
鳥居薬品	800	4,200.00	3,360,000	
J C R ファーマ	5,400	705.00	3,807,000	
東和薬品	2,100	3,120.00	6,552,000	
富士製薬工業	1,200	1,293.00	1,551,600	
ゼリア新薬工業	2,500	2,372.00	5,930,000	
ネクセラファーマ	7,500	1,200.00	9,000,000	
第一三共	150,300	4,838.00	727,151,400	
杏林製薬	3,500	1,510.00	5,285,000	
大幸薬品	3,700	376.00	1,391,200	
ダイト	1,200	2,205.00	2,646,000	
大塚ホールディングス	39,700	9,611.00	381,556,700	
ペプチドリーム	7,700	2,853.50	21,971,950	
セルソース	1,100	1,191.00	1,310,100	
あすか製薬ホールディングス	1,500	2,123.00	3,184,500	
サワイグループホールディングス	9,400	1,996.50	18,767,100	
日本コークス工業	16,300	96.00	1,564,800	
ニチレキグループ	1,700	2,461.00	4,183,700	
ユシロ化学工業	800	1,542.00	1,233,600	
ビーピー・カストロール	200	867.00	173,400	
富士石油	4,300	336.00	1,444,800	
MORESCO	200	1,221.00	244,200	
出光興産	74,400	1,032.00	76,780,800	

ENEOSホールディングス	270,100	775.20	209,381,520	
コスモエネルギーホールディングス	5,200	7,452.00	38,750,400	
横浜ゴム	8,100	3,122.00	25,288,200	
TOYO TIRE	9,100	2,176.00	19,801,600	
ブリヂストン	46,600	5,540.00	258,164,000	
住友ゴム工業	15,600	1,574.00	24,554,400	
藤倉コンポジット	1,500	1,229.00	1,843,500	
オカモト	800	5,230.00	4,184,000	
フコク	1,000	1,777.00	1,777,000	
ニッタ	1,600	3,695.00	5,912,000	
住友理工	3,100	1,603.00	4,969,300	
三ツ星ベルト	2,200	3,965.00	8,723,000	
バンダー化学	2,400	1,803.00	4,327,200	
日東紡績	1,800	6,530.00	11,754,000	
A G C	15,500	4,783.00	74,136,500	
日本板硝子	7,900	370.00	2,923,000	
日本山村硝子	100	1,551.00	155,100	
日本電気硝子	5,900	3,418.00	20,166,200	
オハラ	700	1,285.00	899,500	
住友大阪セメント	2,800	3,674.00	10,287,200	
太平洋セメント	9,800	3,386.00	33,182,800	
日本ヒューム	1,300	1,255.00	1,631,500	
日本コンクリート工業	2,900	330.00	957,000	
三谷セキサン	700	6,400.00	4,480,000	
アジアパイルホールディングス	2,200	805.00	1,771,000	
東海カーボン	14,600	883.20	12,894,720	
日本カーボン	900	4,480.00	4,032,000	
東洋炭素	1,100	5,380.00	5,918,000	
ノリタケ	1,700	3,945.00	6,706,500	
T O T O	11,500	4,382.00	50,393,000	
日本碍子	18,500	2,005.00	37,092,500	
日本特殊陶業	13,000	4,845.00	62,985,000	
M A R U W A	700	47,000.00	32,900,000	
品川リフラクトリーズ	1,900	1,791.00	3,402,900	
黒崎播磨	1,100	2,461.00	2,707,100	
ヨータイ	800	1,660.00	1,328,000	
フジミインコーポレーテッド	4,300	2,468.00	10,612,400	
ニチアス	4,000	5,583.00	22,332,000	
ニチハ	2,000	3,435.00	6,870,000	
日本製鉄	82,900	3,108.00	257,653,200	
神戸製鋼所	32,900	1,690.50	55,617,450	
中山製鋼所	3,400	756.00	2,570,400	

合同製鐵	900	3,995.00	3,595,500	
J F E ホールディングス	49,400	1,862.00	91,982,800	
東京製鐵	4,600	1,517.00	6,978,200	
共英製鋼	1,600	1,742.00	2,787,200	
大和工業	3,100	7,800.00	24,180,000	
東京鐵鋼	700	6,270.00	4,389,000	
大阪製鐵	800	3,005.00	2,404,000	
淀川製鋼所	1,500	5,370.00	8,055,000	
中部鋼鈹	1,100	2,350.00	2,585,000	
丸一鋼管	5,000	3,360.00	16,800,000	
モリ工業	400	5,040.00	2,016,000	
大同特殊鋼	10,300	1,187.50	12,231,250	
日本高周波鋼業	200	386.00	77,200	
日本冶金工業	1,100	4,105.00	4,515,500	
山陽特殊製鋼	1,600	1,873.00	2,996,800	
愛知製鋼	900	4,560.00	4,104,000	
大平洋金属	1,500	1,386.00	2,079,000	
新日本電工	9,700	293.00	2,842,100	
栗本鐵工所	700	4,165.00	2,915,500	
三菱製鋼	1,200	1,356.00	1,627,200	
日本精線	1,300	1,277.00	1,660,100	
エンビプロ・ホールディングス	1,800	498.00	896,400	
新家工業	100	4,480.00	448,000	
大紀アルミニウム工業所	2,400	1,083.00	2,599,200	
日本軽金属ホールディングス	4,800	1,544.00	7,411,200	
三井金属鉱業	4,100	4,792.00	19,647,200	
三菱マテリアル	11,700	2,523.00	29,519,100	
住友金属鉱山	20,700	4,335.00	89,734,500	
D O W A ホールディングス	4,400	5,226.00	22,994,400	
古河機械金属	2,200	1,672.00	3,678,400	
エス・サイエンス	5,300	22.00	116,600	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,900	2,217.00	6,429,300	
東邦チタニウム	3,400	1,025.00	3,485,000	
U A C J	2,300	4,905.00	11,281,500	
C K サンエツ	400	3,690.00	1,476,000	
古河電気工業	5,500	3,825.00	21,037,500	
住友電気工業	56,600	2,673.50	151,320,100	
フジクラ	17,600	5,770.00	101,552,000	
S W C C	2,200	5,450.00	11,990,000	
カナレ電気	100	1,420.00	142,000	
平河ヒューテック	1,100	1,573.00	1,730,300	
リョービ	1,800	1,917.00	3,450,600	

アーレスティ	500	561.00	280,500	
A R E ホールディングス	6,600	1,828.00	12,064,800	
稲葉製作所	900	1,780.00	1,602,000	
宮地エンジニアリンググループ	2,000	1,970.00	3,940,000	
トーカロ	4,700	1,850.00	8,695,000	
S U M C O	31,200	1,495.00	46,644,000	
川田テクノロジーズ	1,100	2,453.00	2,698,300	
R S T e c h n o l o g i e s	1,300	3,945.00	5,128,500	
信和	300	734.00	220,200	
東洋製罐グループホールディングス	10,400	2,274.50	23,654,800	
ホッカンホールディングス	900	1,726.00	1,553,400	
コロナ	1,100	935.00	1,028,500	
横河ブリッジホールディングス	2,800	2,752.00	7,705,600	
三和ホールディングス	16,300	4,500.00	73,350,000	
文化シャッター	4,300	1,850.00	7,955,000	
三協立山	2,100	762.00	1,600,200	
アルインコ	1,300	969.00	1,259,700	
東洋シャッター	100	781.00	78,100	
L I X I L	23,900	1,755.50	41,956,450	
ノーリツ	2,300	1,776.00	4,084,800	
長府製作所	1,800	1,955.00	3,519,000	
リンナイ	8,700	3,356.00	29,197,200	
日東精工	2,400	592.00	1,420,800	
岡部	2,900	791.00	2,293,900	
ジーテクト	1,800	1,574.00	2,833,200	
東ブレ	2,900	1,762.00	5,109,800	
高周波熱錬	2,400	997.00	2,392,800	
東京製綱	1,000	1,150.00	1,150,000	
サンコール	2,200	406.00	893,200	
パイオラックス	2,200	2,429.00	5,343,800	
エイチワン	1,700	923.00	1,569,100	
日本発條	14,500	1,843.50	26,730,750	
中央発條	1,100	1,259.00	1,384,900	
立川ブラインド工業	700	1,335.00	934,500	
日本ドライケミカル	100	3,430.00	343,000	
日本製鋼所	4,900	5,483.00	26,866,700	
三浦工業	7,400	3,560.00	26,344,000	
タクマ	5,400	1,591.00	8,591,400	
ツガミ	3,400	1,425.00	4,845,000	
オークマ	2,800	3,340.00	9,352,000	
芝浦機械	2,100	3,720.00	7,812,000	
アマダ	22,300	1,550.00	34,565,000	

アイダエンジニアリング	3,600	795.00	2,862,000	
F U J I	7,000	2,322.50	16,257,500	
牧野フライス製作所	1,800	6,800.00	12,240,000	
オーエスジー	7,100	1,814.00	12,879,400	
旭ダイヤモンド工業	4,000	850.00	3,400,000	
D M G 森精機	10,100	2,726.00	27,532,600	
ソディック	4,200	776.00	3,259,200	
ディスコ	7,700	46,750.00	359,975,000	
日東工器	600	2,702.00	1,621,200	
日進工具	1,300	747.00	971,100	
富士ダイス	1,200	785.00	942,000	
リケン N P R	2,000	2,343.00	4,686,000	
島精機製作所	2,500	1,109.00	2,772,500	
オプトラン	2,600	1,945.00	5,057,000	
イワキポンプ	1,100	3,005.00	3,305,500	
フリュー	1,500	1,095.00	1,642,500	
ヤマシンフィルタ	3,400	587.00	1,995,800	
日阪製作所	1,900	973.00	1,848,700	
やまびこ	2,600	2,468.00	6,416,800	
野村マイクロ・サイエンス	2,600	2,158.00	5,610,800	
平田機工	800	5,020.00	4,016,000	
P E G A S U S	2,100	448.00	940,800	
マルマエ	700	1,723.00	1,206,100	
タツモ	1,100	3,565.00	3,921,500	
ナブテスコ	10,100	2,477.50	25,022,750	
三井海洋開発	2,000	3,450.00	6,900,000	
レオン自動機	1,700	1,434.00	2,437,800	
S M C	4,800	68,720.00	329,856,000	
ホソカワミクロン	1,100	4,010.00	4,411,000	
ユニオンツール	700	6,980.00	4,886,000	
瑞光	1,000	1,316.00	1,316,000	
オイレス工業	2,200	1,981.00	4,358,200	
日精エー・エス・ビー機械	500	4,655.00	2,327,500	
サトーホールディングス	2,000	2,130.00	4,260,000	
技研製作所	1,500	1,733.00	2,599,500	
日本エアーテック	700	1,199.00	839,300	
日精樹脂工業	1,100	935.00	1,028,500	
オカダアイヨン	100	2,082.00	208,200	
ワイエイシイホールディングス	800	2,165.00	1,732,000	
小松製作所	80,900	4,217.00	341,155,300	
住友重機械工業	9,500	3,385.00	32,157,500	
日立建機	6,400	3,520.00	22,528,000	

日工	2,400	695.00	1,668,000	
巴工業	600	3,810.00	2,286,000	
井関農機	1,500	996.00	1,494,000	
T O W A	4,900	2,059.00	10,089,100	
北川鉄工所	700	1,239.00	867,300	
ローツェ	8,400	2,277.00	19,126,800	
タカキタ	200	393.00	78,600	
クボタ	83,800	2,010.00	168,438,000	
荏原実業	800	4,415.00	3,532,000	
三菱化工機	600	3,195.00	1,917,000	
月島ホールディングス	2,200	1,367.00	3,007,400	
帝国電機製作所	1,100	2,860.00	3,146,000	
新東工業	3,600	1,026.00	3,693,600	
澁谷工業	1,500	3,695.00	5,542,500	
アイチ コーポレーション	2,600	1,179.00	3,065,400	
小森コーポレーション	3,900	1,106.00	4,313,400	
鶴見製作所	1,200	4,160.00	4,992,000	
酒井重工業	600	2,467.00	1,480,200	
荏原製作所	32,900	2,399.00	78,927,100	
西島製作所	1,400	2,839.00	3,974,600	
北越工業	1,600	1,890.00	3,024,000	
ダイキン工業	20,900	18,790.00	392,711,000	
オルガノ	2,500	8,470.00	21,175,000	
トーヨーカネツ	600	4,420.00	2,652,000	
栗田工業	9,000	5,743.00	51,687,000	
椿本チエイン	7,300	1,913.00	13,964,900	
木村化工機	1,200	768.00	921,600	
アネスト岩田	2,700	1,415.00	3,820,500	
ダイフク	27,100	2,954.00	80,053,400	
サムコ	400	3,305.00	1,322,000	
加藤製作所	200	1,248.00	249,600	
タダノ	9,200	995.30	9,156,760	
フジテック	5,200	5,533.00	28,771,600	
C K D	4,400	2,682.00	11,800,800	
平和	5,300	2,071.00	10,976,300	
理想科学工業	1,300	3,560.00	4,628,000	
S A N K Y O	18,500	2,060.00	38,110,000	
日本金銭機械	1,900	916.00	1,740,400	
マースグループホールディングス	1,100	3,200.00	3,520,000	
フクシマガリレイ	1,200	5,480.00	6,576,000	
オーイズミ	200	358.00	71,600	
ダイコク電機	700	3,400.00	2,380,000	

竹内製作所	2,900	5,070.00	14,703,000	
アマノ	4,500	4,341.00	19,534,500	
J U K I	2,500	406.00	1,015,000	
ジャノメ	1,400	891.00	1,247,400	
マックス	2,000	3,325.00	6,650,000	
グローリー	4,200	2,501.00	10,504,200	
新晃工業	1,600	4,440.00	7,104,000	
大和冷機工業	2,400	1,466.00	3,518,400	
セガサミーホールディングス	14,300	2,959.00	42,313,700	
T P R	2,000	2,326.00	4,652,000	
ツバキ・ナカシマ	3,900	693.00	2,702,700	
ホシザキ	10,300	4,967.00	51,160,100	
大豊工業	1,600	619.00	990,400	
日本精工	29,700	688.60	20,451,420	
N T N	38,000	252.80	9,606,400	
ジェイテクト	14,300	1,080.00	15,444,000	
不二越	1,200	3,210.00	3,852,000	
日本トムソン	4,300	496.00	2,132,800	
T H K	9,200	2,602.00	23,938,400	
ユーシン精機	1,500	662.00	993,000	
前澤給装工業	1,200	1,253.00	1,503,600	
イーグル工業	1,800	2,008.00	3,614,400	
前澤工業	200	1,184.00	236,800	
P I L L A R	1,500	4,400.00	6,600,000	
キッツ	5,400	1,059.00	5,718,600	
マキタ	20,000	4,895.00	97,900,000	
三井E & S	8,600	1,156.00	9,941,600	
カナデビア	13,100	1,081.00	14,161,100	
三菱重工業	280,400	2,263.00	634,545,200	
I H I	12,900	9,280.00	119,712,000	
スター精密	2,700	1,979.00	5,343,300	
日清紡ホールディングス	12,000	969.60	11,635,200	
イビデン	9,200	5,200.00	47,840,000	
コニカミノルタ	35,800	666.30	23,853,540	
ブラザー工業	21,400	3,040.00	65,056,000	
ミネベアミツミ	27,900	2,858.00	79,738,200	
日立製作所	412,900	3,791.00	1,565,303,900	
三菱電機	163,100	2,729.50	445,181,450	
富士電機	9,800	8,639.00	84,662,200	
安川電機	17,400	4,603.00	80,092,200	
シンフォニアテクノロジー	1,600	5,360.00	8,576,000	
明電舎	2,700	3,950.00	10,665,000	

山洋電気	700	8,800.00	6,160,000	
デンヨー	1,200	2,603.00	3,123,600	
PHCホールディングス	3,000	1,000.00	3,000,000	
KOKUSAI ELECTRIC	11,200	2,952.00	33,062,400	
ソシオネクスト	16,000	2,602.00	41,632,000	
東芝テック	2,400	3,570.00	8,568,000	
芝浦メカトロニクス	1,200	11,050.00	13,260,000	
マブチモーター	7,000	2,336.00	16,352,000	
ニデック	70,800	2,993.00	211,904,400	
トレックス・セミコンダクター	800	1,539.00	1,231,200	
東光高岳	900	1,974.00	1,776,600	
ダブル・スコープ	4,900	362.00	1,773,800	
ダイヘン	1,500	6,690.00	10,035,000	
ヤーマン	3,100	826.00	2,560,600	
JVCケンウッド	12,600	1,275.00	16,065,000	
ミマキエンジニアリング	1,300	1,462.00	1,900,600	
I - P E X	900	1,565.00	1,408,500	
大崎電気工業	3,500	752.00	2,632,000	
オムロン	14,700	5,928.00	87,141,600	
日東工業	2,200	2,925.00	6,435,000	
I D E C	2,400	2,624.00	6,297,600	
正興電機製作所	100	1,236.00	123,600	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	7,100	2,835.00	20,128,500	
サクサ	100	2,406.00	240,600	
メルコホールディングス	400	2,352.00	940,800	
テクノメディカ	400	1,778.00	711,200	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	900	602.00	541,800	
日本電気	22,700	13,160.00	298,732,000	
富士通	147,600	2,801.50	413,501,400	
沖電気工業	7,800	1,005.00	7,839,000	
電気興業	700	1,900.00	1,330,000	
サンケン電気	1,600	5,917.00	9,467,200	
アイホン	1,000	2,847.00	2,847,000	
ルネサスエレクトロニクス	122,200	2,040.50	249,349,100	
セイコーエプソン	20,600	2,825.50	58,205,300	
ワコム	11,300	708.00	8,000,400	
アルバック	3,500	7,361.00	25,763,500	
アクセル	800	1,382.00	1,105,600	
E I Z O	2,100	2,296.00	4,821,600	
日本信号	3,600	949.00	3,416,400	
京三製作所	3,700	545.00	2,016,500	
能美防災	2,200	3,030.00	6,666,000	

ホーチキ	1,000	2,233.00	2,233,000	
星和電機	200	514.00	102,800	
エレコム	3,800	1,439.00	5,468,200	
パナソニック ホールディングス	189,400	1,348.50	255,405,900	
シャープ	23,100	901.00	20,813,100	
アンリツ	11,300	1,188.50	13,430,050	
富士通ゼネラル	4,500	1,944.00	8,748,000	
ソニーグループ	556,000	2,774.50	1,542,622,000	
T D K	138,500	2,075.50	287,456,750	
帝国通信工業	700	2,710.00	1,897,000	
タムラ製作所	6,400	560.00	3,584,000	
アルプスアルパイン	13,000	1,614.00	20,982,000	
日本電波工業	1,500	1,042.00	1,563,000	
鈴木	900	1,825.00	1,642,500	
メイコー	1,600	5,600.00	8,960,000	
日本トリム	400	3,535.00	1,414,000	
フォスター電機	1,600	1,780.00	2,848,000	
S M K	400	2,389.00	955,600	
ヨコオ	1,400	1,523.00	2,132,200	
ホシデン	4,000	2,332.00	9,328,000	
ヒロセ電機	2,300	18,590.00	42,757,000	
日本航空電子工業	4,200	2,774.00	11,650,800	
T O A	1,600	933.00	1,492,800	
マクセル	3,200	1,812.00	5,798,400	
古野電気	1,900	2,541.00	4,827,900	
スミダコーポレーション	2,200	984.00	2,164,800	
アイコム	600	2,855.00	1,713,000	
リオン	700	2,427.00	1,698,900	
横河電機	17,500	3,598.00	62,965,000	
新電元工業	600	2,403.00	1,441,800	
アズビル	43,700	1,195.50	52,243,350	
東亜ディーケーケー	200	732.00	146,400	
日本光電工業	14,200	2,259.50	32,084,900	
チノー	700	2,145.00	1,501,500	
日本電子材料	1,000	2,407.00	2,407,000	
堀場製作所	3,000	9,607.00	28,821,000	
アドバンテスト	50,000	9,625.00	481,250,000	
エスベック	1,400	2,616.00	3,662,400	
キーエンス	15,900	69,360.00	1,102,824,000	
日置電機	800	8,190.00	6,552,000	
シスメックス	41,100	2,849.00	117,093,900	
日本マイクロニクス	2,600	3,800.00	9,880,000	

メガチップス	1,200	5,520.00	6,624,000	
O B A R A G R O U P	1,000	4,240.00	4,240,000	
原田工業	300	540.00	162,000	
コーセル	1,700	1,248.00	2,121,600	
イリソ電子工業	1,600	2,923.00	4,676,800	
オブテックスグループ	2,900	1,632.00	4,732,800	
千代田インテグレ	600	3,330.00	1,998,000	
レーザーテック	7,300	20,730.00	151,329,000	
スタンレー電気	9,900	2,605.00	25,789,500	
ウシオ電機	7,000	2,136.50	14,955,500	
岡谷電機産業	500	227.00	113,500	
日本セラミック	1,500	2,559.00	3,838,500	
遠藤照明	200	1,311.00	262,200	
古河電池	1,200	1,373.00	1,647,600	
山一電機	1,300	2,524.00	3,281,200	
図研	1,400	3,550.00	4,970,000	
日本電子	3,700	5,846.00	21,630,200	
カシオ計算機	12,700	1,109.50	14,090,650	
ファナック	76,800	4,337.00	333,081,600	
日本シイエムケイ	4,700	410.00	1,927,000	
エンプラス	500	5,550.00	2,775,000	
大真空	2,000	562.00	1,124,000	
ローム	28,800	1,703.00	49,046,400	
浜松ホトニクス	25,500	2,042.50	52,083,750	
三井ハイテック	7,000	829.00	5,803,000	
新光電気工業	5,600	5,417.00	30,335,200	
京セラ	98,700	1,585.00	156,439,500	
太陽誘電	6,900	2,739.50	18,902,550	
村田製作所	141,800	2,759.00	391,226,200	
双葉電子工業	3,000	513.00	1,539,000	
ニチコン	4,200	1,012.00	4,250,400	
日本ケミコン	2,000	1,119.00	2,238,000	
K O A	2,700	1,032.00	2,786,400	
市光工業	2,900	450.00	1,305,000	
小糸製作所	16,400	1,979.50	32,463,800	
ミツバ	3,000	861.00	2,583,000	
S C R E E Nホールディングス	6,600	10,440.00	68,904,000	
キャノン電子	1,500	2,408.00	3,612,000	
キャノン	79,200	5,003.00	396,237,600	
リコー	41,800	1,673.00	69,931,400	
象印マホービン	4,700	1,599.00	7,515,300	
東京エレクトロン	33,600	23,460.00	788,256,000	代用有価証券 3,000株

イノテック	1,100	1,468.00	1,614,800	
トヨタ紡織	6,700	2,024.50	13,564,150	
芦森工業	100	2,521.00	252,100	
ユニプレス	2,800	1,114.00	3,119,200	
豊田自動織機	13,500	10,785.00	145,597,500	
モリタホールディングス	2,500	2,124.00	5,310,000	
三櫻工業	2,200	735.00	1,617,000	
デンソー	168,400	2,241.50	377,468,600	
東海理化電機製作所	4,500	2,170.00	9,765,000	
川崎重工業	12,000	6,285.00	75,420,000	
名村造船所	4,500	1,690.00	7,605,000	
日本車輛製造	600	2,225.00	1,335,000	
三菱ロジスネクスト	2,500	1,205.00	3,012,500	
日産自動車	209,000	401.20	83,850,800	
いすゞ自動車	49,100	1,920.50	94,296,550	
トヨタ自動車	843,900	2,684.50	2,265,449,550	代用有価証券 45,000株
日野自動車	23,900	368.60	8,809,540	
三菱自動車工業	62,000	454.20	28,160,400	
レシップホールディングス	200	513.00	102,600	
武蔵精密工業	3,900	1,943.00	7,577,700	
日産車体	2,400	1,000.00	2,400,000	
新明和工業	4,600	1,352.00	6,219,200	
極東開発工業	2,100	2,416.00	5,073,600	
トピー工業	1,300	1,969.00	2,559,700	
ティラド	400	3,455.00	1,382,000	
曙ブレーキ工業	9,700	118.00	1,144,600	
タチエス	2,900	1,778.00	5,156,200	
N O K	6,200	2,196.00	13,615,200	
フタバ産業	4,800	648.00	3,110,400	
カヤバ	1,300	4,745.00	6,168,500	
大同メタル工業	3,100	488.00	1,512,800	
プレス工業	6,200	543.00	3,366,600	
ミクニ	500	324.00	162,000	
太平洋工業	3,600	1,364.00	4,910,400	
アイシン	33,600	1,644.50	55,255,200	
マツダ	48,800	1,062.50	51,850,000	
本田技研工業	376,200	1,418.00	533,451,600	
スズキ	128,300	1,504.00	192,963,200	
S U B A R U	49,300	2,465.00	121,524,500	
安永	200	525.00	105,000	
ヤマハ発動機	67,100	1,336.50	89,679,150	
エクセディ	2,600	4,135.00	10,751,000	

豊田合成	4,500	2,584.50	11,630,250	
愛三工業	3,000	1,369.00	4,107,000	
ヨロズ	1,600	1,159.00	1,854,400	
エフ・シー・シー	2,800	2,694.00	7,543,200	
シマノ	6,900	23,260.00	160,494,000	
テイ・エス テック	6,500	1,736.00	11,284,000	
ジャムコ	1,000	1,221.00	1,221,000	
テルモ	106,200	2,970.50	315,467,100	
日機装	4,100	1,027.00	4,210,700	
日本エム・ディ・エム	1,500	611.00	916,500	
島津製作所	22,800	4,650.00	106,020,000	
J M S	1,800	473.00	851,400	
長野計器	1,000	2,445.00	2,445,000	
ブイ・テクノロジー	800	2,453.00	1,962,400	
東京計器	1,100	3,160.00	3,476,000	
愛知時計電機	800	1,981.00	1,584,800	
インターアクション	1,000	1,066.00	1,066,000	
東京精密	3,200	8,926.00	28,563,200	
マニー	6,300	1,899.50	11,966,850	
ニコン	25,000	1,882.50	47,062,500	
トプコン	9,000	1,585.00	14,265,000	
オリンパス	90,900	2,701.00	245,520,900	
理研計器	2,200	4,325.00	9,515,000	
タムロン	2,200	4,185.00	9,207,000	
H O Y A	31,300	21,695.00	679,053,500	
ノーリツ鋼機	1,500	3,920.00	5,880,000	
A & D ホロンホールディングス	2,000	2,211.00	4,422,000	
朝日インテック	19,300	2,452.50	47,333,250	
シチズン時計	14,600	923.00	13,475,800	
大研医器	300	500.00	150,000	
メニコン	5,900	1,690.00	9,971,000	
シンシア	200	466.00	93,200	
松風	1,600	2,248.00	3,596,800	
セイコーグループ	2,400	3,835.00	9,204,000	
ニプロ	13,200	1,393.00	18,387,600	
三井松島ホールディングス	1,100	4,180.00	4,598,000	
パラマウントベッドホールディングス	3,700	2,600.00	9,620,000	
トランザクション	1,000	2,395.00	2,395,000	
粧美堂	100	485.00	48,500	
ニホンフラッシュ	1,300	891.00	1,158,300	
前田工織	2,800	1,774.00	4,967,200	
アートネイチャー	1,700	849.00	1,443,300	

フルヤ金属	1,500	4,035.00	6,052,500	
バンダイナムコホールディングス	43,100	3,348.00	144,298,800	
アイフィスジャパン	100	560.00	56,000	
S H O E I	4,400	2,336.00	10,278,400	
フランスベッドホールディングス	2,300	1,237.00	2,845,100	
パイロットコーポレーション	2,500	4,871.00	12,177,500	
萩原工業	1,000	1,430.00	1,430,000	
フジシールインターナショナル	3,600	2,525.00	9,090,000	
タカラトミー	6,700	4,215.00	28,240,500	
広済堂ホールディングス	5,900	531.00	3,132,900	
プロネクサス	1,600	1,273.00	2,036,800	
T O P P A Nホールディングス	20,800	4,550.00	94,640,000	
大日本印刷	32,900	2,665.00	87,678,500	
共同印刷	500	3,500.00	1,750,000	
N I S S H A	2,700	1,926.00	5,200,200	
T A K A R A & C O M P A N Y	900	2,658.00	2,392,200	
アシックス	58,600	2,659.50	155,846,700	
ツツミ	400	2,120.00	848,000	
ローランド	1,200	3,850.00	4,620,000	
小松ウオール工業	1,200	1,511.00	1,813,200	
ヤマハ	29,000	1,147.00	33,263,000	
河合楽器製作所	500	2,844.00	1,422,000	
クリナップ	1,600	716.00	1,145,600	
ピジョン	10,100	1,601.00	16,170,100	
キングジム	1,400	860.00	1,204,000	
リンテック	3,200	3,235.00	10,352,000	
イトーキ	3,200	1,574.00	5,036,800	
任天堂	100,200	8,100.00	811,620,000	代用有価証券 18,000株
三菱鉛筆	2,200	2,610.00	5,742,000	
タカラスタンダード	3,600	1,699.00	6,116,400	
コクヨ	7,900	2,755.00	21,764,500	
ナカバヤシ	1,900	515.00	978,500	
グローブライド	1,600	1,945.00	3,112,000	
オカムラ	4,800	1,935.00	9,288,000	
美津濃	1,600	8,000.00	12,800,000	
グリムス	700	2,558.00	1,790,600	
東京電力ホールディングス	133,600	629.30	84,074,480	
中部電力	58,500	1,710.00	100,035,000	
関西電力	66,900	2,401.50	160,660,350	
中国電力	27,600	1,065.50	29,407,800	
北陸電力	16,200	1,008.00	16,329,600	
東北電力	41,800	1,286.00	53,754,800	

四国電力	14,800	1,310.50	19,395,400	
九州電力	36,600	1,587.00	58,084,200	
北海道電力	16,600	944.90	15,685,340	
沖縄電力	4,100	1,028.00	4,214,800	
電源開発	12,000	2,610.00	31,320,000	
イーレックス	3,100	634.00	1,965,400	
レノバ	4,400	875.00	3,850,000	
東京瓦斯	30,900	3,680.00	113,712,000	
大阪瓦斯	31,600	3,252.00	102,763,200	
東邦瓦斯	6,200	3,769.00	23,367,800	
北海道瓦斯	4,800	547.00	2,625,600	
広島ガス	3,500	381.00	1,333,500	
西部ガスホールディングス	1,700	1,737.00	2,952,900	
静岡ガス	3,700	1,005.00	3,718,500	
メタウォーター	2,200	1,780.00	3,916,000	
SBSホールディングス	1,400	2,413.00	3,378,200	
東武鉄道	16,700	2,454.50	40,990,150	
相鉄ホールディングス	5,200	2,419.00	12,578,800	
東急	44,500	1,899.00	84,505,500	
京浜急行電鉄	19,600	1,203.00	23,578,800	
小田急電鉄	26,300	1,579.50	41,540,850	
京王電鉄	8,400	3,356.00	28,190,400	
京成電鉄	9,200	4,044.00	37,204,800	
富士急行	2,000	2,524.00	5,048,000	
東日本旅客鉄道	87,600	3,058.00	267,880,800	
西日本旅客鉄道	40,600	2,688.00	109,132,800	
東海旅客鉄道	61,200	3,190.00	195,228,000	
西武ホールディングス	17,300	3,396.00	58,750,800	
鴻池運輸	2,700	2,442.00	6,593,400	
西日本鉄道	4,600	2,170.00	9,982,000	
ハマキョウレックス	5,400	1,216.00	6,566,400	
サカイ引越センター	2,000	2,373.00	4,746,000	
近鉄グループホールディングス	17,000	3,445.00	58,565,000	
阪急阪神ホールディングス	21,100	3,932.00	82,965,200	
南海電気鉄道	7,100	2,399.00	17,032,900	
京阪ホールディングス	8,700	2,777.00	24,159,900	
神戸電鉄	400	2,316.00	926,400	
名古屋鉄道	17,500	1,663.50	29,111,250	
山陽電気鉄道	1,200	2,038.00	2,445,600	
アルプス物流	200	5,750.00	1,150,000	
ヤマトホールディングス	19,300	1,600.00	30,880,000	
山九	3,800	5,207.00	19,786,600	

丸全昭和運輸	1,000	6,000.00	6,000,000	
センコーグループホールディングス	9,300	1,411.00	13,122,300	
トナミホールディングス	300	5,800.00	1,740,000	
ニッコンホールディングス	9,000	1,930.00	17,370,000	
福山通運	1,700	3,720.00	6,324,000	
セイノーホールディングス	7,800	2,378.00	18,548,400	
神奈川中央交通	500	3,300.00	1,650,000	
A Z - C O M丸和ホールディングス	4,900	1,029.00	5,042,100	
九州旅客鉄道	12,100	3,933.00	47,589,300	
S Gホールディングス	26,600	1,514.00	40,272,400	
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	5,700	7,400.00	42,180,000	
日本郵船	32,900	4,837.00	159,137,300	
商船三井	30,100	5,140.00	154,714,000	
川崎汽船	36,100	2,116.00	76,387,600	
N S ユナイテッド海運	1,000	4,075.00	4,075,000	
飯野海運	5,900	1,094.00	6,454,600	
乾汽船	2,100	1,135.00	2,383,500	
日本航空	36,400	2,420.00	88,088,000	
A N Aホールディングス	43,200	2,855.00	123,336,000	
ランコム	500	10,230.00	5,115,000	
日新	1,100	4,230.00	4,653,000	
三菱倉庫	18,500	1,007.50	18,638,750	
三井倉庫ホールディングス	1,600	6,950.00	11,120,000	
住友倉庫	4,700	2,615.00	12,290,500	
澁澤倉庫	700	3,135.00	2,194,500	
日本トランスシティ	3,200	940.00	3,008,000	
中央倉庫	900	1,550.00	1,395,000	
川西倉庫	100	1,064.00	106,400	
安田倉庫	1,100	1,620.00	1,782,000	
ファイズホールディングス	200	906.00	181,200	
上組	7,300	3,130.00	22,849,000	
キムラユニティー	100	1,446.00	144,600	
キューソー流通システム	1,100	1,950.00	2,145,000	
エーアイティー	1,000	1,770.00	1,770,000	
内外トランスライン	600	2,768.00	1,660,800	
日本コンセプト	600	1,785.00	1,071,000	
N E C ネットズエスアイ	6,200	3,255.00	20,181,000	
クロスキャット	1,000	1,115.00	1,115,000	
システナ	22,700	348.00	7,899,600	
デジタルアーツ	1,000	5,820.00	5,820,000	
日鉄ソリューションズ	5,400	3,990.00	21,546,000	
キューブシステム	1,000	996.00	996,000	

コア	700	1,857.00	1,299,900	
手間いらず	300	3,105.00	931,500	
ラクーンホールディングス	1,400	733.00	1,026,200	
ソリトンシステムズ	900	1,245.00	1,120,500	
ソフトクリエイトホールディングス	1,200	2,095.00	2,514,000	
T I S	16,800	3,714.00	62,395,200	
グリー	5,400	427.00	2,305,800	
コーエーテクモホールディングス	12,000	1,607.00	19,284,000	
三菱総合研究所	800	4,280.00	3,424,000	
電算	100	1,406.00	140,600	
A G S	200	792.00	158,400	
ファインデックス	1,300	871.00	1,132,300	
ブレインパッド	1,400	802.00	1,122,800	
K L a b	5,000	182.00	910,000	
ポールトゥウィンホールディングス	2,400	442.00	1,060,800	
ネクソン	34,900	2,648.50	92,432,650	
アイスタイル	5,400	429.00	2,316,600	
エムアップホールディングス	2,000	1,327.00	2,654,000	
セルシス	900	1,216.00	1,094,400	
エニグモ	2,300	303.00	696,900	
テクノスジャパン	300	703.00	210,900	
コロプラ	5,500	532.00	2,926,000	
ブロードリーフ	6,500	559.00	3,633,500	
クロス・マーケティンググループ	300	689.00	206,700	
デジタルハーツホールディングス	1,200	810.00	972,000	
メディアドゥ	800	1,298.00	1,038,400	
じげん	4,000	568.00	2,272,000	
フィックスターズ	1,600	1,423.00	2,276,800	
C A R T A H O L D I N G S	900	1,440.00	1,296,000	
オブティム	1,700	591.00	1,004,700	
セレス	800	1,663.00	1,330,400	
S H I F T	1,100	15,850.00	17,435,000	
ティーガイア	1,400	2,667.00	3,733,800	
セック	300	4,060.00	1,218,000	
テクマトリックス	3,400	2,365.00	8,041,000	
プロシップ	700	1,499.00	1,049,300	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,900	3,409.00	13,295,100	
G M O ペイメントゲートウェイ	3,600	8,986.00	32,349,600	
システムリサーチ	1,100	1,462.00	1,608,200	
インターネットイニシアティブ	8,700	2,867.00	24,942,900	
さくらインターネット	2,500	4,905.00	12,262,500	
G M O グローバルサイン・ホールディングス	500	2,898.00	1,449,000	

S R Aホールディングス	900	4,250.00	3,825,000	
システムインテグレータ	300	315.00	94,500	
朝日ネット	1,800	632.00	1,137,600	
e B A S E	2,300	666.00	1,531,800	
アバントグループ	2,000	1,979.00	3,958,000	
アドソル日進	700	1,831.00	1,281,700	
フリービット	800	1,309.00	1,047,200	
コムチュア	2,100	2,309.00	4,848,900	
アステリア	1,600	505.00	808,000	
アイル	900	3,095.00	2,785,500	
マークラインズ	1,000	2,695.00	2,695,000	
メディカル・データ・ビジョン	2,000	525.00	1,050,000	
g u m i	3,200	311.00	995,200	
テラスカイ	600	1,870.00	1,122,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	800	2,006.00	1,604,800	
P C Iホールディングス	200	956.00	191,200	
ネオジャパン	500	1,813.00	906,500	
P R T I M E S	400	1,571.00	628,400	
ラクス	7,500	2,056.50	15,423,750	
ランドコンピュータ	200	728.00	145,600	
ダブルスタンダード	600	1,608.00	964,800	
アカツキ	800	2,107.00	1,685,600	
ベネフィットジャパン	100	1,119.00	111,900	
U b i c o mホールディングス	600	1,331.00	798,600	
カナミックネットワーク	2,100	536.00	1,125,600	
ノムラシステムコーポレーション	1,000	115.00	115,000	
チェンジホールディングス	4,000	1,207.00	4,828,000	
シンクロ・フード	400	473.00	189,200	
オークネット	700	2,345.00	1,641,500	
エイトレッド	100	1,566.00	156,600	
マクロミル	3,200	800.00	2,560,000	
ビーグリー	100	1,374.00	137,400	
オロ	700	2,367.00	1,656,900	
ユーザーローカル	700	1,856.00	1,299,200	
P K S H A T e c h n o l o g y	1,000	3,580.00	3,580,000	
マネーフォワード	3,900	4,990.00	19,461,000	
S u n A s t e r i s k	1,500	534.00	801,000	
プラスアルファ・コンサルティング	2,000	2,100.00	4,200,000	
電算システムホールディングス	700	2,631.00	1,841,700	
A p p i e r G r o u p	4,900	1,632.00	7,996,800	
ビジョナル	1,900	8,179.00	15,540,100	
ソルクシーズ	500	281.00	140,500	

ハイマックス	600	1,377.00	826,200	
野村総合研究所	34,500	4,555.00	157,147,500	
C E ホールディングス	300	431.00	129,300	
日本システム技術	1,500	1,758.00	2,637,000	
インテージホールディングス	1,800	1,560.00	2,808,000	
東邦システムサイエンス	800	1,454.00	1,163,200	
ソースネクスト	8,200	231.00	1,894,200	
シンプレクス・ホールディングス	3,100	2,392.00	7,415,200	
H E R O Z	800	1,117.00	893,600	
ラクスル	3,900	1,269.00	4,949,100	
メルカリ	7,800	1,824.00	14,227,200	
I P S	500	2,436.00	1,218,000	
システムサポート	600	1,729.00	1,037,400	
イーソル	1,300	705.00	916,500	
東海ソフト	100	1,225.00	122,500	
ウイングアーク 1 s t	1,700	3,240.00	5,508,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	700	811.00	567,700	
サーバーワークス	400	2,376.00	950,400	
東名	100	2,200.00	220,000	
トビラシステムズ	200	725.00	145,000	
S a n s a n	5,200	2,319.00	12,058,800	
L i n k - U グループ	200	468.00	93,600	
ギフトィ	1,500	941.00	1,411,500	
メドレー	1,800	3,755.00	6,759,000	
ベース	800	2,960.00	2,368,000	
J M D C	1,900	4,618.00	8,774,200	
フォーカスシステムズ	1,100	1,099.00	1,208,900	
クレスコ	2,600	1,213.00	3,153,800	
フジ・メディア・ホールディングス	15,300	1,721.50	26,338,950	
オービック	29,500	5,083.00	149,948,500	
ジャストシステム	2,300	3,385.00	7,785,500	
T D C ソフト	2,700	1,193.00	3,221,100	
L I N E ヤフー	254,400	421.10	107,127,840	
トレンドマイクロ	8,400	8,189.00	68,787,600	
I D ホールディングス	1,100	1,575.00	1,732,500	
日本オラクル	3,000	14,780.00	44,340,000	
アルファシステムズ	500	3,215.00	1,607,500	
フューチャー	4,000	1,931.00	7,724,000	
C A C H o l d i n g s	1,000	1,736.00	1,736,000	
オービックビジネスコンサルタント	2,700	6,756.00	18,241,200	
アイティフォー	1,900	1,391.00	2,642,900	
東計電算	400	4,585.00	1,834,000	

エクスネット	100	1,401.00	140,100	
大塚商会	18,000	3,498.00	62,964,000	
サイボウズ	2,200	2,081.00	4,578,200	
電通総研	1,500	4,900.00	7,350,000	
A C C E S S	1,700	1,270.00	2,159,000	
デジタルガレージ	2,500	3,095.00	7,737,500	
E Mシステムズ	2,800	539.00	1,509,200	
ウェザーニューズ	500	6,070.00	3,035,000	
C I J	4,000	422.00	1,688,000	
ビジネスエンジニアリング	400	4,000.00	1,600,000	
WOWOW	1,200	999.00	1,198,800	
スカラ	1,800	462.00	831,600	
インテリジェント ウェイブ	200	901.00	180,200	
A N Y C O L O R	2,200	2,210.00	4,862,000	
I M A G I C A G R O U P	1,900	478.00	908,200	
ネットワンシステムズ	6,700	3,605.00	24,153,500	
アルゴグラフィックス	1,500	4,685.00	7,027,500	
マーベラス	3,000	542.00	1,626,000	
エイベックス	3,000	1,492.00	4,476,000	
B I P R O G Y	5,400	4,335.00	23,409,000	
都築電気	1,000	2,419.00	2,419,000	
T B Sホールディングス	8,000	3,692.00	29,536,000	
日本テレビホールディングス	14,100	2,277.50	32,112,750	
朝日放送グループホールディングス	1,600	615.00	984,000	
テレビ朝日ホールディングス	3,900	1,938.00	7,558,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	12,400	846.00	10,490,400	
テレビ東京ホールディングス	1,000	3,255.00	3,255,000	
ビジョン	2,400	1,027.00	2,464,800	
U - N E X T H O L D I N G S	1,800	4,840.00	8,712,000	
日本通信	13,000	140.00	1,820,000	
クロップス	100	961.00	96,100	
日本電信電話	4,735,600	146.70	694,712,520	代用有価証券 700,000株
K D D I	117,100	4,827.00	565,241,700	
ソフトバンク	2,547,100	191.10	486,750,810	
光通信	1,800	30,940.00	55,692,000	
エムティーアイ	1,200	1,131.00	1,357,200	
G M Oインターネットグループ	5,200	2,632.00	13,686,400	
ファイバーゲート	1,000	989.00	989,000	
K A D O K A W A	8,400	3,309.00	27,795,600	
学研ホールディングス	2,900	986.00	2,859,400	
ゼンリン	2,800	817.00	2,287,600	
アイネット	1,000	1,630.00	1,630,000	

松竹	900	10,900.00	9,810,000	
東宝	9,900	5,901.00	58,419,900	
東映	2,600	5,010.00	13,026,000	
N T Tデータグループ	41,600	2,628.00	109,324,800	
ピー・シー・エー	1,100	1,967.00	2,163,700	
ビジネスブレイン太田昭和	700	1,860.00	1,302,000	
D T S	2,900	3,955.00	11,469,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,000	6,057.00	48,456,000	
シーイーシー	2,000	1,880.00	3,760,000	
カプコン	31,600	3,157.00	99,761,200	
アイ・エス・ビー	800	1,362.00	1,089,600	
S C S K	13,000	2,824.00	36,712,000	
N S W	700	3,020.00	2,114,000	
アイネス	1,300	1,620.00	2,106,000	
T K C	2,800	3,860.00	10,808,000	
富士ソフト	4,400	9,204.00	40,497,600	
N S D	6,100	3,346.00	20,410,600	
コナミグループ	6,000	14,190.00	85,140,000	
福井コンピュータホールディングス	1,100	2,646.00	2,910,600	
J B C Cホールディングス	1,100	4,545.00	4,999,500	
ミロク情報サービス	1,500	1,834.00	2,751,000	
ソフトバンクグループ	78,500	9,405.00	738,292,500	
リョーサン菱洋ホールディングス	2,800	2,545.00	7,126,000	
高千穂交易	700	3,975.00	2,782,500	
オルバヘルスケアホールディングス	100	1,955.00	195,500	
伊藤忠食品	400	6,800.00	2,720,000	
エレマテック	1,500	2,396.00	3,594,000	
あらた	2,600	3,430.00	8,918,000	
トーメンデバイス	200	6,480.00	1,296,000	
東京エレクトロン デバイス	1,700	3,235.00	5,499,500	
円谷フィールズホールディングス	2,700	1,977.00	5,337,900	
双日	18,700	3,177.00	59,409,900	
アルフレッサ ホールディングス	15,700	2,170.00	34,069,000	
横浜冷凍	4,200	904.00	3,796,800	
神栄	100	1,551.00	155,100	
ラサ商事	900	1,415.00	1,273,500	
アルコニックス	2,400	1,395.00	3,348,000	
神戸物産	13,000	3,710.00	48,230,000	
あい ホールディングス	2,700	2,331.00	6,293,700	
ダイワボウホールディングス	7,400	2,803.00	20,742,200	
マクニカホールディングス	13,000	1,764.50	22,938,500	
ラクト・ジャパン	700	2,807.00	1,964,900	

バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,300	1,173.00	2,697,900	
八洲電機	1,400	1,629.00	2,280,600	
メディアスホールディングス	1,100	831.00	914,100	
レスター	1,400	2,622.00	3,670,800	
ジオリーブグループ	100	1,055.00	105,500	
大光	200	622.00	124,400	
O C H I ホールディングス	100	1,286.00	128,600	
T O K A I ホールディングス	9,100	919.00	8,362,900	
三洋貿易	1,700	1,492.00	2,536,400	
ビューティガレージ	600	1,459.00	875,400	
ウイン・パートナーズ	1,200	1,269.00	1,522,800	
シップヘルスケアホールディングス	6,600	2,320.50	15,315,300	
明治電機工業	700	1,393.00	975,100	
デリカフーズホールディングス	200	506.00	101,200	
スターティアホールディングス	100	1,928.00	192,800	
コメダホールディングス	4,400	2,868.00	12,619,200	
アセンテック	900	623.00	560,700	
フルサト・マルカホールディングス	1,300	2,202.00	2,862,600	
ヤマエグループホールディングス	1,800	1,942.00	3,495,600	
小野建	1,800	1,494.00	2,689,200	
南陽	100	1,101.00	110,100	
佐島電機	1,200	1,915.00	2,298,000	
エコートレーディング	100	909.00	90,900	
伯東	1,000	4,590.00	4,590,000	
コンドーテック	1,300	1,343.00	1,745,900	
ナガイレーベン	2,100	2,256.00	4,737,600	
三菱食品	1,500	4,845.00	7,267,500	
松田産業	1,300	3,170.00	4,121,000	
第一興商	6,500	1,854.00	12,051,000	
メディバルホールディングス	18,200	2,429.00	44,207,800	
S P K	700	2,062.00	1,443,400	
萩原電気ホールディングス	700	3,400.00	2,380,000	
アズワン	5,200	2,869.00	14,918,800	
スズデン	700	1,773.00	1,241,100	
シモジマ	1,100	1,316.00	1,447,600	
ドウシシャ	1,500	2,077.00	3,115,500	
高速	1,000	2,510.00	2,510,000	
たけびし	700	2,038.00	1,426,600	
リックス	400	2,708.00	1,083,200	
丸文	1,500	1,093.00	1,639,500	
ハビネット	1,300	4,065.00	5,284,500	
橋本総業ホールディングス	800	1,193.00	954,400	

日本ライフライン	4,500	1,280.00	5,760,000	
タカショー	1,600	485.00	776,000	
I D O M	5,700	1,008.00	5,745,600	
進和	1,000	2,719.00	2,719,000	
エスケイジャパン	100	656.00	65,600	
ダイトロン	700	2,829.00	1,980,300	
シークス	2,400	1,161.00	2,786,400	
オーハシテクニカ	800	1,711.00	1,368,800	
白銅	500	2,429.00	1,214,500	
伊藤忠商事	112,900	7,938.00	896,200,200	
丸紅	139,300	2,420.50	337,175,650	
高島	200	1,204.00	240,800	
長瀬産業	7,500	3,273.00	24,547,500	
蝶理	900	4,060.00	3,654,000	
豊田通商	50,500	2,710.50	136,880,250	
三共生興	2,200	636.00	1,399,200	
兼松	7,000	2,566.50	17,965,500	
三井物産	251,600	3,270.00	822,732,000	
日本紙パルプ商事	8,000	666.00	5,328,000	
カメイ	1,800	1,956.00	3,520,800	
スターゼン	1,100	2,950.00	3,245,000	
山善	5,600	1,326.00	7,425,600	
椿本興業	900	1,907.00	1,716,300	
住友商事	100,700	3,306.00	332,914,200	
内田洋行	700	6,430.00	4,501,000	
三菱商事	322,500	2,783.50	897,678,750	
第一実業	1,600	2,580.00	4,128,000	
キャノンマーケティングジャパン	3,300	4,603.00	15,189,900	
西華産業	800	3,880.00	3,104,000	
佐藤商事	1,100	1,398.00	1,537,800	
東京産業	1,700	700.00	1,190,000	
ユアサ商事	1,400	4,740.00	6,636,000	
神鋼商事	400	6,190.00	2,476,000	
阪和興業	2,800	5,080.00	14,224,000	
正栄食品工業	1,100	4,415.00	4,856,500	
カナデン	1,200	1,456.00	1,747,200	
R Y O D E N	1,300	2,367.00	3,077,100	
岩谷産業	16,700	1,993.00	33,283,100	
ナイス	100	1,651.00	165,100	
ニチモウ	100	1,875.00	187,500	
極東貿易	1,000	1,469.00	1,469,000	
アステナホールディングス	3,100	518.00	1,605,800	

三愛オブリ	3,900	1,926.00	7,511,400	
稲畑産業	4,500	3,285.00	14,782,500	
G S I クレオス	900	2,038.00	1,834,200	
明和産業	2,400	644.00	1,545,600	
ワキタ	2,500	1,562.00	3,905,000	
東邦ホールディングス	4,500	4,345.00	19,552,500	
サンゲツ	4,200	2,806.00	11,785,200	
ミツウロコグループホールディングス	2,100	1,717.00	3,605,700	
シナネンホールディングス	500	6,200.00	3,100,000	
伊藤忠エネクス	4,200	1,623.00	6,816,600	
サンリオ	13,600	4,888.00	66,476,800	
サンワテクノス	800	2,153.00	1,722,400	
新光商事	2,200	971.00	2,136,200	
トーホー	700	2,677.00	1,873,900	
三信電気	700	2,057.00	1,439,900	
東陽テクニカ	1,500	1,547.00	2,320,500	
モスフードサービス	2,500	3,565.00	8,912,500	
加賀電子	3,400	2,827.00	9,611,800	
ソーダニッカ	1,600	1,149.00	1,838,400	
立花エレテック	1,000	2,560.00	2,560,000	
フォーバル	700	1,407.00	984,900	
P A L T A C	2,600	4,116.00	10,701,600	
三谷産業	2,900	317.00	919,300	
西本W i s m e t t a c ホールディングス	1,000	1,315.00	1,315,000	
コア商事ホールディングス	1,500	608.00	912,000	
K P P グループホールディングス	3,400	661.00	2,247,400	
ヤマタネ	700	3,405.00	2,383,500	
泉州電業	1,200	5,370.00	6,444,000	
トラスコ中山	3,500	2,241.00	7,843,500	
オートバックスセブン	5,800	1,416.00	8,212,800	
モリト	1,300	1,421.00	1,847,300	
加藤産業	2,100	4,070.00	8,547,000	
イエローハット	3,000	2,517.00	7,551,000	
J K ホールディングス	1,300	1,018.00	1,323,400	
日伝	1,000	3,035.00	3,035,000	
杉本商事	1,500	1,354.00	2,031,000	
因幡電機産業	4,700	3,786.00	17,794,200	
東テク	1,700	2,722.00	4,627,400	
ミスミグループ本社	25,400	2,594.50	65,900,300	
蔵王産業	100	2,440.00	244,000	
スズケン	5,500	4,799.00	26,394,500	
ジェコス	1,100	980.00	1,078,000	

サンエー	2,900	2,802.00	8,125,800	
カワチ薬品	1,300	2,500.00	3,250,000	
エービーシー・マート	7,400	3,048.00	22,555,200	
ハードオフコーポレーション	700	1,957.00	1,369,900	
アスクル	4,000	1,904.00	7,616,000	
ゲオホールディングス	1,900	1,536.00	2,918,400	
アダストリア	2,300	3,510.00	8,073,000	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	200	533.00	106,600	
くら寿司	2,000	4,080.00	8,160,000	
キャンドウ	600	3,255.00	1,953,000	
パルグループホールディングス	3,900	3,055.00	11,914,500	
エディオン	7,300	1,768.00	12,906,400	
サーラコーポレーション	3,500	825.00	2,887,500	
ハローズ	700	4,230.00	2,961,000	
フジオフードグループ本社	1,900	1,385.00	2,631,500	
あみやき亭	1,200	1,638.00	1,965,600	
大黒天物産	500	10,400.00	5,200,000	
ハニーズホールディングス	1,500	1,640.00	2,460,000	
ファーマライズホールディングス	200	617.00	123,400	
アルペン	1,400	2,024.00	2,833,600	
ハブ	200	739.00	147,800	
クオールホールディングス	2,100	1,348.00	2,830,800	
ジンズホールディングス	1,300	6,260.00	8,138,000	
ビックカメラ	10,100	1,653.00	16,695,300	
D C Mホールディングス	8,700	1,419.00	12,345,300	
M o n o t a R O	23,800	2,573.00	61,237,400	
東京一番フーズ	200	496.00	99,200	
J . フロント リテイリング	19,300	1,701.50	32,838,950	
ドトール・日レスホールディングス	3,000	2,250.00	6,750,000	
マツキヨココカラ＆カンパニー	29,600	2,059.50	60,961,200	
ブロンコビリー	1,000	3,770.00	3,770,000	
Z O Z O	12,500	4,896.00	61,200,000	
トレジャー・ファクトリー	1,200	1,344.00	1,612,800	
物語コーポレーション	3,000	3,500.00	10,500,000	
三越伊勢丹ホールディングス	25,500	2,307.00	58,828,500	
H a m e e	800	1,043.00	834,400	
ウエルシアホールディングス	8,700	1,874.00	16,303,800	
クリエイトSDホールディングス	2,400	2,958.00	7,099,200	
丸善C H I ホールディングス	700	316.00	221,200	
ティーライフ	100	1,199.00	119,900	
シュッピン	1,700	1,069.00	1,817,300	
オイシックス・ラ・大地	2,700	1,244.00	3,358,800	

ネクステージ	3,800	1,547.00	5,878,600	
ジョイフル本田	4,700	1,998.00	9,390,600	
エターナルホスピタリティグループ	600	3,480.00	2,088,000	
ホットランド	1,300	2,338.00	3,039,400	
すかいらくホールディングス	23,000	2,375.50	54,636,500	
S F Pホールディングス	1,000	1,980.00	1,980,000	
綿半ホールディングス	1,300	1,631.00	2,120,300	
ヨシックスホールディングス	600	3,205.00	1,923,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,500	825.00	4,537,500	
B E E N O S	1,100	2,780.00	3,058,000	
あさひ	1,400	1,534.00	2,147,600	
日本調剤	1,100	1,309.00	1,439,900	
コスモス薬品	2,800	7,115.00	19,922,000	
トーエル	200	769.00	153,800	
セブン＆アイ・ホールディングス	185,600	2,205.00	409,248,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	12,700	1,210.00	15,367,000	
ツルハホールディングス	3,500	8,542.00	29,897,000	
サンマルクホールディングス	1,400	2,275.00	3,185,000	
トリドールホールディングス	4,700	3,941.00	18,522,700	
ウイルプラスホールディングス	100	1,090.00	109,000	
J Mホールディングス	1,300	2,857.00	3,714,100	
アレンザホールディングス	1,300	1,088.00	1,414,400	
串カツ田中ホールディングス	600	1,546.00	927,600	
パロックジャパンリミテッド	2,000	776.00	1,552,000	
クスリのアオキホールディングス	5,600	3,167.00	17,735,200	
力の源ホールディングス	1,300	1,080.00	1,404,000	
FOOD & LIFE COMPANIE	9,000	2,948.00	26,532,000	
メディカルシステムネットワーク	2,100	415.00	871,500	
一家ホールディングス	200	669.00	133,800	
ノジマ	5,500	2,170.00	11,935,000	
カップ・クリエイト	2,700	1,603.00	4,328,100	
良品計画	20,000	2,634.00	52,680,000	
アドヴァングループ	1,500	951.00	1,426,500	
アルビス	600	2,665.00	1,599,000	
ハウス オブ ローゼ	100	1,462.00	146,200	
G - 7ホールディングス	1,800	1,480.00	2,664,000	
イオン北海道	4,200	887.00	3,725,400	
コジマ	3,200	1,056.00	3,379,200	
コーナン商事	1,900	3,565.00	6,773,500	
エコス	600	2,047.00	1,228,200	
ワタミ	2,000	1,058.00	2,116,000	

パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	34,000	3,847.00	130,798,000	
西松屋チェーン	3,700	2,197.00	8,128,900	
ゼンショーホールディングス	9,500	7,783.00	73,938,500	
幸楽苑	1,300	1,271.00	1,652,300	
サイゼリヤ	2,500	5,780.00	14,450,000	
V Tホールディングス	6,600	469.00	3,095,400	
魚力	600	2,397.00	1,438,200	
フジ・コーポレーション	800	1,869.00	1,495,200	
ユナイテッドアローズ	1,800	2,253.00	4,055,400	
ハイデイ日高	2,700	2,713.00	7,325,100	
コロワイド	9,500	1,688.50	16,040,750	
壱番屋	6,700	1,035.00	6,934,500	
スギホールディングス	9,000	2,573.00	23,157,000	
薬王堂ホールディングス	800	2,051.00	1,640,800	
スクロール	2,500	1,017.00	2,542,500	
ヨンドシーホールディングス	1,600	1,839.00	2,942,400	
木曽路	2,600	2,255.00	5,863,000	
S R Sホールディングス	2,800	1,140.00	3,192,000	
千趣会	3,500	314.00	1,099,000	
リテールパートナーズ	2,500	1,315.00	3,287,500	
上新電機	1,700	2,493.00	4,238,100	
日本瓦斯	8,000	2,073.50	16,588,000	
ロイヤルホールディングス	3,000	2,468.00	7,404,000	
いなげや	1,200	1,169.00	1,402,800	
チヨダ	1,600	1,392.00	2,227,200	
ライフコーポレーション	1,800	3,300.00	5,940,000	
リンガーハット	2,200	2,290.00	5,038,000	
M r M a x H D	2,200	663.00	1,458,600	
A O K Iホールディングス	3,600	1,190.00	4,284,000	
オークワ	2,700	894.00	2,413,800	
コメリ	2,300	3,250.00	7,475,000	
青山商事	3,600	1,334.00	4,802,400	
しまむら	3,900	7,830.00	30,537,000	
はせがわ	400	305.00	122,000	
高島屋	23,400	1,225.50	28,676,700	
松屋	2,900	843.00	2,444,700	
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,200	1,961.50	16,084,300	
近鉄百貨店	1,000	2,051.00	2,051,000	
丸井グループ	11,200	2,404.50	26,930,400	
アクシアル リテイリング	4,600	878.00	4,038,800	
イオン	62,100	3,795.00	235,669,500	
イズミ	2,600	3,195.00	8,307,000	

平和堂	2,800	2,166.00	6,064,800	
フジ	3,100	2,027.00	6,283,700	
ヤオコー	2,000	9,096.00	18,192,000	
ゼビオホールディングス	2,300	1,158.00	2,663,400	
ケーズホールディングス	11,300	1,412.00	15,955,600	
日産東京販売ホールディングス	600	433.00	259,800	
シルバーライフ	700	725.00	507,500	
Genky DrugStores	1,500	3,035.00	4,552,500	
ナルミヤ・インターナショナル	100	1,215.00	121,500	
ブックオフグループホールディングス	1,200	1,463.00	1,755,600	
ギフトホールディングス	800	3,400.00	2,720,000	
アインホールディングス	2,300	4,890.00	11,247,000	
Genki Global Dining	1,000	4,035.00	4,035,000	
ヤマダホールディングス	51,700	431.80	22,324,060	
アークランズ	5,000	1,666.00	8,330,000	
ニトリホールディングス	6,100	18,685.00	113,978,500	
グルメ杵屋	1,400	1,032.00	1,444,800	
ケーユーホールディングス	1,000	1,082.00	1,082,000	
吉野家ホールディングス	6,600	3,129.00	20,651,400	
松屋フーズホールディングス	800	6,390.00	5,112,000	
サガミホールディングス	2,700	1,846.00	4,984,200	
王将フードサービス	3,300	3,005.00	9,916,500	
ミニストップ	1,400	1,764.00	2,469,600	
アークス	2,800	2,489.00	6,969,200	
バローホールディングス	3,200	2,089.00	6,684,800	
ベルク	800	6,430.00	5,144,000	
大庄	1,000	1,041.00	1,041,000	
ファーストリテイリング	9,400	50,350.00	473,290,000	
サンドラッグ	5,700	3,758.00	21,420,600	
サックスパー ホールディングス	1,600	919.00	1,470,400	
やまや	100	2,835.00	283,500	
ベルーナ	4,100	733.00	3,005,300	
いよぎんホールディングス	20,500	1,563.00	32,041,500	
しずおかフィナンシャルグループ	34,400	1,294.50	44,530,800	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	13,100	1,597.00	20,920,700	
楽天銀行	7,200	3,200.00	23,040,000	
京都フィナンシャルグループ	19,700	2,343.50	46,166,950	
じもとホールディングス	400	305.00	122,000	
めぶきフィナンシャルグループ	78,500	618.70	48,567,950	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	4,150.00	8,300,000	
九州フィナンシャルグループ	27,500	782.10	21,507,750	
ゆうちょ銀行	128,900	1,420.00	183,038,000	

富山第一銀行	4,900	1,151.00	5,639,900	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	83,200	824.40	68,590,080	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,600	1,783.00	17,116,800	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,748.00	2,447,200	
第四北越フィナンシャルグループ	4,900	2,537.00	12,431,300	
ひろぎんホールディングス	22,000	1,180.00	25,960,000	
おきなわフィナンシャルグループ	1,200	2,310.00	2,772,000	
十六フィナンシャルグループ	2,200	4,270.00	9,394,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,500	4,580.00	6,870,000	
プロクレアホールディングス	1,800	1,739.00	3,130,200	
あいちフィナンシャルグループ	2,900	2,360.00	6,844,000	
あおぞら銀行	10,800	2,710.50	29,273,400	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,025,400	1,715.50	1,759,073,700	代用有価証券 90,000株
りそなホールディングス	193,100	1,098.00	212,023,800	
三井住友トラストグループ	55,700	3,533.00	196,788,100	
三井住友フィナンシャルグループ	326,200	3,473.00	1,132,892,600	
千葉銀行	48,400	1,218.50	58,975,400	
群馬銀行	27,800	955.00	26,549,000	
武蔵野銀行	2,400	2,829.00	6,789,600	
千葉興業銀行	3,700	1,160.00	4,292,000	
筑波銀行	6,800	236.00	1,604,800	
七十七銀行	5,000	4,264.00	21,320,000	
秋田銀行	1,000	2,147.00	2,147,000	
山形銀行	1,700	993.00	1,688,100	
岩手銀行	1,000	2,395.00	2,395,000	
東邦銀行	13,400	266.00	3,564,400	
東北銀行	200	1,072.00	214,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	13,600	3,705.00	50,388,000	
スルガ銀行	10,500	1,092.00	11,466,000	
八十二銀行	36,600	882.50	32,299,500	
山梨中央銀行	1,800	1,750.00	3,150,000	
大垣共立銀行	3,000	1,879.00	5,637,000	
福井銀行	1,400	1,829.00	2,560,600	
清水銀行	700	1,461.00	1,022,700	
滋賀銀行	2,400	3,405.00	8,172,000	
南都銀行	2,300	3,135.00	7,210,500	
百五銀行	14,700	587.00	8,628,900	
紀陽銀行	5,600	1,856.00	10,393,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	8,800	1,716.50	15,105,200	
山陰合同銀行	9,800	1,297.00	12,710,600	
鳥取銀行	100	1,223.00	122,300	
百十四銀行	1,500	2,625.00	3,937,500	

四国銀行	2,300	974.00	2,240,200	
阿波銀行	2,200	2,565.00	5,643,000	
大分銀行	900	3,240.00	2,916,000	
宮崎銀行	1,000	2,841.00	2,841,000	
佐賀銀行	900	2,147.00	1,932,300	
琉球銀行	3,600	1,024.00	3,686,400	
セブン銀行	55,900	333.00	18,614,700	
みずほフィナンシャルグループ	211,100	3,452.00	728,717,200	
山口フィナンシャルグループ	15,300	1,606.00	24,571,800	
名古屋銀行	1,000	6,240.00	6,240,000	
北洋銀行	21,300	419.00	8,924,700	
大光銀行	100	1,390.00	139,000	
愛媛銀行	2,300	1,070.00	2,461,000	
トマト銀行	100	1,118.00	111,800	
京葉銀行	7,000	723.00	5,061,000	
栃木銀行	7,100	273.00	1,938,300	
北日本銀行	600	2,627.00	1,576,200	
東和銀行	2,900	598.00	1,734,200	
大東銀行	200	701.00	140,200	
トモニホールディングス	14,900	412.00	6,138,800	
フィデアホールディングス	1,600	1,460.00	2,336,000	
池田泉州ホールディングス	21,600	352.00	7,603,200	
F P G	5,600	2,769.00	15,506,400	
ジャパンインベストメントアドバイザー	2,500	1,110.00	2,775,000	
マーキュリアホールディングス	200	870.00	174,000	
S B I ホールディングス	25,200	3,536.00	89,107,200	
ジャフコ グループ	4,600	2,042.00	9,393,200	
大和証券グループ本社	111,800	1,059.00	118,396,200	
野村ホールディングス	263,000	871.30	229,151,900	
岡三証券グループ	12,300	619.00	7,613,700	
丸三証券	5,200	947.00	4,924,400	
東洋証券	4,700	524.00	2,462,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,500	473.00	8,750,500	
水戸証券	4,300	501.00	2,154,300	
いちよし証券	3,100	823.00	2,551,300	
松井証券	10,700	821.00	8,784,700	
マネックスグループ	15,300	797.00	12,194,100	
極東証券	2,000	1,301.00	2,602,000	
岩井コスモホールディングス	1,800	2,111.00	3,799,800	
アイザワ証券グループ	2,300	1,710.00	3,933,000	
スパークス・グループ	1,700	1,415.00	2,405,500	
かんぽ生命保険	18,200	2,587.00	47,083,400	

F P パートナー	700	2,991.00	2,093,700	
S O M P O ホールディングス	76,400	3,394.00	259,301,600	
アニコム ホールディングス	5,300	666.00	3,529,800	
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	114,600	3,528.00	404,308,800	
第一生命ホールディングス	73,500	3,981.00	292,603,500	
東京海上ホールディングス	152,600	5,743.00	876,381,800	
T & D ホールディングス	42,000	2,510.00	105,420,000	
アドバンスクリエイト	1,200	755.00	906,000	
N E X Y Z . G r o u p	100	771.00	77,100	
全国保証	4,100	5,474.00	22,443,400	
あんしん保証	300	170.00	51,000	
ジェイリース	1,200	1,398.00	1,677,600	
イントラスト	200	761.00	152,200	
日本モーゲージサービス	200	421.00	84,200	
S B I アルヒ	1,600	817.00	1,307,200	
プレミアグループ	2,600	2,318.00	6,026,800	
ネットプロテクションズホールディングス	5,200	340.00	1,768,000	
クレディセゾン	9,900	3,530.00	34,947,000	
芙蓉総合リース	1,400	11,160.00	15,624,000	
みずほリース	11,700	1,031.00	12,062,700	
東京センチュリー	11,700	1,545.50	18,082,350	
日本証券金融	5,700	1,983.00	11,303,100	
アイフル	25,900	324.00	8,391,600	
リコーリース	1,500	5,070.00	7,605,000	
イオンフィナンシャルサービス	9,000	1,248.50	11,236,500	
アコム	37,200	362.60	13,488,720	
ジャックス	1,900	3,810.00	7,239,000	
オリエントコーポレーション	5,100	839.00	4,278,900	
オリックス	93,800	3,315.00	310,947,000	
三菱H C キャピタル	78,400	1,046.00	82,006,400	
日本取引所グループ	93,000	1,887.50	175,537,500	
イー・ギャランティ	2,600	1,519.00	3,949,400	
N E C キャピタルソリューション	800	3,735.00	2,988,000	
大東建託	5,300	17,050.00	90,365,000	
サムティホールディングス	3,100	3,295.00	10,214,500	
いちご	13,200	405.00	5,346,000	
日本駐車場開発	18,700	227.00	4,244,900	
スター・マイカ・ホールディングス	1,700	655.00	1,113,500	
S R E ホールディングス	600	3,780.00	2,268,000	
ヒューリック	36,500	1,450.00	52,925,000	
野村不動産ホールディングス	9,800	3,853.00	37,759,400	
三重交通グループホールディングス	3,400	500.00	1,700,000	

ディア・ライフ	2,700	861.00	2,324,700	
コーセーアールイー	200	701.00	140,200	
地主	1,400	2,131.00	2,983,400	
プレサンスコーポレーション	2,100	1,936.00	4,065,600	
T H E グローバル社	300	617.00	185,100	
J P M C	900	1,138.00	1,024,200	
サンセイランディック	200	934.00	186,800	
エストラスト	100	668.00	66,800	
フージャースホールディングス	2,400	1,021.00	2,450,400	
オープンハウスグループ	5,700	5,563.00	31,709,100	
東急不動産ホールディングス	47,000	982.50	46,177,500	
飯田グループホールディングス	15,000	2,166.00	32,490,000	
イーランド	100	1,355.00	135,500	
ムゲンエステート	200	1,795.00	359,000	
ビーロッド	200	1,168.00	233,600	
ファーストブラザーズ	100	1,121.00	112,100	
A n d D oホールディングス	1,000	1,056.00	1,056,000	
シーアールイー	800	1,201.00	960,800	
ケイアイスター不動産	800	3,820.00	3,056,000	
アグレ都市デザイン	100	1,620.00	162,000	
グッドコムアセット	1,300	810.00	1,053,000	
ジェイ・エス・ビー	700	2,726.00	1,908,200	
ロードスターキャピタル	900	2,367.00	2,130,300	
イノベーションホールディングス	200	915.00	183,000	
グローバル・リンク・マネジメント	100	2,380.00	238,000	
霞ヶ関キャピタル	600	15,230.00	9,138,000	
パーク 2 4	12,200	1,871.00	22,826,200	
パラカ	600	1,820.00	1,092,000	
ミガロホールディングス	100	1,689.00	168,900	
宮越ホールディングス	700	1,845.00	1,291,500	
三井不動産	217,000	1,353.50	293,709,500	
三菱地所	90,600	2,302.50	208,606,500	
平和不動産	2,500	4,200.00	10,500,000	
東京建物	13,700	2,583.50	35,393,950	
京阪神ビルディング	2,600	1,558.00	4,050,800	
住友不動産	25,400	4,808.00	122,123,200	
テーオーシー	2,800	607.00	1,699,600	
レオパレス 2 1	13,700	562.00	7,699,400	
スターツコーポレーション	2,600	3,455.00	8,983,000	
フジ住宅	2,000	759.00	1,518,000	
空港施設	2,300	581.00	1,336,300	
明和地所	1,300	979.00	1,272,700	

ゴールドクレスト	1,100	3,020.00	3,322,000	
エスリード	700	4,390.00	3,073,000	
日神グループホールディングス	2,600	506.00	1,315,600	
日本エスコン	4,100	997.00	4,087,700	
M I R A R T Hホールディングス	9,200	494.00	4,544,800	
イオンモール	9,500	2,031.50	19,299,250	
毎日コムネット	200	722.00	144,400	
カチタス	4,200	1,944.00	8,164,800	
トーセイ	2,600	2,470.00	6,422,000	
サンフロンティア不動産	2,600	1,854.00	4,820,400	
F Jネクストホールディングス	1,700	1,123.00	1,909,100	
グランディハウス	1,800	560.00	1,008,000	
日本空港ビルデング	5,500	5,590.00	30,745,000	
明豊ファシリティワークス	200	860.00	172,000	
M I X I	3,100	2,783.00	8,627,300	
ジェイエシーリクルートメント	6,000	724.00	4,344,000	
日本M & Aセンターホールディングス	24,000	704.00	16,896,000	
中広	200	447.00	89,400	
U Tグループ	2,100	2,673.00	5,613,300	
アイティメディア	900	1,560.00	1,404,000	
ケアネット	3,400	669.00	2,274,600	
E・Jホールディングス	1,000	1,706.00	1,706,000	
オープンアップグループ	4,900	1,985.00	9,726,500	
コシダカホールディングス	4,900	1,189.00	5,826,100	
アルトナー	100	1,753.00	175,300	
パソナグループ	2,000	1,982.00	3,964,000	
C D S	100	1,795.00	179,500	
リンクアンドモチベーション	4,100	546.00	2,238,600	
エス・エム・エス	6,300	1,702.00	10,722,600	
サニーサイドアップグループ	200	523.00	104,600	
パーソルホールディングス	152,400	254.00	38,709,600	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	300	732.00	219,600	
学情	900	1,717.00	1,545,300	
スタジオアリス	800	2,049.00	1,639,200	
エブコ	200	756.00	151,200	
N J S	400	3,995.00	1,598,000	
総合警備保障	27,300	1,064.50	29,060,850	
カカクコム	11,800	2,443.50	28,833,300	
アイロムグループ	700	2,777.00	1,943,900	
セントケア・ホールディング	1,300	734.00	954,200	
ルネサンス	1,300	1,019.00	1,324,700	
ディップ	2,900	2,683.00	7,780,700	

デジタルホールディングス	1,000	1,016.00	1,016,000	
新日本科学	1,700	1,348.00	2,291,600	
キャリアデザインセンター	100	1,770.00	177,000	
エムスリー	32,300	1,513.50	48,886,050	
ツカダ・グローバルホールディング	400	409.00	163,600	
ウェルネット	300	888.00	266,400	
ワールドホールディングス	700	1,922.00	1,345,400	
ディー・エヌ・エー	6,500	1,963.00	12,759,500	
博報堂ＤＹホールディングス	18,500	1,217.50	22,523,750	
ぐるなび	3,200	307.00	982,400	
タカミヤ	2,300	439.00	1,009,700	
ファンコミュニケーションズ	2,400	413.00	991,200	
ライク	700	1,375.00	962,500	
エスプール	5,200	356.00	1,851,200	
ＷＤＢホールディングス	900	1,724.00	1,551,600	
ティア	400	428.00	171,200	
アドウェイズ	2,500	333.00	832,500	
バリューコマース	1,400	1,086.00	1,520,400	
インフォマート	15,400	321.00	4,943,400	
ＪＰホールディングス	4,200	690.00	2,898,000	
プレスステージ・インターナショナル	7,700	668.00	5,143,600	
プロトコーポレーション	1,800	1,411.00	2,539,800	
アミューズ	1,000	1,337.00	1,337,000	
ドリームインキュベータ	500	2,857.00	1,428,500	
クイック	1,100	2,012.00	2,213,200	
電通グループ	17,700	4,838.00	85,632,600	
ぴあ	600	3,135.00	1,881,000	
イオンファンタジー	700	2,694.00	1,885,800	
シーティーエス	2,300	905.00	2,081,500	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	4,800	2,633.00	12,638,400	
アルプス技研	1,400	2,777.00	3,887,800	
日本空調サービス	1,800	1,025.00	1,845,000	
オリエンタルランド	97,200	3,751.00	364,597,200	
ダスキン	3,600	3,770.00	13,572,000	
明光ネットワークジャパン	2,100	685.00	1,438,500	
ファルコホールディングス	700	2,379.00	1,665,300	
ラウンドワン	15,400	961.00	14,799,400	
リゾートトラスト	6,400	2,748.50	17,590,400	
ビー・エム・エル	2,000	2,771.00	5,542,000	
リソー教育	10,300	283.00	2,914,900	
早稲田アカデミー	900	1,749.00	1,574,100	
ユー・エス・エス	33,600	1,293.50	43,461,600	

東京個別指導学院	2,300	397.00	913,100	
サイバーエージェント	36,100	1,030.00	37,183,000	
楽天グループ	115,000	933.00	107,295,000	
クリーク・アンド・リバー社	900	1,607.00	1,446,300	
S B I グローバルアセットマネジメント	3,200	620.00	1,984,000	
テー・オー・ダブリュー	3,300	321.00	1,059,300	
山田コンサルティンググループ	800	2,154.00	1,723,200	
セントラルスポーツ	600	2,465.00	1,479,000	
フルキャストホールディングス	1,300	1,524.00	1,981,200	
エン・ジャパン	2,700	2,402.00	6,485,400	
テクノプロ・ホールディングス	9,500	2,829.00	26,875,500	
アイ・アールジャパンホールディングス	1,000	857.00	857,000	
K e e P e r 技研	1,000	3,905.00	3,905,000	
楽待	200	691.00	138,200	
三機サービス	100	938.00	93,800	
G u n o s y	1,400	711.00	995,400	
イー・ガーディアン	800	1,785.00	1,428,000	
リブセンス	600	162.00	97,200	
ジャパンマテリアル	5,000	1,813.00	9,065,000	
ベクトル	2,200	948.00	2,085,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,400	1,250.00	1,750,000	
キャリアリンク	600	2,540.00	1,524,000	
I B J	1,500	666.00	999,000	
アサンテ	800	1,705.00	1,364,000	
バリューHR	1,500	1,781.00	2,671,500	
M & A キャピタルパートナーズ	1,300	2,526.00	3,283,800	
ライドオンエクスプレスホールディングス	800	1,002.00	801,600	
E R I ホールディングス	100	1,834.00	183,400	
シグマクシス・ホールディングス	2,400	1,668.00	4,003,200	
ウィルグループ	1,400	991.00	1,387,400	
メドピア	1,600	577.00	923,200	
レアジョブ	200	393.00	78,600	
リクルートホールディングス	127,300	9,321.00	1,186,563,300	
エラン	2,200	810.00	1,782,000	
日本郵政	182,800	1,437.50	262,775,000	
ベルシステム 2 4 ホールディングス	1,800	1,291.00	2,323,800	
鎌倉新書	1,700	531.00	902,700	
一蔵	200	510.00	102,000	
エアトリ	1,200	1,032.00	1,238,400	
ストライク	800	3,810.00	3,048,000	
ソラスト	4,500	480.00	2,160,000	
セラク	600	1,308.00	784,800	

インソース	3,500	1,044.00	3,654,000	
ペイカレント	12,000	5,043.00	60,516,000	
Orchestra Holdings	600	865.00	519,000	
アイモパイル	2,100	503.00	1,056,300	
MS - Japan	900	1,051.00	945,900	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,300	2,843.00	17,910,900	
グリーンズ	100	1,572.00	157,200	
エル・ティー・エス	300	1,750.00	525,000	
ミダックホールディングス	1,000	1,816.00	1,816,000	
キュービーネットホールディングス	1,000	1,010.00	1,010,000	
マネジメントソリューションズ	800	1,872.00	1,497,600	
プロレド・パートナーズ	700	478.00	334,600	
フロンティア・マネジメント	600	1,179.00	707,400	
コプロ・ホールディングス	200	1,390.00	278,000	
アンビスホールディングス	3,500	1,973.00	6,905,500	
カーブスホールディングス	4,500	796.00	3,582,000	
フォーラムエンジニアリング	1,900	884.00	1,679,600	
Fast Fitness Japan	700	1,329.00	930,300	
Mac bee Planet	500	2,678.00	1,339,000	
ポピンズ	400	1,420.00	568,000	
LITALICO	1,500	1,150.00	1,725,000	
コンフィデンス・インターワークス	100	1,682.00	168,200	
アドバンテッジリスクマネジメント	300	586.00	175,800	
リログループ	9,100	1,852.00	16,853,200	
東祥	1,400	679.00	950,600	
ID&Eホールディングス	1,000	4,270.00	4,270,000	
ビーウィズ	400	1,576.00	630,400	
サンウェルズ	600	1,752.00	1,051,200	
TREホールディングス	3,800	1,739.00	6,608,200	
人・夢・技術グループ	700	1,634.00	1,143,800	
NISSOホールディングス	1,500	822.00	1,233,000	
大栄環境	3,600	2,976.00	10,713,600	
日本管財ホールディングス	1,700	2,643.00	4,493,100	
M&A総研ホールディングス	1,800	2,296.00	4,132,800	
エイチ・アイ・エス	5,200	1,825.00	9,490,000	
ラックランド	700	1,981.00	1,386,700	
共立メンテナンス	5,100	2,480.00	12,648,000	
イチネンホールディングス	1,600	1,930.00	3,088,000	
建設技術研究所	800	4,580.00	3,664,000	
スペース	1,200	1,136.00	1,363,200	
燦ホールディングス	1,400	1,129.00	1,580,600	
スバル興業	600	3,245.00	1,947,000	

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

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

貸借対照表

（単位：円）

	2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
預金	408,433,421	208,762,095
コール・ローン	3,625,129,197	4,354,123,881
株式	302,865,738,679	434,547,773,298
投資証券	6,178,478,022	8,665,411,394
派生商品評価勘定	136,284,443	179,255,652
未収入金	1,337,338	36,110,325
未収配当金	156,767,619	188,032,829
未収利息	-	27,881
差入委託証拠金	415,280,406	591,070,886
流動資産合計	313,787,449,125	448,770,568,241
資産合計	313,787,449,125	448,770,568,241
負債の部		

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
1. 期首	2022年11月 8日	2023年11月 7日
期首元本額	59,202,311,151円	60,904,952,761円
期首からの追加設定元本額	9,450,699,077円	10,608,323,025円
期首からの一部解約元本額	7,748,057,467円	6,484,963,430円
元本の内訳		
インデックスファンド海外株式ヘッジなし（ＤＣ専用）	33,249,241,900円	36,199,095,327円
ＤＣインデックスバランス（株式２０）	117,741,897円	99,358,157円
ＤＣインデックスバランス（株式４０）	322,405,329円	287,223,552円
ＤＣインデックスバランス（株式６０）	682,562,314円	647,947,867円
ＤＣインデックスバランス（株式８０）	814,906,805円	834,515,823円
世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	1,252,135,558円	963,153,916円
日興五大陸株式ファンド	3,478,589,862円	3,421,767,621円
インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）	13,258,596円	- 円
インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	75,144,450円	62,045,402円
インデックスファンド先進国株式（適格機関投資家向け）	5,879,043,409円	5,592,442,193円
グローバル３倍３分法ファンド（適格機関投資家向け）	8,685,455,095円	6,883,396,555円
Tracers グローバル３分法（おとなのバランス）	8,712,673円	20,478,957円
インデックスファンドMSCIオール・カンントリー（全世界株式）	251,058,476円	4,135,452,006円

Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）	309,166,276円	620,098,981円
Niftyインデックスラップ世界10指数（均等型）	266,848円	574,085円
Niftyインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	151,348円	240,268円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,338,394,962円	955,818,454円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	16,033,125円	12,228,073円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	46,733,638円	39,026,317円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	73,720,471円	64,434,317円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	74,507,576円	65,796,773円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,215,722,153円	4,123,217,712円
計	60,904,952,761円	65,028,312,356円
2. 受益権の総数	60,904,952,761口	65,028,312,356口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

（2023年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	10,640,554,988
投資証券	496,097,102
合計	11,136,652,090

(2024年11月 6日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2023年11月 6日現在)

(単位：円)

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

(2024年11月 6日現在)

(単位：円)

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

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(2023年11月 6日現在)

(単位：円)

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

(2024年11月 6日現在)

(単位：円)

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

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年11月 6日現在		2024年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	5,1501円	1口当たり純資産額	6,8978円
(1万口当たり純資産額)	(51,501円)	(1万口当たり純資産額)	(68,978円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	APA CORP	18,890	23.57	445,237.30	
	BAKER HUGHES CO	47,175	38.58	1,820,011.50	
	CHENIERE ENERGY INC	9,880	192.58	1,902,690.40	
	CHEVRON CORP	77,801	153.41	11,935,451.41	
	CHORD ENERGY CORP	2,600	126.64	329,264.00	
	CONOCOPHILLIPS	51,626	109.21	5,638,075.46	
	COTERRA ENERGY INC	32,460	23.32	756,967.20	
	DEVON ENERGY CORPORATION	25,260	39.34	993,728.40	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,580	175.63	1,331,275.40	
	EOG RESOURCES INC	26,282	122.11	3,209,295.02	
	EQT CORP	23,250	37.54	872,805.00	

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

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

		SIMON PROPERTY GROUP INC	15,054	2,625,267.06	
		SUN COMMUNITIES INC	5,920	788,662.40	
		UDR INC	12,100	522,962.00	
		VENTAS INC	17,025	1,097,601.75	
		VICI PROPERTIES INC	45,610	1,461,344.40	
		WELLTOWER INC	27,660	3,737,419.20	
		WEYERHAEUSER CO	29,998	956,036.26	
		WP CAREY INC	8,610	480,265.80	
米ドル小計			567,757	49,896,292.61 (7,626,648,325)	
加ドル	新株予約権証券	CONSTELLATION SOFTWARE IN-40	810.00	—	
	新株予約権証券小計		810.00	— (—)	
	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	128,688.00	
	投資証券小計		2,800	128,688.00 (14,171,122)	
加ドル小計			3,610	128,688.00 (14,171,122)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	100,773.75	
		GECINA SA	1,950	189,247.50	
		KLEPIERRE	8,402	242,313.68	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,990	370,856.80	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,730	165,731.20	
ユーロ小計			24,997	1,068,922.93 (177,302,246)	
英ポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	158,412.80	
		SEGRO PLC	65,733	515,872.58	
英ポンド小計			92,357	674,285.38 (133,663,590)	
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	42,067	300,358.38	
		GOODMAN GROUP	70,642	2,564,304.60	
		GPT GROUP	71,335	335,987.85	
		MIRVAC GROUP	159,875	345,330.00	
		SCENTRE GROUP	280,871	974,622.37	
		STOCKLAND	102,400	527,360.00	
		VICINITY CENTRES	154,902	333,039.30	
豪ドル小計			882,092	5,381,002.50 (542,781,722)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	104,160	3,869,544.00	
香港ドル小計			104,160	3,869,544.00 (76,075,235)	
シンガ ポールド ル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,243	371,873.67	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	221,291	447,007.82	
シンガポールドル小計			359,534	818,881.49 (94,769,154)	

合計		8,665,411,394 (8,665,411,394)	
----	--	----------------------------------	--

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株予約権 証券時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 572銘柄	97.8%	—	—	75.9%
	投資証券 34銘柄	—	—	2.2%	1.7%
加ドル	株式 84銘柄	99.9%	—	—	3.2%
	新株予約権 証券 1銘柄	—	—	—	—
	投資証券 1銘柄	—	—	0.1%	0.0%
ユーロ	株式 211銘柄	99.5%	—	—	8.4%
	投資証券 5銘柄	—	—	0.5%	0.0%
英ポンド	株式 75銘柄	99.2%	—	—	3.8%
	投資証券 2銘柄	—	—	0.8%	0.0%
スイスフラン	株式 46銘柄	100.0%	—	—	2.5%
スウェーデンクローナ	株式 44銘柄	100.0%	—	—	0.8%
ノルウェークローネ	株式 11銘柄	100.0%	—	—	0.1%
デンマーククローネ	株式 16銘柄	100.0%	—	—	0.8%
豪ドル	株式 50銘柄	93.6%	—	—	1.8%
	投資証券 7銘柄	—	—	6.4%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%	—	—	0.0%
香港ドル	株式 23銘柄	96.5%	—	—	0.5%
	投資証券 1銘柄	—	—	3.5%	0.0%
シンガポールドル	株式 12銘柄	93.0%	—	—	0.3%
	投資証券 2銘柄	—	—	7.0%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%	—	—	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	53,075,666	148,041,415
国債証券	44,231,096,480	48,618,222,970
地方債証券	2,727,118,380	2,393,913,882
特殊債券	2,500,538,000	1,989,440,676
社債券	1,295,094,000	2,118,219,918
未収利息	102,092,835	111,755,447
前払費用	1,936,952	5,037,437

	2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
流動資産合計	50,910,952,313	55,384,631,745
資産合計	50,910,952,313	55,384,631,745
負債の部		
流動負債		
未払解約金	22,903,111	10,898,657
未払利息	9	-
流動負債合計	22,903,120	10,898,657
負債合計	22,903,120	10,898,657
純資産の部		
元本等		
元本	38,488,019,140	42,108,169,838
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	12,400,030,053	13,265,563,250
元本等合計	50,888,049,193	55,373,733,088
純資産合計	50,888,049,193	55,373,733,088
負債純資産合計	50,910,952,313	55,384,631,745

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
-----------------	--

（貸借対照表に関する注記）

	2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
1. 期首	2022年11月 8日	2023年11月 7日
期首元本額	35,316,879,855円	38,488,019,140円
期首からの追加設定元本額	4,833,830,321円	6,643,373,019円
期首からの一部解約元本額	1,662,691,036円	3,023,222,321円
元本の内訳		
ＤＣインデックスバランス（株式２０）	5,699,306,266円	6,711,526,424円
ＤＣインデックスバランス（株式４０）	5,467,907,582円	6,487,652,576円
ＤＣインデックスバランス（株式６０）	4,301,495,149円	5,406,430,000円
ＤＣインデックスバランス（株式８０）	771,286,086円	1,046,210,157円
インデックスファンド日本債券（ＤＣ専用）	2,209,100,357円	2,168,132,973円
世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	4,634,497,139円	4,627,294,198円
インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,729,528,043円	1,823,476,877円
Tracers グローバル３分法（おとなのバランス）	15,166,730円	41,834,402円
Ni つみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	1,006,379円	2,993,339円
Ni つみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）	1,134,007円	2,535,893円
国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	3,086,148,563円	2,957,890,403円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	1,573,090,800円	1,678,396,699円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	1,582,207,086円	1,774,689,724円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	932,525,480円	1,090,871,564円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	140,336,480円	168,510,780円
インデックスファンド日本債券（１年決算型）	5,934,750,434円	5,693,402,266円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	408,532,559円	426,321,563円

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

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

（2023年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（2024年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

合計	39,822,105
----	------------

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

(関連当事者との取引に関する注記)
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年11月 6日現在		2024年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.3222円	1口当たり純資産額	1.3150円
(1万口当たり純資産額)	(13,222円)	(1万口当たり純資産額)	(13,150円)

附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位 : 円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第 4 5 5 回利付国債 (2 年)	100,000,000	99,638,000	
	第 4 5 6 回利付国債 (2 年)	100,000,000	99,702,000	
	第 4 5 7 回利付国債 (2 年)	150,000,000	149,491,500	
	第 4 5 8 回利付国債 (2 年)	130,000,000	129,676,300	
	第 4 6 0 回利付国債 (2 年)	100,000,000	99,823,000	
	第 4 6 1 回利付国債 (2 年)	150,000,000	149,929,500	
	第 4 6 3 回利付国債 (2 年)	150,000,000	149,871,000	
	第 1 4 9 回利付国債 (5 年)	100,000,000	99,157,000	
	第 1 5 0 回利付国債 (5 年)	50,000,000	49,517,500	
	第 1 5 1 回利付国債 (5 年)	290,000,000	286,879,600	
	第 1 5 2 回利付国債 (5 年)	100,000,000	99,146,000	
	第 1 5 3 回利付国債 (5 年)	300,000,000	296,394,000	
	第 1 5 5 回利付国債 (5 年)	100,000,000	99,386,000	
	第 1 5 6 回利付国債 (5 年)	200,000,000	198,158,000	
	第 1 5 7 回利付国債 (5 年)	150,000,000	148,437,000	
	第 1 5 8 回利付国債 (5 年)	230,000,000	226,842,100	
	第 1 5 9 回利付国債 (5 年)	150,000,000	147,711,000	
	第 1 6 0 回利付国債 (5 年)	120,000,000	118,594,800	
	第 1 6 1 回利付国債 (5 年)	120,000,000	119,019,600	
	第 1 6 2 回利付国債 (5 年)	130,000,000	128,792,300	
	第 1 6 3 回利付国債 (5 年)	270,000,000	268,515,000	
	第 1 6 4 回利付国債 (5 年)	130,000,000	128,116,300	
	第 1 6 5 回利付国債 (5 年)	130,000,000	128,638,900	
	第 1 6 6 回利付国債 (5 年)	140,000,000	139,098,400	
	第 1 6 7 回利付国債 (5 年)	120,000,000	119,104,800	
	第 1 6 8 回利付国債 (5 年)	150,000,000	150,159,000	
	第 1 7 0 回利付国債 (5 年)	150,000,000	150,033,000	
	第 1 7 1 回利付国債 (5 年)	100,000,000	99,123,000	
	第 1 7 2 回利付国債 (5 年)	200,000,000	199,146,000	

第 1 回利付国債（ 4 0 年）	70,000,000	75,418,700	
第 2 回利付国債（ 4 0 年）	125,000,000	129,201,250	
第 3 回利付国債（ 4 0 年）	85,000,000	87,199,800	
第 4 回利付国債（ 4 0 年）	115,000,000	117,249,400	
第 5 回利付国債（ 4 0 年）	95,000,000	92,305,800	
第 6 回利付国債（ 4 0 年）	110,000,000	103,782,800	
第 7 回利付国債（ 4 0 年）	130,000,000	116,226,500	
第 8 回利付国債（ 4 0 年）	115,000,000	94,386,250	
第 9 回利付国債（ 4 0 年）	210,000,000	123,566,100	
第 1 0 回利付国債（ 4 0 年）	175,000,000	120,802,500	
第 1 1 回利付国債（ 4 0 年）	140,000,000	91,938,000	
第 1 2 回利付国債（ 4 0 年）	175,000,000	100,546,250	
第 1 3 回利付国債（ 4 0 年）	210,000,000	117,789,000	
第 1 4 回利付国債（ 4 0 年）	210,000,000	124,912,200	
第 1 5 回利付国債（ 4 0 年）	230,000,000	150,551,100	
第 1 6 回利付国債（ 4 0 年）	220,000,000	157,361,600	
第 1 7 回利付国債（ 4 0 年）	80,000,000	74,352,800	
第 1 回クライメート・トランジション利付国債（ 5 年）	60,000,000	59,359,800	
第 1 回クライメート・トランジション利付国債（ 1 0 年）	70,000,000	68,877,900	
第 2 回クライメート・トランジション利付国債（ 1 0 年）	50,000,000	50,258,000	
第 3 4 1 回利付国債（ 1 0 年）	700,000,000	699,531,000	
第 3 4 2 回利付国債（ 1 0 年）	630,000,000	627,473,700	
第 3 4 3 回利付国債（ 1 0 年）	645,000,000	641,478,300	
第 3 4 4 回利付国債（ 1 0 年）	700,000,000	695,331,000	
第 3 4 5 回利付国債（ 1 0 年）	660,000,000	654,944,400	
第 3 4 6 回利付国債（ 1 0 年）	460,000,000	456,071,600	
第 3 4 7 回利付国債（ 1 0 年）	680,000,000	673,492,400	
第 3 4 8 回利付国債（ 1 0 年）	500,000,000	494,550,000	
第 3 4 9 回利付国債（ 1 0 年）	590,000,000	582,754,800	
第 3 5 0 回利付国債（ 1 0 年）	540,000,000	532,585,800	
第 3 5 1 回利付国債（ 1 0 年）	435,000,000	428,361,900	
第 3 5 2 回利付国債（ 1 0 年）	420,000,000	412,918,800	
第 3 5 3 回利付国債（ 1 0 年）	400,000,000	392,592,000	
第 3 5 4 回利付国債（ 1 0 年）	325,000,000	318,357,000	
第 3 5 5 回利付国債（ 1 0 年）	350,000,000	342,289,500	
第 3 5 6 回利付国債（ 1 0 年）	350,000,000	341,558,000	
第 3 5 7 回利付国債（ 1 0 年）	560,000,000	545,686,400	
第 3 5 8 回利付国債（ 1 0 年）	390,000,000	379,470,000	
第 3 5 9 回利付国債（ 1 0 年）	420,000,000	408,034,200	
第 3 6 0 回利付国債（ 1 0 年）	580,000,000	562,443,400	

第361回利付国債（10年）	460,000,000	445,243,200	
第362回利付国債（10年）	400,000,000	386,316,000	
第363回利付国債（10年）	500,000,000	481,790,000	
第364回利付国債（10年）	500,000,000	480,650,000	
第365回利付国債（10年）	410,000,000	393,185,900	
第366回利付国債（10年）	480,000,000	462,542,400	
第367回利付国債（10年）	420,000,000	403,498,200	
第368回利付国債（10年）	450,000,000	431,127,000	
第369回利付国債（10年）	490,000,000	479,523,800	
第370回利付国債（10年）	420,000,000	409,957,800	
第371回利付国債（10年）	480,000,000	463,214,400	
第372回利付国債（10年）	500,000,000	497,935,000	
第373回利付国債（10年）	440,000,000	429,237,600	
第374回利付国債（10年）	410,000,000	405,932,800	
第375回利付国債（10年）	280,000,000	283,950,800	
第1回利付国債（30年）	50,000,000	55,242,500	
第3回利付国債（30年）	70,000,000	76,411,300	
第5回利付国債（30年）	80,000,000	87,851,200	
第6回利付国債（30年）	50,000,000	55,868,000	
第7回利付国債（30年）	50,000,000	55,763,000	
第8回利付国債（30年）	170,000,000	183,674,800	
第9回利付国債（30年）	70,000,000	73,453,100	
第10回利付国債（30年）	50,000,000	51,216,000	
第11回利付国債（30年）	70,000,000	75,107,900	
第12回利付国債（30年）	50,000,000	55,336,500	
第13回利付国債（30年）	180,000,000	197,598,600	
第14回利付国債（30年）	108,000,000	122,413,680	
第15回利付国債（30年）	147,000,000	167,963,670	
第16回利付国債（30年）	65,000,000	74,291,100	
第17回利付国債（30年）	50,000,000	56,718,000	
第18回利付国債（30年）	110,000,000	123,719,200	
第19回利付国債（30年）	40,000,000	44,968,800	
第20回利付国債（30年）	60,000,000	68,688,000	
第21回利付国債（30年）	70,000,000	78,710,800	
第22回利付国債（30年）	70,000,000	80,223,500	
第23回利付国債（30年）	75,000,000	85,947,750	
第24回利付国債（30年）	68,000,000	77,911,680	
第25回利付国債（30年）	60,000,000	67,374,000	
第26回利付国債（30年）	170,000,000	192,793,600	
第27回利付国債（30年）	89,000,000	101,896,990	
第28回利付国債（30年）	144,000,000	164,705,760	
第29回利付国債（30年）	176,000,000	198,748,000	

第30回利付国債（30年）	147,000,000	163,800,630	
第31回利付国債（30年）	160,000,000	175,752,000	
第32回利付国債（30年）	160,000,000	177,310,400	
第33回利付国債（30年）	195,000,000	207,363,000	
第34回利付国債（30年）	180,000,000	195,910,200	
第35回利付国債（30年）	193,000,000	203,794,490	
第36回利付国債（30年）	195,000,000	205,180,950	
第37回利付国債（30年）	211,000,000	217,977,770	
第38回利付国債（30年）	135,000,000	136,792,800	
第39回利付国債（30年）	135,000,000	138,622,050	
第40回利付国債（30年）	100,000,000	100,852,000	
第41回利付国債（30年）	130,000,000	128,700,000	
第42回利付国債（30年）	135,000,000	133,251,750	
第43回利付国債（30年）	125,000,000	123,097,500	
第44回利付国債（30年）	130,000,000	127,630,100	
第45回利付国債（30年）	140,000,000	132,330,800	
第46回利付国債（30年）	160,000,000	150,824,000	
第47回利付国債（30年）	155,000,000	148,330,350	
第48回利付国債（30年）	135,000,000	124,170,300	
第49回利付国債（30年）	140,000,000	128,289,000	
第50回利付国債（30年）	165,000,000	133,364,550	
第51回利付国債（30年）	160,000,000	114,624,000	
第52回利付国債（30年）	190,000,000	141,994,600	
第53回利付国債（30年）	135,000,000	102,709,350	
第54回利付国債（30年）	160,000,000	126,899,200	
第55回利付国債（30年）	140,000,000	110,566,400	
第56回利付国債（30年）	140,000,000	110,096,000	
第57回利付国債（30年）	190,000,000	148,781,400	
第58回利付国債（30年）	180,000,000	140,351,400	
第59回利付国債（30年）	170,000,000	128,766,500	
第60回利付国債（30年）	120,000,000	94,989,600	
第61回利付国債（30年）	130,000,000	97,506,500	
第62回利付国債（30年）	120,000,000	84,945,600	
第63回利付国債（30年）	120,000,000	82,161,600	
第64回利付国債（30年）	130,000,000	88,475,400	
第65回利付国債（30年）	140,000,000	94,710,000	
第66回利付国債（30年）	180,000,000	120,951,000	
第67回利付国債（30年）	165,000,000	116,772,150	
第68回利付国債（30年）	140,000,000	98,600,600	
第69回利付国債（30年）	145,000,000	104,502,950	
第70回利付国債（30年）	140,000,000	100,433,200	
第71回利付国債（30年）	160,000,000	114,244,800	

第 7 2 回利付国債（ 3 0 年）	160,000,000	113,710,400	
第 7 3 回利付国債（ 3 0 年）	150,000,000	106,107,000	
第 7 4 回利付国債（ 3 0 年）	150,000,000	114,840,000	
第 7 5 回利付国債（ 3 0 年）	150,000,000	123,726,000	
第 7 6 回利付国債（ 3 0 年）	150,000,000	126,427,500	
第 7 7 回利付国債（ 3 0 年）	130,000,000	114,754,900	
第 7 8 回利付国債（ 3 0 年）	150,000,000	125,746,500	
第 7 9 回利付国債（ 3 0 年）	140,000,000	111,120,800	
第 8 0 回利付国債（ 3 0 年）	130,000,000	119,447,900	
第 8 1 回利付国債（ 3 0 年）	150,000,000	131,116,500	
第 8 2 回利付国債（ 3 0 年）	150,000,000	137,335,500	
第 8 3 回利付国債（ 3 0 年）	150,000,000	150,000,000	
第 8 4 回利付国債（ 3 0 年）	50,000,000	48,878,500	
第 8 7 回利付国債（ 2 0 年）	130,000,000	133,192,800	
第 8 8 回利付国債（ 2 0 年）	300,000,000	308,979,000	
第 9 0 回利付国債（ 2 0 年）	16,000,000	16,517,280	
第 9 1 回利付国債（ 2 0 年）	250,000,000	258,545,000	
第 9 2 回利付国債（ 2 0 年）	60,000,000	62,063,400	
第 9 3 回利付国債（ 2 0 年）	60,000,000	62,168,400	
第 9 4 回利付国債（ 2 0 年）	50,000,000	51,924,000	
第 9 5 回利付国債（ 2 0 年）	82,000,000	85,899,920	
第 9 6 回利付国債（ 2 0 年）	248,000,000	258,480,480	
第 9 7 回利付国債（ 2 0 年）	45,000,000	47,196,450	
第 9 8 回利付国債（ 2 0 年）	94,000,000	98,322,120	
第 9 9 回利付国債（ 2 0 年）	117,000,000	122,784,480	
第 1 0 0 回利付国債（ 2 0 年）	80,000,000	84,499,200	
第 1 0 1 回利付国債（ 2 0 年）	66,000,000	70,148,760	
第 1 0 2 回利付国債（ 2 0 年）	81,000,000	86,420,520	
第 1 0 3 回利付国債（ 2 0 年）	71,000,000	75,499,270	
第 1 0 4 回利付国債（ 2 0 年）	33,000,000	34,856,910	
第 1 0 5 回利付国債（ 2 0 年）	77,000,000	81,582,270	
第 1 0 6 回利付国債（ 2 0 年）	62,000,000	65,924,600	
第 1 0 7 回利付国債（ 2 0 年）	130,000,000	138,140,600	
第 1 0 8 回利付国債（ 2 0 年）	134,000,000	141,312,380	
第 1 0 9 回利付国債（ 2 0 年）	107,000,000	113,107,560	
第 1 1 0 回利付国債（ 2 0 年）	98,000,000	104,428,800	
第 1 1 1 回利付国債（ 2 0 年）	95,000,000	101,941,650	
第 1 1 2 回利付国債（ 2 0 年）	80,000,000	85,486,400	
第 1 1 3 回利付国債（ 2 0 年）	290,000,000	310,723,400	
第 1 1 4 回利付国債（ 2 0 年）	52,000,000	55,900,520	
第 1 1 5 回利付国債（ 2 0 年）	125,000,000	134,997,500	
第 1 1 6 回利付国債（ 2 0 年）	135,000,000	146,300,850	

第117回利付国債（20年）	243,000,000	262,077,930	
第118回利付国債（20年）	70,000,000	75,324,200	
第119回利付国債（20年）	60,000,000	63,912,000	
第120回利付国債（20年）	170,000,000	179,186,800	
第121回利付国債（20年）	142,000,000	152,377,360	
第122回利付国債（20年）	17,000,000	18,146,140	
第123回利付国債（20年）	195,000,000	212,072,250	
第124回利付国債（20年）	90,000,000	97,348,500	
第125回利付国債（20年）	90,000,000	98,705,700	
第126回利付国債（20年）	105,000,000	113,836,800	
第127回利付国債（20年）	50,000,000	53,902,000	
第128回利付国債（20年）	135,000,000	145,797,300	
第129回利付国債（20年）	85,000,000	91,258,550	
第130回利付国債（20年）	150,000,000	161,287,500	
第131回利付国債（20年）	92,000,000	98,318,560	
第132回利付国債（20年）	135,000,000	144,445,950	
第133回利付国債（20年）	130,000,000	139,980,100	
第134回利付国債（20年）	120,000,000	129,379,200	
第135回利付国債（20年）	70,000,000	74,980,500	
第136回利付国債（20年）	70,000,000	74,463,900	
第137回利付国債（20年）	100,000,000	107,153,000	
第138回利付国債（20年）	120,000,000	126,804,000	
第139回利付国債（20年）	100,000,000	106,430,000	
第140回利付国債（20年）	318,000,000	341,077,260	
第141回利付国債（20年）	235,000,000	252,082,150	
第142回利付国債（20年）	165,000,000	178,323,750	
第143回利付国債（20年）	154,000,000	163,979,200	
第144回利付国債（20年）	130,000,000	137,348,900	
第145回利付国債（20年）	215,000,000	230,688,550	
第146回利付国債（20年）	195,000,000	209,186,250	
第147回利付国債（20年）	208,000,000	221,106,080	
第148回利付国債（20年）	220,000,000	231,598,400	
第149回利付国債（20年）	225,000,000	236,423,250	
第150回利付国債（20年）	250,000,000	259,915,000	
第151回利付国債（20年）	240,000,000	244,634,400	
第152回利付国債（20年）	250,000,000	254,217,500	
第153回利付国債（20年）	270,000,000	276,577,200	
第154回利付国債（20年）	230,000,000	232,796,800	
第155回利付国債（20年）	270,000,000	267,059,700	
第156回利付国債（20年）	200,000,000	184,552,000	
第157回利付国債（20年）	220,000,000	197,267,400	
第158回利付国債（20年）	230,000,000	212,720,100	

	第 1 5 9 回利付国債（ 2 0 年 ）	210,000,000	195,736,800	
	第 1 6 0 回利付国債（ 2 0 年 ）	210,000,000	197,311,800	
	第 1 6 1 回利付国債（ 2 0 年 ）	180,000,000	166,341,600	
	第 1 6 2 回利付国債（ 2 0 年 ）	210,000,000	193,260,900	
	第 1 6 3 回利付国債（ 2 0 年 ）	195,000,000	178,600,500	
	第 1 6 4 回利付国債（ 2 0 年 ）	255,000,000	229,420,950	
	第 1 6 5 回利付国債（ 2 0 年 ）	200,000,000	179,004,000	
	第 1 6 6 回利付国債（ 2 0 年 ）	180,000,000	164,791,800	
	第 1 6 7 回利付国債（ 2 0 年 ）	200,000,000	177,110,000	
	第 1 6 8 回利付国債（ 2 0 年 ）	180,000,000	156,322,800	
	第 1 6 9 回利付国債（ 2 0 年 ）	190,000,000	161,600,700	
	第 1 7 0 回利付国債（ 2 0 年 ）	160,000,000	135,259,200	
	第 1 7 1 回利付国債（ 2 0 年 ）	170,000,000	142,835,700	
	第 1 7 2 回利付国債（ 2 0 年 ）	230,000,000	195,237,800	
	第 1 7 3 回利付国債（ 2 0 年 ）	190,000,000	160,310,600	
	第 1 7 4 回利付国債（ 2 0 年 ）	200,000,000	167,820,000	
	第 1 7 5 回利付国債（ 2 0 年 ）	200,000,000	169,744,000	
	第 1 7 6 回利付国債（ 2 0 年 ）	190,000,000	160,398,000	
	第 1 7 7 回利付国債（ 2 0 年 ）	200,000,000	165,030,000	
	第 1 7 8 回利付国債（ 2 0 年 ）	220,000,000	183,823,200	
	第 1 7 9 回利付国債（ 2 0 年 ）	220,000,000	182,813,400	
	第 1 8 0 回利付国債（ 2 0 年 ）	190,000,000	165,630,600	
	第 1 8 1 回利付国債（ 2 0 年 ）	210,000,000	185,463,600	
	第 1 8 2 回利付国債（ 2 0 年 ）	200,000,000	182,056,000	
	第 1 8 3 回利付国債（ 2 0 年 ）	190,000,000	181,100,400	
	第 1 8 4 回利付国債（ 2 0 年 ）	200,000,000	180,676,000	
	第 1 8 5 回利付国債（ 2 0 年 ）	200,000,000	179,976,000	
	第 1 8 6 回利付国債（ 2 0 年 ）	200,000,000	192,090,000	
	第 1 8 7 回利付国債（ 2 0 年 ）	170,000,000	157,350,300	
	第 1 8 8 回利付国債（ 2 0 年 ）	175,000,000	169,851,500	
	第 1 8 9 回利付国債（ 2 0 年 ）	160,000,000	162,790,400	
	第 1 9 0 回利付国債（ 2 0 年 ）	50,000,000	49,926,500	
国債証券 合計		50,610,000,000	48,618,222,970	
地方債証券	第 2 6 回東京都公募公債（ 2 0 年 ）	100,000,000	106,686,000	
	令和 3 年度第 6 回北海道公募公債（ 5 年 ）	100,000,000	99,071,000	
	平成 2 2 年度第 1 回福岡県公募公債（ 1 5 年 ）	100,000,000	101,276,000	
	第 2 2 回群馬県公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	96,651,000	
	第 2 4 回群馬県公募公債（ 1 0 年 ）	100,000,000	95,399,000	
	令和 2 年度第 2 回大分県公募公債	100,000,000	96,504,000	
	第 1 6 5 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,252,000	
	第 2 0 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,888,000	
	第 2 5 3 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,477,000	

	第 2 5 4 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,536,000	
	第 2 5 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,306,000	
	平成 2 8 年度第 1 回長崎県公募公債	100,000,000	99,156,000	
	平成 2 7 年度第 1 回佐賀県公募公債	100,000,000	100,039,000	
	平成 2 9 年度第 1 回滋賀県公募公債	100,000,000	98,737,000	
	令和 2 年度第 1 回滋賀県公募公債	100,000,000	96,433,000	
	平成 2 7 年度第 2 回熊本県公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	100,083,467	
	第 2 回名古屋市定時償還公募公債（ 1 0 年）	10,000,000	10,006,412	
	平成 2 7 年度第 5 回札幌市公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	100,116,912	
	第 1 8 回川崎市公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	104,730,000	
	令和 2 年度第 1 回鹿児島県公募公債（ 5 年）	100,000,000	99,638,091	
	平成 2 6 年度第 1 回福井県公募公債	100,000,000	103,894,000	
	令和 6 年度第 1 回福井県公募公債	100,000,000	99,879,000	
	令和 3 年度第 1 回山梨県公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	95,603,000	
	令和元年度第 1 回秋田県公募公債	100,000,000	96,552,000	
地方債証券 合計		2,410,000,000	2,393,913,882	
特殊債券	第 5 回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	99,089,000	
	第 3 5 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	198,110,000	
	第 6 0 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	98,834,000	
	第 2 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,046,000	
	第 4 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,153,000	
	第 2 5 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,020,676	
	第 2 7 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,324,000	
	第 3 2 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	197,368,000	
	第 3 5 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,413,000	
	第 9 6 回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	197,894,000	
	第 9 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,959,000	
	第 1 0 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	197,584,000	
	第 5 2 回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	98,318,000	
	第 3 9 5 回信金中金債（ 5 年）	100,000,000	98,608,000	
	第 4 0 5 回信金中金債（ 5 年）	100,000,000	98,669,000	
	第 3 7 回国際協力機構債券	100,000,000	99,051,000	
特殊債券 合計		2,000,000,000	1,989,440,676	
社債券	第 2 2 回味の素株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,628,000	
	第 2 5 回味の素株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,160,000	
	第 2 4 回森ビル株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	98,045,000	

第17回株式会社オリエンタルランド無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	98,320,000	
第17回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）（ソーシャルボンド）	100,000,000	98,655,000	
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,466,000	
第53回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	105,390,000	
第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,742,918	
第23回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	200,000,000	212,296,000	
第32回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特約付）	200,000,000	208,952,000	
第510回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,238,000	
第400回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	98,730,000	
第447回中国電力株式会社社債（一般担保付）（トランジションボンド）	100,000,000	98,724,000	
第323回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,515,000	
第8回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,396,000	
第28回東京瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	104,069,000	
第32回大阪瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	103,469,000	
第47回大阪瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	96,163,000	
第51回大阪瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	97,261,000	
社債券 合計	2,100,000,000	2,118,219,918	
合計	57,120,000,000	55,119,797,446	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,963,583,952	1,448,185,665
コール・ローン	45,069,283	66,362,680
国債証券	157,183,727,561	164,910,542,863
派生商品評価勘定	690,022	-
未収入金	800,413,612	1,433,949,952
未収利息	1,214,002,062	1,427,466,902
前払費用	68,585,401	87,694,849
流動資産合計	161,276,071,893	169,374,202,911
資産合計	161,276,071,893	169,374,202,911
負債の部		

	2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
流動負債		
派生商品評価勘定	943,122	730,970
未払金	1,989,822,440	2,023,489,851
未払解約金	112,706,558	192,707,201
未払利息	8	-
流動負債合計	2,103,472,128	2,216,928,022
負債合計	2,103,472,128	2,216,928,022
純資産の部		
元本等		
元本	57,347,654,284	55,030,512,735
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	101,824,945,481	112,126,762,154
元本等合計	159,172,599,765	167,157,274,889
純資産合計	159,172,599,765	167,157,274,889
負債純資産合計	161,276,071,893	169,374,202,911

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

	2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
1. 期首	2022年11月 8日	2023年11月 7日
期首元本額	57,628,255,000円	57,347,654,284円
期首からの追加設定元本額	3,684,113,225円	3,572,494,617円
期首からの一部解約元本額	3,964,713,941円	5,889,636,166円
元本の内訳		
インデックスファンド海外債券ヘッジなし（ＤＣ専用）	19,054,612,382円	20,924,098,348円
ＤＣインデックスバランス（株式２０）	425,904,195円	449,934,113円
ＤＣインデックスバランス（株式４０）	594,134,856円	636,221,194円
ＤＣインデックスバランス（株式６０）	843,157,789円	955,585,847円
ＤＣインデックスバランス（株式８０）	756,892,528円	920,260,395円
財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	15,235,825,730円	12,049,464,135円
世界の財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,317,476,763円	2,112,878,640円
日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	12,115,610,099円	11,169,470,831円
財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	891,153,176円	833,588,608円
インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	143,812,763円	134,624,416円
財産３分法（適格機関投資家専用）	316,094,680円	359,199,937円
N i つみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	493,149円	1,299,567円
N i つみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）	1,103,924円	2,190,700円
財産３分法ファンド（不動産・債券・株式）奇数月分配型	591,254円	36,899,828円

	2023年11月 6日現在	2024年11月 6日現在
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	501,546,917円	432,775,864円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	58,964,858円	55,790,118円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	86,274,514円	86,820,989円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	91,631,913円	95,798,231円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	68,085,097円	73,804,584円
インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）1年決算型	3,510,456,517円	3,344,890,428円
海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	333,831,180円	354,915,962円
計	57,347,654,284円	55,030,512,735円
2. 受益権の総数	57,347,654,284口	55,030,512,735口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

（2023年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

（2024年11月 6日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

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

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（2023年11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	54,008,946	-	54,402,436	393,490
	英ポンド	54,008,946	-	54,402,436	393,490
	売建	690,098,354	-	690,744,944	646,590
	米ドル	323,442,360	-	323,150,868	291,492
	加ドル	14,668,202	-	14,672,062	3,860
	メキシコペソ	28,940,123	-	29,625,723	685,600
	ユーロ	236,256,090	-	236,303,079	46,989
	英ポンド	29,595,520	-	29,597,920	2,400
	ポーランドズロチ	48,445,238	-	48,643,025	197,787
	豪ドル	8,750,821	-	8,752,267	1,446
合計		744,107,300	-	745,147,380	253,100

（2024年11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	748,518,390	-	749,249,360	730,970
	米ドル	305,445,895	-	305,620,000	174,105
	加ドル	19,248,250	-	19,267,150	18,900
	ユーロ	271,789,043	-	271,978,747	189,704
	英ポンド	34,651,260	-	34,681,150	29,890
	ポーランドズロチ	34,970,807	-	35,060,904	90,097
	中国元	82,413,135	-	82,641,409	228,274
合計		748,518,390	-	749,249,360	730,970

（注）1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年11月 6日現在		2024年11月 6日現在	
1口当たり純資産額	2.7756円	1口当たり純資産額	3.0375円
(1万口当たり純資産額)	(27,756円)	(1万口当たり純資産額)	(30,375円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,382,522.40	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	2,110,000.00	2,027,999.07	
		US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	3,440,000.00	3,368,881.44	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,300,116.84	
		US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	3,420,000.00	3,280,761.54	
		US TREASURY N/B-4.875%-25/11/30	4,000,000.00	4,022,756.00	
		US TREASURY N/B-4.0%-25/12/15	1,510,000.00	1,504,867.51	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	1,962,968.00	
		US TREASURY N/B-3.875%-26/01/15	1,150,000.00	1,144,743.35	
		US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	1,813,649.35	
		US TREASURY N/B-0.375%-26/01/31	2,370,000.00	2,259,460.83	
		US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	1,841,412.60	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,310,000.00	3,202,683.18	
		US TREASURY N/B-4.0%-26/02/15	3,000,000.00	2,990,154.00	
		US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,749,934.43	
		US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	3,650,000.00	3,474,343.75	
		US TREASURY N/B-4.625%-26/02/28	2,820,000.00	2,831,784.78	
		US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	4,490,000.00	4,368,626.32	
		US TREASURY N/B-0.75%-26/03/31	2,400,000.00	2,286,513.60	
		US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	1,050,000.00	1,022,026.95	
		US TREASURY N/B-0.75%-26/04/30	2,740,000.00	2,603,106.86	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	4,840,000.00	4,655,475.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-26/05/15	6,750,000.00	6,688,298.25	
		US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	2,740,000.00	2,653,517.38	
		US TREASURY N/B-0.75%-26/05/31	2,800,000.00	2,652,888.00	
		US TREASURY N/B-4.125%-26/06/15	3,000,000.00	2,994,549.00	

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	675,000.00	375,096.82			
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	895,000.00	806,216.00			
		UK TREASURY-0.625%-50/10/22	770,000.00	293,139.00			
		UK TREASURY-1.25%-51/07/31	600,000.00	275,400.00			
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	872,000.00	716,211.96			
		UK TREASURY-1.5%-53/07/31	580,000.00	277,411.10			
		UK TREASURY-3.75%-53/10/22	1,170,000.00	954,720.00			
		UK TREASURY-4.375%-54/07/31	270,000.00	245,727.00			
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	925,000.00	453,183.40			
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	962,000.00	858,760.08			
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	532,877.50			
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	751,000.00	640,227.50			
		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	1,050,000.00	294,525.00			
		UK TREASURY-4.0%-63/10/22	440,000.00	372,868.32			
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	765,000.00	583,603.20			
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	742,000.00	437,705.80			
		英ポンド小計			52,775,000.00	42,866,958.80 (8,497,517,242)	
		スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	3,680,000.00	3,616,207.20	
SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,300,000.00			3,168,709.50			
SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	3,330,000.00			3,133,596.60			
SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	2,700,000.00			2,382,831.00			
SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,800,000.00			1,817,906.40			
SWEDISH GOVERNMENT-1.75%-33/11/11	1,730,000.00			1,675,963.45			
SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-35/05/11	950,000.00			954,335.80			
SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	2,220,000.00			2,534,496.30			
スウェーデンクローナ小計			19,710,000.00	19,284,046.25 (273,640,616)			
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,400,000.00	2,321,078.40			
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,200,000.00	2,093,599.20			
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	1,820,000.00	1,708,772.52			
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	1,930,000.00	1,751,642.91			
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	2,685,000.00	2,342,767.21			
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.25%-31/09/17	2,040,000.00	1,723,569.48			
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.125%-32/05/18	2,030,000.00	1,802,976.98			
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-33/08/15	2,350,000.00	2,197,137.20			
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.625%-34/04/13	1,100,000.00	1,075,629.50			
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.5%-42/10/06	990,000.00	950,513.85			
ノルウェークローネ小計			19,545,000.00	17,967,687.25 (249,211,822)			
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	3,125,000.00	3,115,237.50			
		KINGDOM OF DENMARK-2.25%-26/11/15	950,000.00	955,814.00			
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	2,380,000.00	2,279,944.80			

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

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

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

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

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
-----	-----	--------------	----------------

米ドル	国債証券	218銘柄	100.0%	46.5%
加ドル	国債証券	39銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券	14銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券	387銘柄	100.0%	30.4%
英ポンド	国債証券	60銘柄	100.0%	5.2%
スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券	10銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券	14銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券	28銘柄	100.0%	1.3%
ニュージーランドドル	国債証券	14銘柄	100.0%	0.3%
シンガポールドル	国債証券	21銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券	27銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券	66銘柄	100.0%	11.3%
イスラエルシェケル	国債証券	13銘柄	100.0%	0.3%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

【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11月 7日から2025年 5月 6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。

【ＤＣインデックスバランス（株式６０）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前計算期間末 2024年11月 6日現在	当中間計算期間末 2025年 5月 6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,469,406,094	1,500,754,983
親投資信託受益証券	27,591,666,415	28,238,701,479
未収入金	15,697,222	-
未収利息	9,409	19,960
流動資産合計	29,076,779,140	29,739,476,422
資産合計	29,076,779,140	29,739,476,422
負債の部		
流動負債		
未払解約金	38,915,190	8,344,916
未払受託者報酬	3,085,074	3,128,914
未払委託者報酬	18,510,838	18,773,810
その他未払費用	616,968	625,735
流動負債合計	61,128,070	30,873,375
負債合計	61,128,070	30,873,375
純資産の部		
元本等		
元本	8,355,919,458	8,644,331,510
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	20,659,731,612	21,064,271,537
（分配準備積立金）	7,747,873,233	7,356,078,986
元本等合計	29,015,651,070	29,708,603,047
純資産合計	29,015,651,070	29,708,603,047
負債純資産合計	29,076,779,140	29,739,476,422

（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11月 7日 至 2024年 5月 6日	当中間計算期間 自 2024年11月 7日 至 2025年 5月 6日
営業収益		
受取利息	131,040	2,692,175
有価証券売買等損益	2,680,614,946	291,140,558
営業収益合計	2,680,745,986	288,448,383
営業費用		
支払利息	25,592	-
受託者報酬	2,713,959	3,128,914
委託者報酬	16,284,126	18,773,810
その他費用	542,758	625,735
営業費用合計	19,566,435	22,528,459
営業利益又は営業損失（ ）	2,661,179,551	310,976,842
経常利益又は経常損失（ ）	2,661,179,551	310,976,842
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,661,179,551	310,976,842
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（ ）	75,776,938	10,692,272
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	15,723,803,573	20,659,731,612
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,889,576,507	1,792,925,849
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,889,576,507	1,792,925,849
剰余金減少額又は欠損金増加額	897,067,956	1,088,101,354
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	897,067,956	1,088,101,354
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（ ）	19,301,714,737	21,064,271,537

（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11月 6日現在	当中間計算期間末 2025年 5月 6日現在
1. 期首元本額	7,677,089,236円	8,355,919,458円
期中追加設定元本額	1,565,250,665円	728,421,234円
期中一部解約元本額	886,420,443円	440,009,182円
2. 受益権の総数	8,355,919,458口	8,644,331,510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11月 7日 至 2024年 5月 6日	当中間計算期間 自 2024年11月 7日 至 2025年 5月 6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11月 6日現在	当中間計算期間末 2025年 5月 6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11月 6日現在	当中間計算期間末 2025年 5月 6日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.4725円 (34,725円)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.4368円 (34,368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」「日本債券インデックスマザーファンド」「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」を主要投資対象としており、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11月 6日現在	2025年 5月 6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	338,944,729	132,473,082
株式	61,801,121,520	62,639,799,270
派生商品評価勘定	9,669,350	25,393,050
未収入金	-	105,108,960
未収配当金	600,140,632	738,139,903
未収利息	2,170	1,761

前払金	4,490,800	-
流動資産合計	62,754,369,201	63,640,916,026
資産合計	62,754,369,201	63,640,916,026
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	17,340,800
前受金	-	7,199,300
未払金	196,656,040	-
未払解約金	17,831,413	100,727,249
流動負債合計	214,487,453	125,267,349
負債合計	214,487,453	125,267,349
純資産の部		
元本等		
元本	21,979,468,365	22,253,144,283
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	40,560,413,383	41,262,504,394
元本等合計	62,539,881,748	63,515,648,677
純資産合計	62,539,881,748	63,515,648,677
負債純資産合計	62,754,369,201	63,640,916,026

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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	2024年11月 6日現在	2025年 5月 6日現在
1. 期首	2023年11月 7日	2024年11月 7日
期首元本額	22,068,149,455円	21,979,468,365円
期首からの追加設定元本額	2,870,263,745円	1,937,973,367円
期首からの一部解約元本額	2,958,944,835円	1,664,297,449円
元本の内訳		
DCインデックスバランス（株式20）	728,847,667円	760,868,497円
DCインデックスバランス（株式40）	2,052,607,854円	2,162,009,194円
DCインデックスバランス（株式60）	4,607,508,315円	4,813,266,843円
DCインデックスバランス（株式80）	5,933,248,779円	6,108,835,926円
インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,946,857,824円	1,962,407,509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	2,251,785,274円	2,098,322,925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）	433,981,686円	434,832,069円
Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	2,577,917円	4,026,500円
Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	1,402,475円	1,849,337円
Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	592,331円	786,551円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,382,191,474円	1,263,327,858円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	180,906,001円	189,302,550円

		2024年11月 6日現在	2025年 5月 6日現在
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	565,181,303円	572,673,394円
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	928,199,296円	922,766,142円
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	963,580,169円	957,868,988円
	計	21,979,468,365円	22,253,144,283円
2.	受益権の総数	21,979,468,365口	22,253,144,283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	734,851,500円	781,817,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2024年11月 6日現在	2025年 5月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（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11月 6日現在）

（単位：円）

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

（2025年 5月 6日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	824,900,700	-	832,970,000	8,069,300
合計		824,900,700	-	832,970,000	8,069,300

（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11月 6日現在		2025年 5月 6日現在	
1口当たり純資産額	2.8454円	1口当たり純資産額	2.8542円
(1万口当たり純資産額)	(28,454円)	(1万口当たり純資産額)	(28,542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11月 6日現在	2025年 5月 6日現在
資産の部		
流動資産		
預金	208,762,095	583,900,076
コール・ローン	4,354,123,881	3,604,341,283
株式	434,547,773,298	424,423,939,485
投資証券	8,665,411,394	8,060,655,215
派生商品評価勘定	179,255,652	195,534,341
未収入金	36,110,325	3,621,442
未収配当金	188,032,829	359,189,236
未収利息	27,881	47,938
差入委託証拠金	591,070,886	988,703,371
流動資産合計	448,770,568,241	438,219,932,387
資産合計	448,770,568,241	438,219,932,387
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	28,204,324	49,954,340
未払金	-	275,980,324
未払解約金	188,694,604	12,020,249
流動負債合計	216,898,928	337,954,913
負債合計	216,898,928	337,954,913
純資産の部		
元本等		
元本	65,028,312,356	66,627,929,839
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	383,525,356,957	371,254,047,635
元本等合計	448,553,669,313	437,881,977,474
純資産合計	448,553,669,313	437,881,977,474
負債純資産合計	448,770,568,241	438,219,932,387

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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
--------------------	--

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

(貸借対照表に関する注記)

	2024年11月 6日現在	2025年 5月 6日現在
1. 期首	2023年11月 7日	2024年11月 7日
期首元本額	60,904,952,761円	65,028,312,356円
期首からの追加設定元本額	10,608,323,025円	4,868,775,212円
期首からの一部解約元本額	6,484,963,430円	3,269,157,729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）	36,199,095,327円	37,325,819,699円
DCインデックスバランス（株式20）	99,358,157円	111,027,263円
DCインデックスバランス（株式40）	287,223,552円	313,924,487円
DCインデックスバランス（株式60）	647,947,867円	687,511,548円
DCインデックスバランス（株式80）	834,515,823円	909,586,725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	963,153,916円	923,169,161円
日興五大陸株式ファンド	3,421,767,621円	3,540,236,128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）	62,045,402円	62,366,318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）	5,592,442,193円	5,482,114,817円
グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	6,883,396,555円	5,895,167,954円
Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	20,478,957円	32,431,858円
インデックスファンドMSCIオール・カンントリー（全世界株式）	4,135,452,006円	5,407,284,202円
Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）	620,098,981円	757,130,234円
Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	574,085円	795,899円
Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	240,268円	338,033円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	955,818,454円	917,017,897円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	12,228,073円	13,906,544円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	39,026,317円	41,954,676円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	64,434,317円	67,809,075円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	65,796,773円	71,901,945円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,123,217,712円	4,066,435,376円
計	65,028,312,356円	66,627,929,839円
2. 受益権の総数	65,028,312,356口	66,627,929,839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11月 6日現在	2025年 5月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

	2024年11月 6日現在	2025年 5月 6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

（株式関連）

（2024年11月 6日現在）

（単位：円）

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

（2025年 5月 6日現在）

（単位：円）

区分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	5,359,520,925	-	5,512,773,163	153,252,238
合計		5,359,520,925	-	5,512,773,163	153,252,238

（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11月 6日現在）

（単位：円）

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

（2025年 5月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	4,245,326,547	-	4,240,482,135	4,844,412
	米ドル	3,652,441,690	-	3,632,593,650	19,848,040
	ユーロ	592,884,857	-	607,888,485	15,003,628
	売建	155,053,000	-	157,880,825	2,827,825
	米ドル	114,368,000	-	116,728,800	2,360,800
	ユーロ	40,685,000	-	41,152,025	467,025
合計		4,400,379,547	-	4,398,362,960	7,672,237

（注）1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

2024年11月 6日現在		2025年 5月 6日現在	
1口当たり純資産額	6.8978円	1口当たり純資産額	6.5720円
(1万口当たり純資産額)	(68,978円)	(1万口当たり純資産額)	(65,720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11月 6日現在	2025年 5月 6日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	148,041,415	114,077,536
国債証券	48,618,222,970	47,208,029,800
地方債証券	2,393,913,882	2,552,908,728
特殊債証券	1,989,440,676	1,886,031,000
社債券	2,118,219,918	2,299,085,000
未収利息	111,755,447	107,184,222
前払費用	5,037,437	6,295,288
流動資産合計	55,384,631,745	54,173,611,574
資産合計	55,384,631,745	54,173,611,574
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,898,657	13,717,457
流動負債合計	10,898,657	13,717,457
負債合計	10,898,657	13,717,457
純資産の部		
元本等		
元本	42,108,169,838	42,100,425,023

	2024年11月 6日現在	2025年 5月 6日現在
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	13,265,563,250	12,059,469,094
元本等合計	55,373,733,088	54,159,894,117
純資産合計	55,373,733,088	54,159,894,117
負債純資産合計	55,384,631,745	54,173,611,574

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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
-----------------	--

（貸借対照表に関する注記）

	2024年11月 6日現在	2025年 5月 6日現在
1. 期首	2023年11月 7日	2024年11月 7日
期首元本額	38,488,019,140円	42,108,169,838円
期首からの追加設定元本額	6,643,373,019円	3,388,929,141円
期首からの一部解約元本額	3,023,222,321円	3,396,673,956円
元本の内訳		
ＤＣインデックスバランス（株式２０）	6,711,526,424円	6,895,823,803円
ＤＣインデックスバランス（株式４０）	6,487,652,576円	6,705,805,814円
ＤＣインデックスバランス（株式６０）	5,406,430,000円	5,537,082,816円
ＤＣインデックスバランス（株式８０）	1,046,210,157円	1,103,197,014円
インデックスファンド日本債券（ＤＣ専用）	2,168,132,973円	2,208,819,108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	4,627,294,198円	4,397,902,300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）	1,823,476,877円	1,829,541,253円
Tracers グローバル３分法（おとなのバランス）	41,834,402円	61,277,304円
Ni つみインデックスラップ世界１０指数（均等型）	2,993,339円	3,862,817円
Ni つみインデックスラップ世界１０指数（安定成長型）	2,535,893円	3,303,773円
国際分散型ファンド４０（適格機関投資家向け）	2,957,890,403円	2,609,353,612円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式２０）	1,678,396,699円	1,700,080,183円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式４０）	1,774,689,724円	1,777,870,047円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式６０）	1,090,871,564円	1,123,445,876円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式８０）	168,510,780円	172,419,389円
インデックスファンド日本債券（１年決算型）	5,693,402,266円	5,541,249,147円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	426,321,563円	429,390,767円
計	42,108,169,838円	42,100,425,023円
2. 受益権の総数	42,108,169,838口	42,100,425,023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11月 6日現在	2025年 5月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券	(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。	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11月 6日現在		2025年 5月 6日現在	
1口当たり純資産額	1.3150円	1口当たり純資産額	1.2864円
(1万口当たり純資産額)	(13,150円)	(1万口当たり純資産額)	(12,864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11月 6日現在	2025年 5月 6日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,448,185,665	690,252,002
コール・ローン	66,362,680	88,494,846
国債証券	164,910,542,863	158,177,588,328
派生商品評価勘定	-	4,053,290
未収入金	1,433,949,952	2,122,828,755
未収利息	1,427,466,902	1,468,433,237
前払費用	87,694,849	72,163,237
流動資産合計	169,374,202,911	162,623,813,695
資産合計	169,374,202,911	162,623,813,695
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	730,970	9,032,379
未払金	2,023,489,851	2,530,034,494
未払解約金	192,707,201	20,126,154
流動負債合計	2,216,928,022	2,559,193,027
負債合計	2,216,928,022	2,559,193,027
純資産の部		
元本等		
元本	55,030,512,735	53,353,689,830
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	112,126,762,154	106,710,930,838
元本等合計	167,157,274,889	160,064,620,668
純資産合計	167,157,274,889	160,064,620,668
負債純資産合計	169,374,202,911	162,623,813,695

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

2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 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。 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11月 6日現在	2025年 5月 6日現在
1. 期首	2023年11月 7日	2024年11月 7日
期首元本額	57,347,654,284円	55,030,512,735円
期首からの追加設定元本額	3,572,494,617円	1,401,761,983円
期首からの一部解約元本額	5,889,636,166円	3,078,584,888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）	20,924,098,348円	21,408,067,630円
DCインデックスバランス（株式20）	449,934,113円	464,293,802円
DCインデックスバランス（株式40）	636,221,194円	647,601,924円
DCインデックスバランス（株式60）	955,585,847円	953,116,906円
DCインデックスバランス（株式80）	920,260,395円	964,603,569円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	12,049,464,135円	10,510,664,908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	2,112,878,640円	1,951,629,007円
日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	11,169,470,831円	10,812,865,441円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	833,588,608円	763,198,770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）	134,624,416円	132,334,940円
財産3分法（適格機関投資家専用）	359,199,937円	360,768,472円
Niftyインデックスラップ世界10指数（均等型）	1,299,567円	1,687,089円
Niftyインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	2,190,700円	2,880,728円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）奇数月分配型	36,899,828円	51,656,422円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	432,775,864円	379,504,802円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	55,790,118円	57,347,753円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	86,820,989円	85,638,598円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	95,798,231円	97,865,553円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	73,804,584円	75,632,441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	3,344,890,428円	3,269,351,070円
海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	354,915,962円	362,980,005円
計	55,030,512,735円	53,353,689,830円
2. 受益権の総数	55,030,512,735口	53,353,689,830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11月 6日現在	2025年 5月 6日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左

	2024年11月 6日現在	2025年 5月 6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11月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	748,518,390	-	749,249,360	730,970
	米ドル	305,445,895	-	305,620,000	174,105
	加ドル	19,248,250	-	19,267,150	18,900
	ユーロ	271,789,043	-	271,978,747	189,704
	英ポンド	34,651,260	-	34,681,150	29,890
	ポーランドズロチ	34,970,807	-	35,060,904	90,097
	中国元	82,413,135	-	82,641,409	228,274
合計		748,518,390	-	749,249,360	730,970

（2025年 5月 6日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	378,321,508	-	382,369,998	4,048,490
	米ドル	145,900,000	-	145,895,200	4,800
	加ドル	8,913,040	-	9,066,068	153,028
	英ポンド	223,508,468	-	227,408,730	3,900,262
	売建	523,001,935	-	532,029,514	9,027,579
	ユーロ	438,646,020	-	446,065,187	7,419,167
	ポーランドズロチ	14,510,995	-	14,745,369	234,374
	豪ドル	69,844,920	-	71,218,958	1,374,038
合計		901,323,443	-	914,399,512	4,979,089

（注）1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

- 2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
- 3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（ 1 口当たり情報 ）

2024年11月 6日現在		2025年 5月 6日現在	
1口当たり純資産額	3.0375円	1口当たり純資産額	3.0001円
(1万口当たり純資産額)	(30,375円)	(1万口当たり純資産額)	(30,001円)

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2025年 5月30日現在です。

【ＤＣインデックスバランス（株式６０）】

【純資産額計算書】

資産総額	30,506,016,148円
負債総額	27,320,870円
純資産総額（ - ）	30,478,695,278円
発行済口数	8,689,854,822口
１口当たり純資産額（ / ）	3.5074円

（参考）

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	64,755,205,356円
負債総額	86,072,294円
純資産総額（ - ）	64,669,133,062円
発行済口数	21,726,025,717口
１口当たり純資産額（ / ）	2.9766円

海外株式インデックスＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	453,886,112,674円
負債総額	99,242,508円
純資産総額（ - ）	453,786,870,166円
発行済口数	66,301,209,128口
１口当たり純資産額（ / ）	6.8443円

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	55,042,478,981円
負債総額	69,394,977円
純資産総額（ - ）	54,973,084,004円
発行済口数	43,332,935,733口
１口当たり純資産額（ / ）	1.2686円

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	158,871,476,228円
------	------------------

負債総額	732,003,683円
純資産総額（ - ）	158,139,472,545円
発行済口数	53,476,596,261口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9572円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2025年5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（2025年5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（2025年5月末現在）

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

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2025年5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	761	304,468
株式投資信託	717	267,366
単位型	257	6,326
追加型	460	261,040
公社債投資信託	44	37,101
単位型	31	852
追加型	13	36,248

3【委託会社等の経理状況】

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

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第66期事業年度（2024年4月1日から2025年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

(単位：百万円)				
		第65期 (2024年 3 月31日)		第66期 (2025年 3 月31日)
資産の部				
流動資産				
現金・預金		31,198		26,334
金銭の信託		3,899		17,070
有価証券		1		-
前払費用		814		822
未収入金		179		358
未収委託者報酬		21,592		22,244
未収収益	3	647	3	900
立替金		1,089		1,214
その他	2	2,011	2	3,024
流動資産合計		61,434		71,969
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	233	1	187
器具備品	1	134	1	108
有形固定資産合計		368		295
無形固定資産				
ソフトウェア		438		478
無形固定資産合計		438		478
投資その他の資産				
投資有価証券		28,465		18,012
関係会社株式		37,647		45,007
長期差入保証金		285		725
繰延税金資産		-		496
その他投資		-		765
投資その他の資産合計		66,398		65,006
固定資産合計		67,205		65,781
資産合計		128,640		137,750

(単位：百万円)		
	第65期 (2024年 3 月31日)	第66期 (2025年 3 月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	451	1,631
未払金	9,211	9,544
未払収益分配金	7	7
未払償還金	71	71
未払手数料	8,330	8,462

その他未払金		803		1,002
未払費用	3	4,082	3	4,202
未払法人税等		1,644		3,378
未払消費税等	4	620	4	693
関係会社短期借入金		-		6,690
賞与引当金		2,619		2,881
役員賞与引当金		232		225
その他		683		44
流動負債合計		19,547		29,291
固定負債				
退職給付引当金		1,448		1,455
賞与引当金		565		529
役員賞与引当金		56		121
繰延税金負債		295		-
その他		251		231
固定負債合計		2,617		2,337
負債合計		22,165		31,629
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		82,591		83,753
利益剰余金合計		82,591		83,753
自己株式		2,067		2,067
株主資本合計		103,107		104,269
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		4,523		2,466
繰延ヘッジ損益		1,155		615
評価・換算差額等合計		3,367		1,851
純資産合計		106,475		106,120
負債純資産合計		128,640		137,750

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

		第65期 (自 2023年 4月 1日 至 2024年 3月31日)		第66期 (自 2024年 4月 1日 至 2025年 3月31日)
営業収益				
委託者報酬		75,874		83,264
その他営業収益	1	3,714	1	4,604
営業収益合計		79,588		87,869
営業費用				
支払手数料		32,917		37,898
広告宣伝費		711		645
公告費		3		5
調査費		17,736		18,976
調査費		1,266		1,433
委託調査費		16,445		17,516

図書費	23	26
委託計算費	610	617
営業雑経費	881	867
通信費	135	136
印刷費	308	278
協会費	48	50
諸会費	11	18
その他	375	382
営業費用計	52,860	59,011
一般管理費		
給料	10,550	11,085
役員報酬	459	592
役員賞与引当金繰入額	273	289
給料・手当	6,791	7,151
賞与	277	216
賞与引当金繰入額	2,747	2,835
交際費	71	49
寄付金	22	22
旅費交通費	260	273
租税公課	389	646
不動産賃借料	906	836
退職給付費用	388	403
退職金	36	38
固定資産減価償却費	199	193
福利費	1,208	1,187
諸経費	4,661	4,821
一般管理費計	18,694	19,559
営業利益	8,033	9,298

(単位：百万円)

	第65期 (自 2023年 4 月 1 日 至 2024年 3 月31日)		第66期 (自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)	
営業外収益				
受取利息		4		10
受取配当金	2	4,946	2	4,356
デリバティブ収益		-		193
有価証券評価益	3	1,113	3	3,063
金銭の信託運用益		399		170
時効成立分配金・償還金		2		2
為替差益		-		162
その他		50		81
営業外収益合計		6,517		8,039
営業外費用				
支払利息		569	2	907
デリバティブ費用		3,494		-
時効成立後支払分配金・償還金		1		2
為替差損		165		-
その他		0		9
営業外費用合計		4,231		919
経常利益		10,319		16,418
特別利益				
投資有価証券売却益		815		210

特別利益合計	815	210
特別損失		
投資有価証券売却損	174	81
固定資産処分損	52	10
損害賠償損失	167	-
特別損失合計	394	91
税引前当期純利益	10,740	16,537
法人税、住民税及び事業税	2,415	4,349
法人税等調整額	51	157
法人税等合計	2,364	4,192
当期純利益	8,376	12,345

（３）【株主資本等変動計算書】

第65期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：百万円）

(単位：百万円)

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

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

第66期（自 2024年4月1日 至 2025年3月31日）

（単位：百万円）

(単位：百万円)

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計		
				繰越利益 剰余金			
当期首残高	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	4,523	1,155	3,367	106,475
当期変動額				
剰余金の配当				11,183
当期純利益				12,345
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	2,056	539	1,516	1,516
当期変動額合計	2,056	539	1,516	354
当期末残高	2,466	615	1,851	106,120

4 収益の計上基準 5 ヘッジ会計の方法 6 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(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。 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。 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。 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。 (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。 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。
---	--

（未適用の会計基準等）

- ・ 「リースに関する会計基準」（企業会計基準第34号 2024年9月13日）
- ・ 「リースに関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第33号 2024年9月13日）等

（1）概要

国際的な会計基準と同様に、借手のすべてのリースについて資産・負債を計上する等の取扱いを定めるもの。

（2）適用予定日

2028年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用が財務諸表に及ぼす影響は、現時点で評価中であります。

（重要な会計上の見積り）

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。

第66期(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
該当事項はありません。

（貸借対照表関係）

第65期 (2024年3月31日)	第66期 (2025年3月31日)
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。 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。	1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,484百万円 器具備品 872百万円 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 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 282百万円 (流動負債) 未払費用 1,921百万円 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469百万円（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65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	第66期 (自 2024年4月1日 至 2025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 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。	1 営業収益合計には、成功報酬354百万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 4,048百万円 支払利息 286百万円 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3,063百万円を営業外収益に計上しております。

（株主資本等変動計算書関係）

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

第66期（自 2024年4月1日 至 2025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	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 2017年度ストックオプション(1)192,000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
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
2025年5月29日 取締役会	普通株式	利益剰余金	7,486	38.56	2025年3月31日	2025年6月27日

(リース取引関係)

第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)		第66期 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料		オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1年内	891百万円	1年内	916百万円
1年超	2,613百万円	1年超	6,829百万円
合計	3,505百万円	合計	7,745百万円

(金融商品関係)

第65期(自 2023年4月1日 至 2024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金銭の信託及び短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
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、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	-

第66期(自 2024年4月1日 至 2025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。

外貨建ての関係会社短期借入金に関しましては、為替変動リスクに晒されておりますが、為替予約によりリスクをヘッジしております。

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託 有価証券 その他有価証券 投資信託	2,418	14,651	-	17,070
資産計	4,097	11,342	-	15,440
デリバティブ取引(*1) 株式関連(*2) 通貨関連(*3)	6,516	25,994	-	32,510
デリバティブ取引計	159	-	-	159
	-	341	-	341
	159	341	-	501

- (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159百万円は、貸借対照表上流動資産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341百万円は、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。

(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、関係会社短期借入金、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、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。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	2,571
子会社株式	26,371
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	26,334			
未収委託者報酬	22,244			
未収収益	900			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	-	803	1,176	110
合計	49,479	803	1,176	110

(有価証券関係)

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。

第66期(自 2024年4月1日 至 2025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	26,371
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	12,903	9,123	3,780
	小計	12,903	9,123	3,780
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	2,536	2,809	273
	小計	2,536	2,809	273
合計		15,440	11,933	3,506

(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2,571百万円）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	5,849	764	45
合計	5,849	764	45

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

第66期(自 2024年4月1日 至 2025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	17,070	170

（デリバティブ取引関係）

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 豪ドル 香港ドル 人民元 ユーロ	投資有価証券	6,465 84 542 2,979 2,172	- - - - -	268 2 17 17 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。

第66期(2025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	17,846	-	159	159
合計		17,846	-	159	159

(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 買建 シンガポールドル	6,696	-	39	39
合計		6,696	-	39	39

(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

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	投資有価証券			
	米ドル		6,651	-	326
	豪ドル		180	-	1
	ユーロ		2,796	-	2
	香港ドル		1,067	-	38
	人民元		1,473	-	18
	合計		12,167	-	381

(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65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)		第66期 (自 2024年4月1日 至 2025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	5,342	(1) 関連会社に対する投資の金額	5,341
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	17,691	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	18,436
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	2,474	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	2,427

(退職給付関係)

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。

第66期(自 2024年4月1日 至 2025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	1,407
勤務費用	138
利息費用	9
数理計算上の差異の発生額	34
退職給付の支払額	133
退職給付債務の期末残高	1,387

(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	1,387
未積立退職給付債務	1,387
未認識数理計算上の差異	67
貸借対照表に計上された負債の額	1,455

退職給付引当金	1,455
貸借対照表に計上された負債の額	1,455

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	138
利息費用	9
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	140

(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	1.5%
--------------------------------	------

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、262百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(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。）と、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。）と、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

（注） 株式数に換算して記載しております。

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

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

（注） 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

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

第66期(自 2024年4月1日 至 2025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tockオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況
ストックオプション(新株予約権)の数

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定前(株)		
期首	121,000	346,000
付与	0	0
失効	121,000	154,000
権利確定	0	0
権利未確定残	0	192,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

（注） 株式数に換算して記載しております。

単価情報

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

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

2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 58百万円

(税効果会計関係)

第65期 (2024年3月31日)	第66期 (2025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 (単位：百万円) <table> <tr><td>繰延税金資産</td><td></td></tr> <tr><td>賞与引当金</td><td>975</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td>8</td></tr> <tr><td>関係会社株式評価損</td><td>52</td></tr> <tr><td>退職給付引当金</td><td>443</td></tr> <tr><td>固定資産減価償却費</td><td>80</td></tr> <tr><td>繰延ヘッジ損益</td><td>510</td></tr> <tr><td>その他</td><td>679</td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td>2,750</td></tr> <tr><td>評価性引当金</td><td>52</td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td>2,697</td></tr> <tr><td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td>2,044</td></tr> <tr><td>その他</td><td>948</td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td>2,992</td></tr> <tr><td>繰延税金負債の純額</td><td>295</td></tr> </table>	繰延税金資産		賞与引当金	975	投資有価証券評価損	8	関係会社株式評価損	52	退職給付引当金	443	固定資産減価償却費	80	繰延ヘッジ損益	510	その他	679	繰延税金資産小計	2,750	評価性引当金	52	繰延税金資産合計	2,697	繰延税金負債		その他有価証券評価差額金	2,044	その他	948	繰延税金負債合計	2,992	繰延税金負債の純額	295	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) <table> <tr><td>繰延税金資産</td><td></td></tr> <tr><td>賞与引当金</td><td>1,047</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td>8</td></tr> <tr><td>関係会社株式評価損</td><td>54</td></tr> <tr><td>退職給付引当金</td><td>457</td></tr> <tr><td>固定資産減価償却費</td><td>69</td></tr> <tr><td>繰延ヘッジ損益</td><td>283</td></tr> <tr><td>その他</td><td>828</td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td>2,748</td></tr> <tr><td>評価性引当金</td><td>54</td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td>2,694</td></tr> <tr><td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td>1,221</td></tr> <tr><td>その他</td><td>976</td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td>2,198</td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td>496</td></tr> </table>	繰延税金資産		賞与引当金	1,047	投資有価証券評価損	8	関係会社株式評価損	54	退職給付引当金	457	固定資産減価償却費	69	繰延ヘッジ損益	283	その他	828	繰延税金資産小計	2,748	評価性引当金	54	繰延税金資産合計	2,694	繰延税金負債		その他有価証券評価差額金	1,221	その他	976	繰延税金負債合計	2,198	繰延税金資産の純額	496
繰延税金資産																																																																	
賞与引当金	975																																																																
投資有価証券評価損	8																																																																
関係会社株式評価損	52																																																																
退職給付引当金	443																																																																
固定資産減価償却費	80																																																																
繰延ヘッジ損益	510																																																																
その他	679																																																																
繰延税金資産小計	2,750																																																																
評価性引当金	52																																																																
繰延税金資産合計	2,697																																																																
繰延税金負債																																																																	
その他有価証券評価差額金	2,044																																																																
その他	948																																																																
繰延税金負債合計	2,992																																																																
繰延税金負債の純額	295																																																																
繰延税金資産																																																																	
賞与引当金	1,047																																																																
投資有価証券評価損	8																																																																
関係会社株式評価損	54																																																																
退職給付引当金	457																																																																
固定資産減価償却費	69																																																																
繰延ヘッジ損益	283																																																																
その他	828																																																																
繰延税金資産小計	2,748																																																																
評価性引当金	54																																																																
繰延税金資産合計	2,694																																																																
繰延税金負債																																																																	
その他有価証券評価差額金	1,221																																																																
その他	976																																																																
繰延税金負債合計	2,198																																																																
繰延税金資産の純額	496																																																																
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 <table> <tr><td>法定実効税率</td><td>30.6%</td></tr> <tr><td>（調整）</td><td></td></tr> <tr><td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td>1.2%</td></tr> <tr><td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td><td>10.9%</td></tr> <tr><td>その他</td><td>1.1%</td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td>22.0%</td></tr> </table>	法定実効税率	30.6%	（調整）		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	10.9%	その他	1.1%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	22.0%	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 <table> <tr><td>法定実効税率</td><td>30.6%</td></tr> <tr><td>（調整）</td><td></td></tr> <tr><td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td>0.6%</td></tr> <tr><td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td><td>6.3%</td></tr> <tr><td>その他</td><td>0.4%</td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td>25.3%</td></tr> </table>	法定実効税率	30.6%	（調整）		交際費等永久に損金に算入されない項目	0.6%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.3%	その他	0.4%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	25.3%																																								
法定実効税率	30.6%																																																																
（調整）																																																																	
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	10.9%																																																																
その他	1.1%																																																																
税効果会計適用後の法人税等の負担率	22.0%																																																																
法定実効税率	30.6%																																																																
（調整）																																																																	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.6%																																																																
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.3%																																																																
その他	0.4%																																																																
税効果会計適用後の法人税等の負担率	25.3%																																																																
	3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正 「所得税法等の一部を改正する法律（令和7年法律第13号）」が2025年3月31日に成立したことに伴い、2026年4月1日以後に開始する事業年度から「防衛特別法人税」の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の30.6%から、2026年4月1日以後開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異等については31.5%になります。この税率変更により、当事業年度の繰延税金資産（繰延税金負債を控除した金額）が26百万円減少し、法人税等調整額は2百万円減少し、その他有価証券評価差額金が32百万円減少し、繰延ヘッジ損失は8百万円減少しております。																																																																

（関連当事者情報）

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 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。
- 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。
- 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。
- 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(ロンドン)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

第66期(自 2024年4月1日 至 2025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	-	資金の借入 (シンガポール ドル貨建) (注1)	6,690 (SGD 60,000千)	関係会社 短期 借入金	6,690 (SGD 60,000千)
							借入金利息 (シンガポール ドル貨建) (注1)	286 (SGD 2,532千)	未払費用	286 (SGD 2,532千)
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注2)	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	配当の受取	2,641 (USD 18,000千)	-	-
子会社	Nikko AM Global Holdings Limited	英国	10,738	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	増資の引受 (注3)	7,360	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

1. 融資枠70万シンガポールドル、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
2. Nikko 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。
3. Nikko AM Global Holdings Limitedの行った7,360,000,000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

三井住友トラストグループ株式会社（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2024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 46,582百万円

負債合計 7,834百万円

純資産合計 38,748百万円

営業収益 18,712百万円

税引前当期純利益 6,127百万円

当期純利益 4,588百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

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。

第66期(自 2024年4月1日 至 2025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。

第66期(自 2024年4月1日 至 2025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。

第66期(自 2024年4月1日 至 2025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。

第66期(自 2024年4月1日 至 2025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。

第66期(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

該当事項はありません。

(収益認識関係)

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。

第66期(自 2024年4月1日 至 2025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65期 (自 2023年 4 月 1 日 至 2024年 3 月31日)	第66期 (自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)
1 株当たり純資産額	548円41銭	546円58銭
1 株当たり当期純利益金額	43円14銭	63円58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65期 (自 2023年 4 月 1 日 至 2024年 3 月31日)	第66期 (自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)
当期純利益（百万円）	8,376	12,345
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）	8,376	12,345
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なかった潜在株式の概要	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	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65期 (2024年 3 月31日)	第66期 (2025年 3 月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	106,475	106,120
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）	106,475	106,120
1 株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数（千株）	194,152	194,152

(重要な後発事象)
該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

5 【その他】

- (1) 定款の変更
委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
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 (2025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 (2025年3月末現在)	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	135,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	54,323百万円	
損保ジャパン D C 証券株式会社	3,000百万円	
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
住友生命保険相互会社	689,000百万円 (基金及び基金償却積立金の合計額)	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
ソニー生命保険株式会社	70,000百万円	
日本生命保険相互会社	1,450,000百万円 (基金及び基金償却積立金の合計額)	
富国生命保険相互会社	136,000百万円 (基金及び基金償却積立金の合計額)	
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
信金中央金庫	890,998百万円 (出資の総額)	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

２【関係業務の概要】

（１）受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

（２）販売会社

日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行ないます。

３【資本関係】

（１）受託会社

該当事項はありません。

（２）販売会社

該当事項はありません。

第３【その他】

（１）目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用します。

（２）目論見書の表紙、表紙裏または裏表紙に、以下を記載することがあります。

委託会社の金融商品取引業者登録番号および設立年月日
ファンドの基本的性格など
委託会社およびファンドのロゴ・マークや図案など

委託会社のホームページや携帯電話サイトのご案内など

目論見書の使用開始日

- (3) 目論見書の表紙または表紙裏に、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
- 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
- 投資信託は、元金および利回りが保証されているものではない旨の記載。
- 投資した資産の価値の減少を含むリスクは、投資信託を購入されたお客様が負う旨の記載。
- 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨の記載。
- 「ご購入に際しては、目論見書の内容を十分にお読みください。」という趣旨の記載。
- 請求目論見書の入手方法（ホームページで閲覧、ダウンロードできるなど）についての記載。
- 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨の記載。
- 「約款が請求目論見書に掲載されている。」旨の記載。
- 商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認する旨の記載。
- 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載。
- 有価証券届出書の効力発生およびその確認方法に関する記載。
- 委託会社の情報として記載することが望ましい事項と判断する事項がある場合は、当該事項の記載。
- (4) 有価証券届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表などを付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (5) 目論見書に約款を掲載し、有価証券届出書本文「第二部 ファンド情報」中「第1 ファンドの状況」「2 投資方針」の詳細な内容につきましては、当該約款を参照する旨を記載することで、目論見書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (8) 交付目論見書の投資リスクに、以下の趣旨の文章の全部または一部を記載することがあります。
- ファンドの取引に関して、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨の記載。
- 投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではない旨。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはならない旨の記載。
- ファンドは、大量の解約が発生し、短期間で解約資金の手当てをする必要が生じた場合や、主たる取引市場において市場が急変した場合などに、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがある旨。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金の申込みの受付を中止する可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性がある旨の記載。
- 分配金は、投資信託の純資産から支払われるので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がる旨。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合がある旨。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合がある旨の記載。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2025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 公認会計士 秋 宗 勝 彦
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 三 上 和 彦
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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2025年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

する注記事項の妥当性を評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年1月29日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

公認会計士 辻村 和之

業務執行社員

指定有限責任社員

公認会計士 榊原 康太

業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCインデックスバランス（株式60）の2023年11月7日から2024年11月6日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCインデックスバランス（株式60）の2024年11月6日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注)1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2025年6月18日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

公認会計士 辻村 和之

業務執行社員

指定有限責任社員

公認会計士 榊原 康太

業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCインデックスバランス（株式60）の2024年11月7日から2025年5月6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、DCインデックスバランス（株式60）の2025年5月6日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年11月7日から2025年5月6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。