

世界の財産3分法ファンド (不動産・債券・株式) 毎月分配型

追加型投信／内外／資産複合

◆この目論見書により行なう「世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2024年3月15日に関東財務局長に提出しており、2024年3月16日にその効力が発生しております。

有価証券届出書提出日 : 2024年3月15日
発行者名 : 日興アセットマネジメント株式会社
代表者の役職氏名 : 代表取締役社長 ステファニー・ドゥルーズ
本店の所在の場所 : 東京都港区赤坂九丁目7番1号
有価証券届出書（訂正届出書を含みます。）の写しを縦覧に供する場所 : 該当事項はありません。

設定・運用は

日興アセットマネジメント

投資信託は、金融機関の預金や保険契約とは商品性が異なります。

- 投資信託は、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ありません。
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りません。
- 投資信託は、元金および利回り保証のいずれもありません。
- 投資信託をご購入されたお客様は、投資した資産の価値の減少を含むリスクを負います。

－ 目 次 －

	頁
第一部【証券情報】	1
第二部【ファンド情報】	3
第1【ファンドの状況】	3
第2【管理及び運営】	62
第3【ファンドの経理状況】	67
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	248
第三部【委託会社等の情報】	249
約款	308

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型（以下「ファンド」といいます。）

- ・愛称として「世界の財産3分法ファンド」、「世界の財産3分法」という名称を用いることがあります。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

- ・追加型証券投資信託受益権です。（以下「受益権」といいます。）
- ・信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

(5)【申込手数料】

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

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

(6)【申込単位】

販売会社の照会先にお問い合わせください。

(7)【申込期間】

2024年3月16日から2024年9月17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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(9)【払込期日】

- ・取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する期日までに販売会社に支払うものとします。
- ・申込期間における各取得申込受付日の発行価額の総額（設定総額）は、販売会社によって、追加設定が行なわ

れる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

① ファンドの目的
国内外の不動産、債券、株式に分散投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。

② ファンドの基本的性格

1) 商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式
	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 一般	年1回	グローバル (含む日本)		
大型株	年2回			
中小型株	年4回	日本		
債券 一般	年6回	北米	ファミリーファンド	あり ()
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・ ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資産 複合 資産配分 固定型(株式、債 券、不動産投 信)))	その他 ()	アフリカ		
		中近東 (中東)		
		エマージング		
資産複合 ()				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

◇その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券、不動産投信)))

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

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

◇年12回(毎月)

目論見書または投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいいます。

◇グローバル(含む日本)

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

◇ファミリーファンド

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

◇為替ヘッジなし

目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行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。

③ ファンドの特色



主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行ないます。

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



国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

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



原則として、毎月、安定した収益分配を行なうことをめざします。

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

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

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



「財産3分法」とは?

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

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

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



主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行ないます。

[世界の財産3分法ファンド] 基本組入比率

国内の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)
東証REIT指数(配当込み)

国内の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

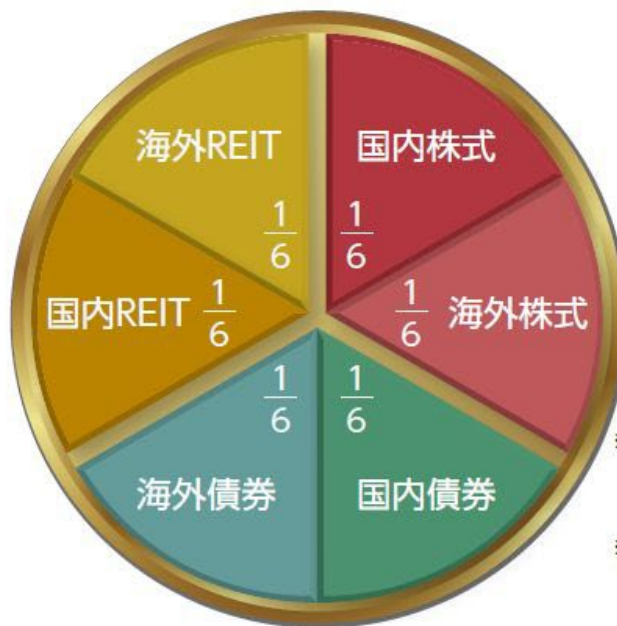
連動をめざす指数(インデックス)
TOPIX(東証株価指数)配当込み

海外の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)
S&P先進国REIT指数
(除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース)

海外の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)
MSCI-KOKUSAI インデックス
(税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース)



※「基本組入比率」および「連動をめざす指数(インデックス)」は、2023年12月末現在のものであり、将来変更となる場合があります。
※市況動向および資金動向などにより左記のような運用ができない場合があります。

海外の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)
FTSE世界国債インデックス
(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

国内の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)
NOMURA-BPI総合



国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

それぞれの資産は、異なる値動きをする傾向があります。

各資産の値動きの特徴



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

ご参考: 設定来のファンドと各資産の推移(マザーファンドベース)

(2005年9月(設定月)~2023年12月、月末値)



※基準価額は信託報酬(後述の「手続・手数料等」参照)控除後の値です。
 ※分配金再投資基準価額とは、税引前分配金を再投資したものと計算した理論上のものご留意ください。
 ※各資産の値動きは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの値動きを示しています。
 ※上記グラフは過去のものであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。



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

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



ご参考:各指数の利回り

(2023年12月末現在)



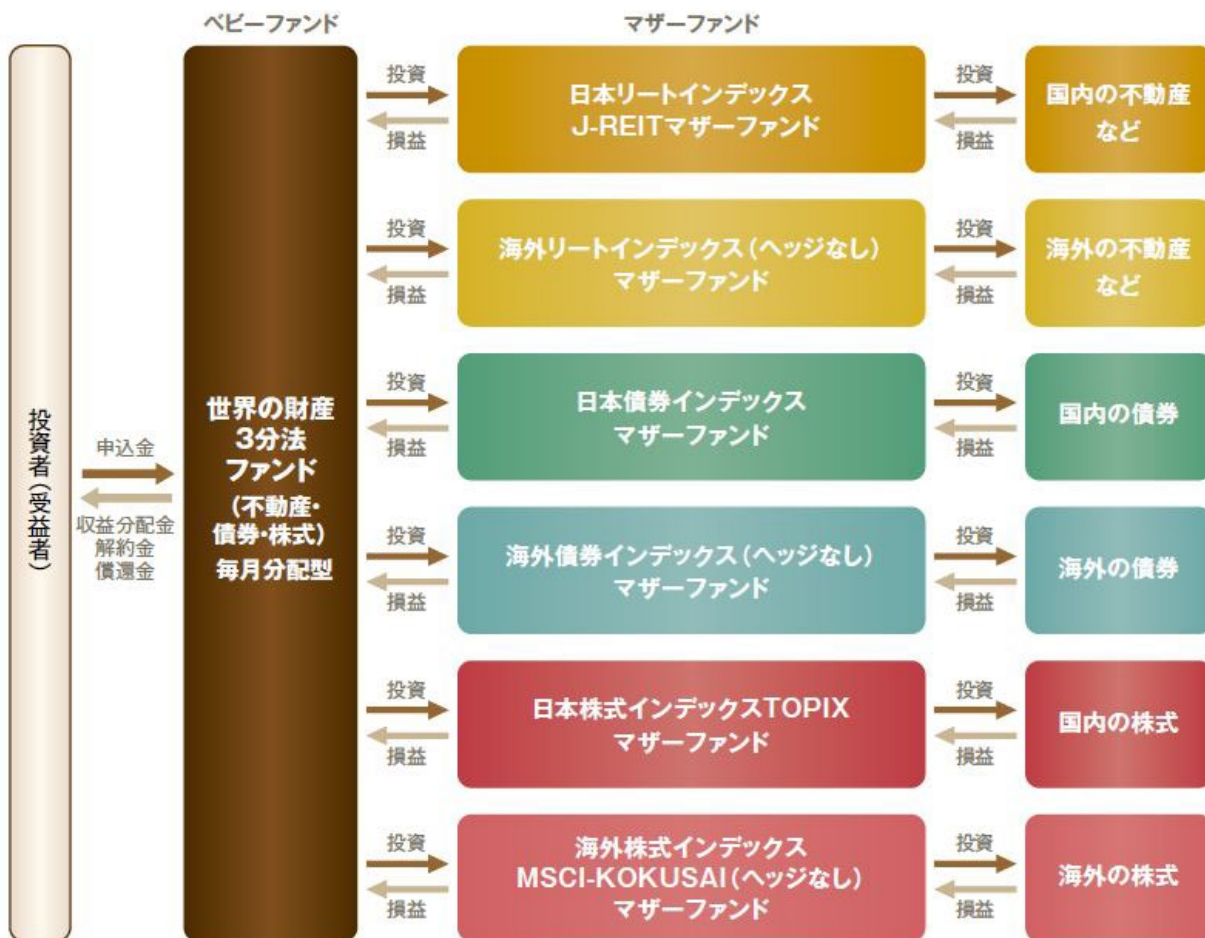
※各資産のリスク特性はそれぞれ異なるため、利回りだけで比較できるものではありません。
※上記は過去の各指数の利回りであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

各指数(インデックス)の著作権などの権利について

- **東証REIT指数** 同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)に帰属します。また、JPXは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- **S&P先進国REIT指数** 同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービス エル エル シー(S&P)社に帰属します。また、S&P社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- **NOMURA-BPI総合** 同指数は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下「NFRC」)が公表している指数で、その知的財産権はNFRCに帰属します。なお、NFRCは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行なわれる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- **FTSE世界国債インデックス** 同指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- **TOPIX(東証株価指数)** 同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)に帰属します。また、JPXは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- **MSCI-KOKUSAI インデックス** 同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

■ファンドの仕組み

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



(主な投資制限)

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

(分配方針)

- ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

収益分配金に関する留意事項

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

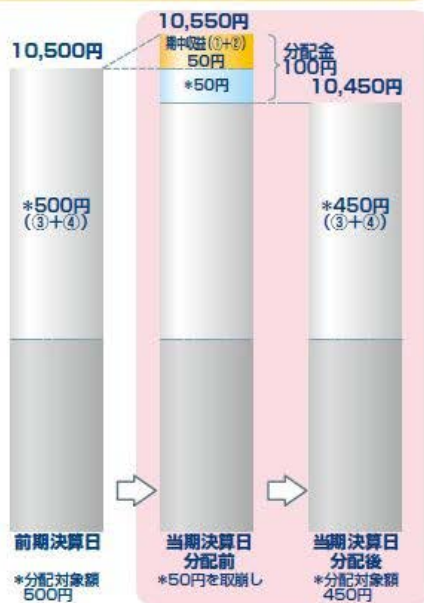
投資信託で分配金が支払われるイメージ



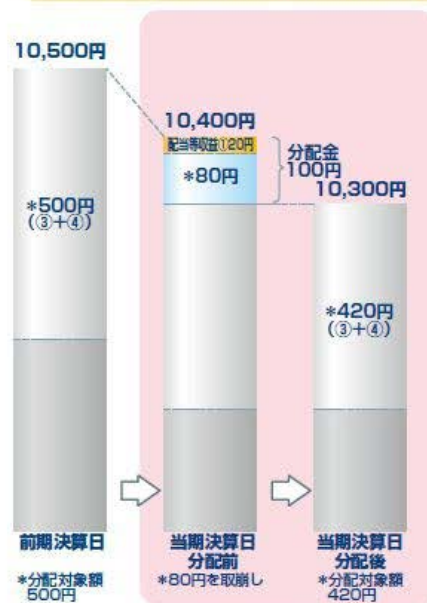
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算から基準価額が上昇した場合



前期決算から基準価額が下落した場合



(注)分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、将来の分配金の支払いおよび金額ならびに基準価額について示唆、保証するものではありません。

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

④ 信託金限度額

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

(2) 【ファンドの沿革】

2005 年 9 月 29 日

- ・ ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2006 年 3 月 9 日

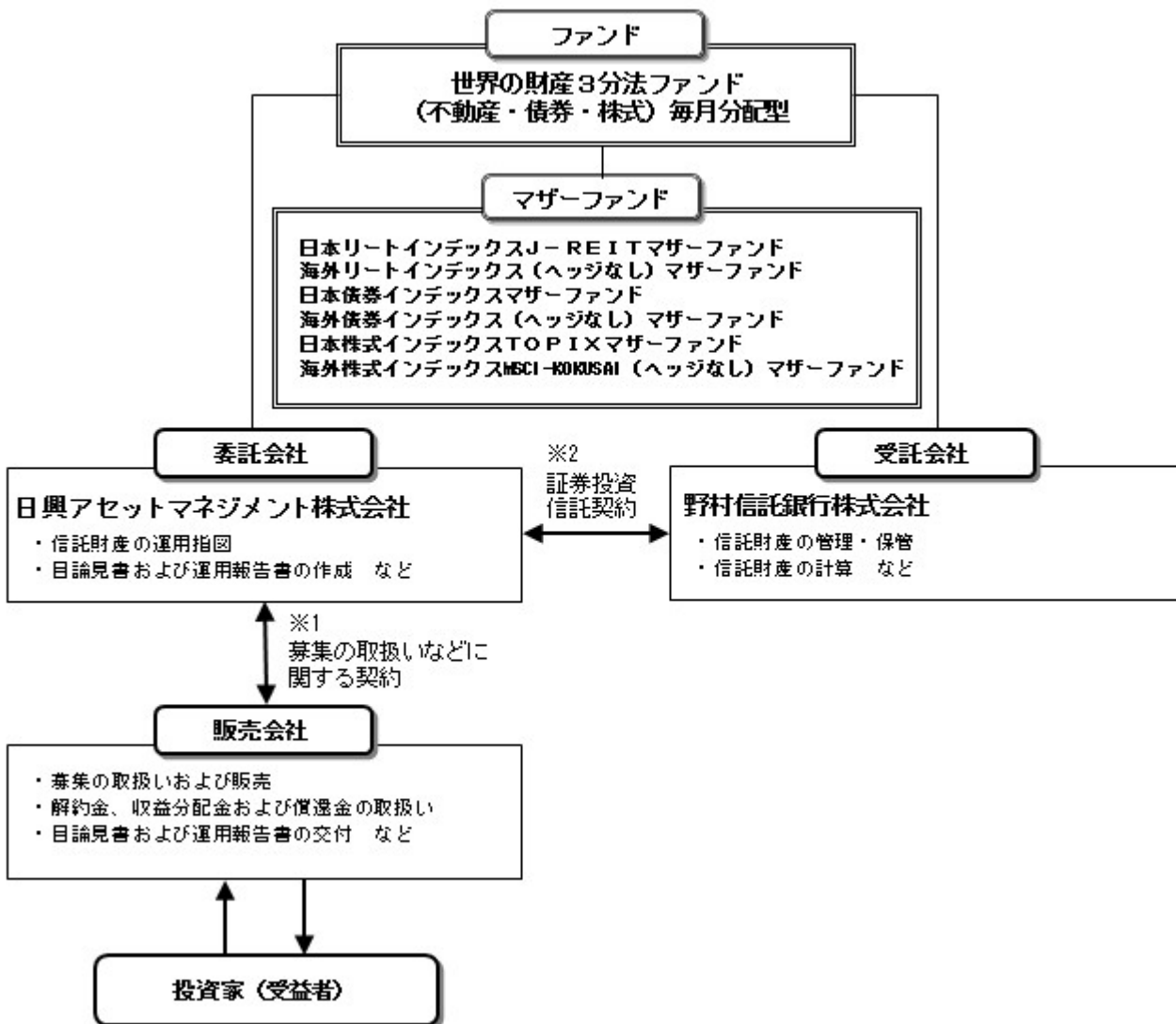
- ・ ファンド名称変更

新名称：世界の財産 3 分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型

旧名称：世界の財産 3 分法ファンド（バランス重視）毎月分配型

(3) 【ファンドの仕組み】

① ファンドの仕組み



※1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したもの。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。

※2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したもの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

② 委託会社の概況 (2023 年 12 月末現在)

1) 資本金

17,363 百万円

2) 沿革

1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更

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・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	192,211,000株	97.562%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

(2)【投資対象】

<世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型>

投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

- ① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
 - 1) 有価証券
 - 2) 金銭債権
 - 3) 約束手形
 - 4) 為替手形
- ② 主として次のマザーファンドの受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
 - 1) 証券投資信託「日本リートインデックスJ-REITマザーファンド」
 - 2) 証券投資信託「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
 - 3) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
 - 4) 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
 - 5) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
 - 6) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
 - 7) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
 - 8) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)の証券の性質を有するもの
 - 9) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。）
 - 10) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）のうち投

資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの
11) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形

④ 次の取引ができます。

- 1) 外国為替予約取引
- 2) 資金の借入

<日本リートインデックスJ-REITマザーファンド>

わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) 金銭債権
- 3) 約束手形
- 4) 為替手形

② 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。

- 1) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 2) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 3) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの
- 4) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形

<海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) 金銭債権
- 3) 約束手形
- 4) 為替手形

② 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。

- 1) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 2) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)の証券の性質を有するもの
- 3) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 4) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの
- 5) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

- 1) 預金

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

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

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

- ① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。）
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- ② 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

- 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)～7)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 11) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12)に定めるもの以外のもの
 - 12) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 13) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 - 15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
- ③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
- ④ 次の取引ができます。
- 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引

◆投資対象とする投資信託証券の概要

<日本リートインデックスJ-REITマザーファンド>

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

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

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

<海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

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

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

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、NOMURA-BPI 総合*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI 総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は行ないません。 外貨建資産への投資は行ないません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ 100 分の 10、合計で 100 分の 20 を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し 0.1% (1 口当たり)
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限 (1998 年 10 月 30 日設定)
決算日	毎年 10 月 26 日 (休業日の場合は翌営業日)

*NOMURA-BPI 総合は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社 (以下「NFRC」) が公表している、わが国の債券市場の動きを示す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債、MBS、ABS など、国内で発行された円建公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存期間 1 年以上、残存額面 10 億円以上で、事業債、円建外債、MBS、ABS については、A 格相当以上の格付を取得しているものに限られます。

同指数の知的財産権は NFRC に帰属します。なお、NFRC は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行なわれる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

<海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として世界各国の債券に投資し、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は行ないません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとしします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ 100 分の 10、合計で 100 分の 20 を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し 0.2%（1 口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998 年 10 月 30 日設定）
決算日	毎年 10 月 26 日（休業日の場合は翌営業日）

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

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数）*配当込みの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主としてわが国の株式に投資し、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	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資は行ないません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1999年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

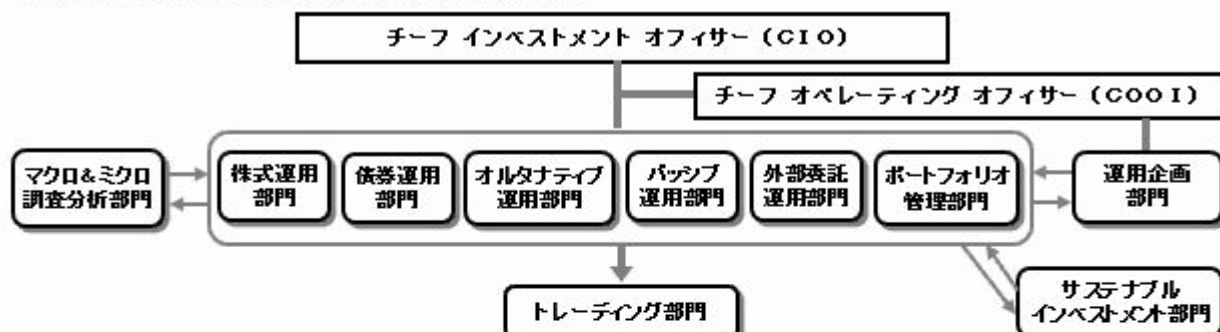
運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAI インデックス*（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカンントリーファンド等を含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAI インデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引や外国為替予約取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2000年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

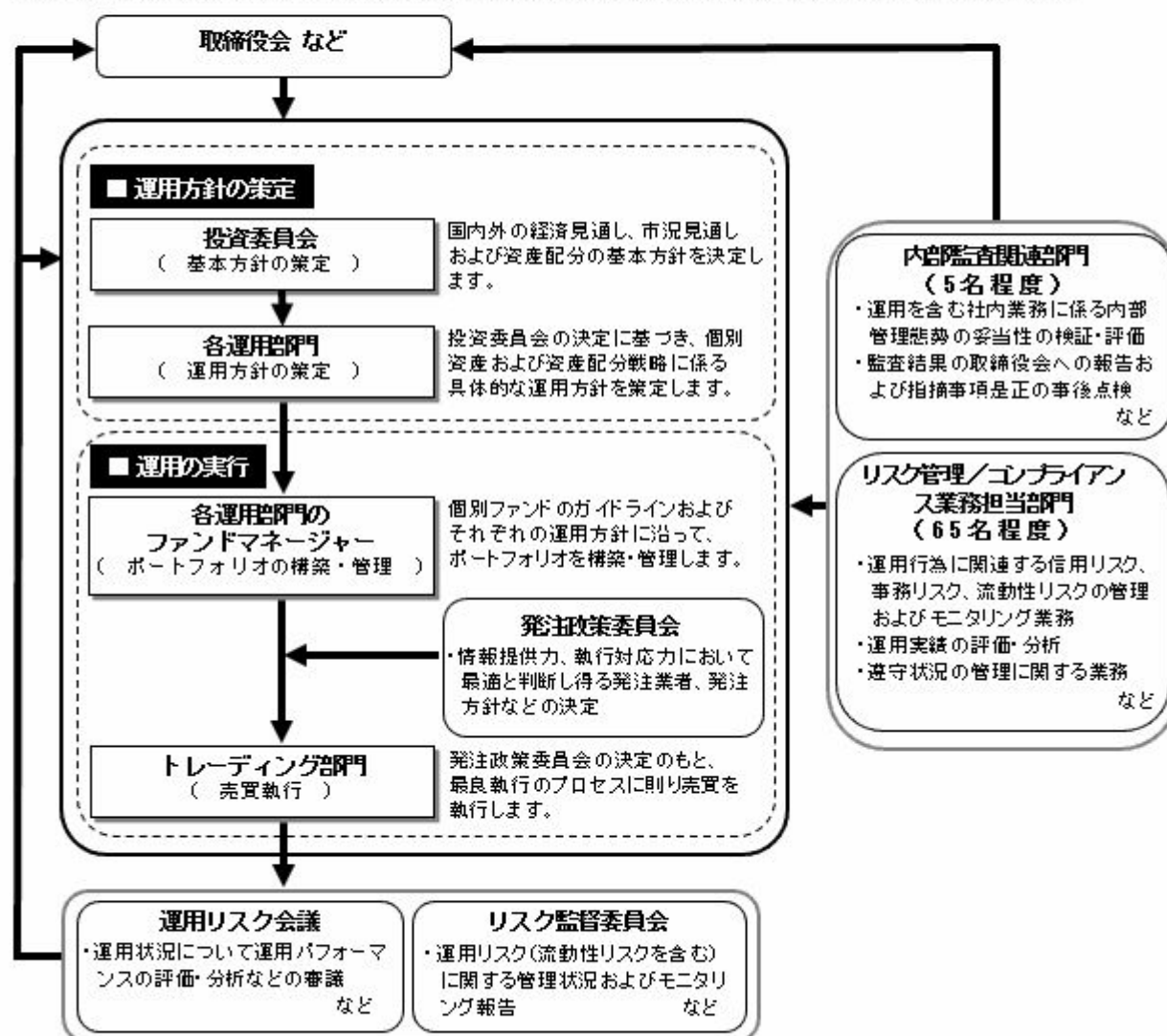
同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は MSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っております。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2023年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

① 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。

② 収益分配金の支払い

<分配金再投資コース>

原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。

<分配金受取りコース>

毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）から収益分配金を支払います。支払いは販売会社において行なわれます。

(5) 【投資制限】

① 約款に定める投資制限

<世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型>

1) 投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。

2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。

3) 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。

4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

5) 信託財産に属する外貨建資産の時価総額と投資信託証券の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

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

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

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

ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

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

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

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

<日本リートインデックスJ-REITマザーファンド>

1) 投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。

- 2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
- 3) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- 4) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ 100 分の 10、合計で 100 分の 20 を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

<日本株式インデックスTOP I Xマザーファンド>

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 5) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

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

回避する目的のため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 16) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

② 法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3 【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

① 価格変動リスク

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

格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。

② 流動性リスク

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

③ 信用リスク

- ・不動産投信が支払不能や債務超過の状態になった場合、またはそうなることが予想される場合、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れが生じた場合や廃止となる場合も不動産投信の価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
- ・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れが生じた場合や廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

④ 為替変動リスク

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

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

<その他の留意事項>

・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

◇諸事情により、投資対象とする投資信託証券（マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。）にかかる投資や換金ができない場合があります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができなくなる場合があります。また、一時的にファンドの取得・換金ができなくなることもあります。

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

・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項

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

・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項

ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。

・運用制限や規制上の制限に関する事項

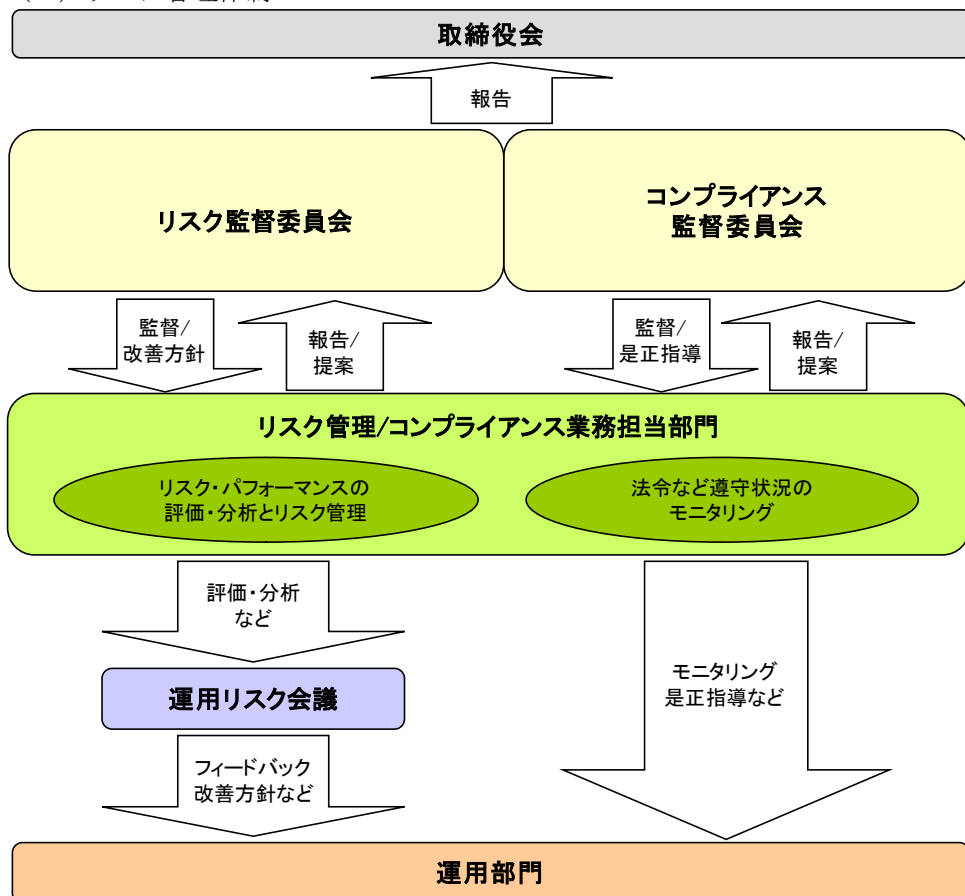
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限され

ることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。

- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項

ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

(2) リスク管理体制



■全社的リスク管理

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

■運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

■法令など遵守状況のモニタリング

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

※上記体制は2023年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	6.1%	8.4%	16.2%	7.2%	-0.7%	3.6%	4.8%
最大値	27.4%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	14.3%	21.5%
最小値	-8.7%	-12.8%	-12.4%	-19.4%	-5.5%	-6.1%	-8.8%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2019年1月から2023年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株 ……TOPIX(東証株価指数)配当込み

先進国株 ……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2019年1月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

日本国債 ……NOMURA-BPI国債

先進国債 ……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

TOPIX（東証株価指数） 配当込み

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

MSCI-KOKUSAI インデックス（配当込み、円ベース）

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

MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）

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

NOMURA-BPI 国債

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

FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

- ・販売会社における申込手数料率は3.3%（税抜3%）が上限となっております。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
- ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

※申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

(2) 【換金（解約）手数料】

- ① 換金手数料
ありません。

② 信託財産留保額

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

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

(3) 【信託報酬等】

① 信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年1.045%（税抜0.95%）の率を乗じて得た額とします。

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

② 信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.95%	0.40%	0.50%	0.05%

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

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

③ 支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

(4) 【その他の手数料等】

以下の諸費用およびそれに付随する消費税等相当額について、委託会社は、その支払いをファンドのために行ない、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。（以下「実費方式」といいます。）また、実際に支払う金

額の支弁を受ける代わりに、その金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、見積額に基づいて見積率を算出し、かかる見積率を信託財産の純資産総額に乗じて得た額をかかるとする諸費用の合計額とみなして、信託財産から支弁を受けることができます。(以下「見積方式」といいます。)ただし、委託会社は、信託財産の規模などを考慮して、信託の設定時または期中に、かかる諸費用の見積率を見直し、年率 0.1% を上限として、これを変更することができます。委託会社は、実費方式または見積方式のいずれを用いるかについて、信託期間を通じて随時、見直すことができます。これら諸費用は、委託会社が定めた時期に、信託財産から支払います。

- ① やむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合における発行および管理事務に係る費用。
- ② 有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書(これらの訂正に係る書類を含みます。)の作成、印刷および提出に係る費用。
- ③ 目論見書および仮目論見書(これらの訂正事項分を含みます。)の作成、印刷および交付に係る費用(これらを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。)
- ④ 信託約款の作成、印刷および交付に係る費用(これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。)
- ⑤ 運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用(これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。)
- ⑥ ファンドの受益者に対して行なう公告に係る費用ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用。
- ⑦ 格付の取得に要する費用。
- ⑧ ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。
- ⑨ ファンドの主要投資対象の1つである「日本リートインデックス J-REIT マザーファンド」の運用の基本方針に規定する「東証REIT指数(配当込み)」その他これに類する標章の使用料。
- ⑩ ファンドの主要投資対象の1つである「海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド」の運用の基本方針に規定する「S&P先進国REIT指数(除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース)」その他これに類する標章の使用料。

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

- ① 組入る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料。
- ② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用、解約に伴う支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

<投資対象とする投資信託証券に係る費用>

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

※監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

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

① 個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

を控除した利益

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

② 法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③ 個別元本

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

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

④ 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

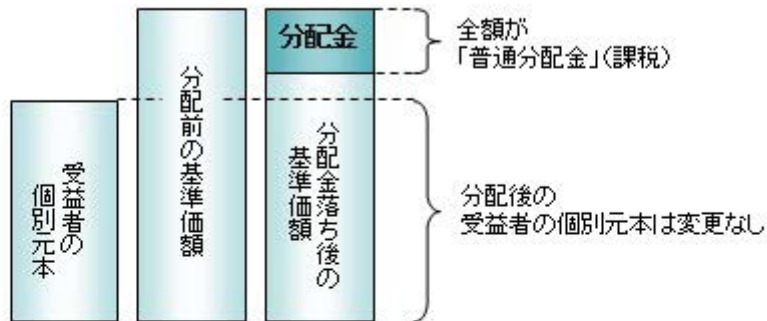
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

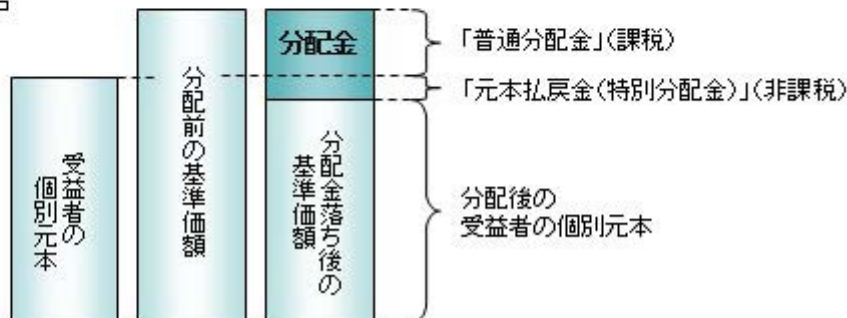
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

※上記は2024年3月15日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

(参考情報)ファンドの総経費率

対象期間:2023年6月16日~2023年12月15日

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
1.08%	1.04%	0.04%

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

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

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

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

5 【運用状況】

【世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

以下の運用状況は2023年12月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	38,173,370,041	98.26
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	677,581,819	1.74
合計（純資産総額）		38,850,951,860	100.00

(2) 【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	2,056,859,705	3.1665	6,513,046,256	3.1842	6,549,452,672	16.86
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	2,635,808,192	2.3870	6,291,674,155	2.4253	6,392,625,608	16.45
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	1,184,433,928	5.3408	6,325,824,723	5.3966	6,391,916,135	16.45
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	2,259,099,182	2.7902	6,303,338,538	2.8143	6,357,782,827	16.36
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	4,634,497,139	1.3415	6,217,177,911	1.3477	6,245,911,794	16.08
日本	親投資信託受益証券	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	2,487,307,940	2.5009	6,220,508,427	2.5070	6,235,681,005	16.05

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.26
合計	98.26

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

期別	純資産総額 (百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第18 特定期間末 (2014年 6月 16日)	52,281	52,353	0.7290	0.7300
第19 特定期間末 (2014年 12月 15日)	52,113	52,176	0.8237	0.8247
第20 特定期間末 (2015年 6月 15日)	48,576	48,632	0.8576	0.8586
第21 特定期間末 (2015年 12月 15日)	42,709	42,762	0.8131	0.8141
第22 特定期間末 (2016年 6月 15日)	39,155	39,206	0.7769	0.7779
第23 特定期間末 (2016年 12月 15日)	39,745	39,793	0.8277	0.8287
第24 特定期間末 (2017年 6月 15日)	36,443	36,487	0.8278	0.8288
第25 特定期間末 (2017年 12月 15日)	34,568	34,608	0.8629	0.8639
第26 特定期間末 (2018年 6月 15日)	32,895	32,934	0.8573	0.8583
第27 特定期間末 (2018年 12月 17日)	31,635	31,672	0.8421	0.8431
第28 特定期間末 (2019年 6月 17日)	31,844	31,881	0.8638	0.8648
第29 特定期間末 (2019年 12月 16日)	32,740	32,776	0.9108	0.9118
第30 特定期間末 (2020年 6月 15日)	29,571	29,607	0.8310	0.8320
第31 特定期間末 (2020年 12月 15日)	31,006	31,041	0.8907	0.8917
第32 特定期間末 (2021年 6月 15日)	34,941	34,975	1.0217	1.0227
第33 特定期間末 (2021年 12月 15日)	36,248	36,283	1.0365	1.0375
第34 特定期間末 (2022年 6月 15日)	35,426	35,462	0.9906	0.9916
第35 特定期間末 (2022年 12月 15日)	37,443	37,480	1.0208	1.0218
第36 特定期間末 (2023年 6月 15日)	39,363	39,400	1.0678	1.0688
第37 特定期間末 (2023年 12月 15日)	38,974	39,009	1.0988	1.0998
2022年 12月 末日	36,013	—	0.9801	—
2023年 1月 末日	36,744	—	0.9981	—
2月 末日	37,302	—	1.0118	—
3月 末日	36,854	—	1.0002	—
4月 末日	37,744	—	1.0209	—
5月 末日	38,502	—	1.0411	—
6月 末日	39,701	—	1.0839	—
7月 末日	39,657	—	1.0838	—
8月 末日	40,036	—	1.0948	—
9月 末日	38,832	—	1.0726	—
10月 末日	37,662	—	1.0430	—
11月 末日	39,154	—	1.0937	—

12月末日	38,850	—	1.1069	—
-------	--------	---	--------	---

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

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金(円)
第18特定期間	2013年12月17日～2014年6月16日	0.0060
第19特定期間	2014年6月17日～2014年12月15日	0.0060
第20特定期間	2014年12月16日～2015年6月15日	0.0060
第21特定期間	2015年6月16日～2015年12月15日	0.0060
第22特定期間	2015年12月16日～2016年6月15日	0.0060
第23特定期間	2016年6月16日～2016年12月15日	0.0060
第24特定期間	2016年12月16日～2017年6月15日	0.0060
第25特定期間	2017年6月16日～2017年12月15日	0.0060
第26特定期間	2017年12月16日～2018年6月15日	0.0060
第27特定期間	2018年6月16日～2018年12月17日	0.0060
第28特定期間	2018年12月18日～2019年6月17日	0.0060
第29特定期間	2019年6月18日～2019年12月16日	0.0060
第30特定期間	2019年12月17日～2020年6月15日	0.0060
第31特定期間	2020年6月16日～2020年12月15日	0.0060
第32特定期間	2020年12月16日～2021年6月15日	0.0060
第33特定期間	2021年6月16日～2021年12月15日	0.0060
第34特定期間	2021年12月16日～2022年6月15日	0.0060
第35特定期間	2022年6月16日～2022年12月15日	0.0060
第36特定期間	2022年12月16日～2023年6月15日	0.0060
第37特定期間	2023年6月16日～2023年12月15日	0.0060

③【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
第18特定期間	2013年12月17日～2014年6月16日	6.37
第19特定期間	2014年6月17日～2014年12月15日	13.81
第20特定期間	2014年12月16日～2015年6月15日	4.84
第21特定期間	2015年6月16日～2015年12月15日	△4.49
第22特定期間	2015年12月16日～2016年6月15日	△3.71
第23特定期間	2016年6月16日～2016年12月15日	7.31
第24特定期間	2016年12月16日～2017年6月15日	0.74
第25特定期間	2017年6月16日～2017年12月15日	4.96
第26特定期間	2017年12月16日～2018年6月15日	0.05
第27特定期間	2018年6月16日～2018年12月17日	△1.07
第28特定期間	2018年12月18日～2019年6月17日	3.29
第29特定期間	2019年6月18日～2019年12月16日	6.14

第30 特定期間	2019年12月17日～2020年6月15日	△8.10
第31 特定期間	2020年6月16日～2020年12月15日	7.91
第32 特定期間	2020年12月16日～2021年6月15日	15.38
第33 特定期間	2021年6月16日～2021年12月15日	2.04
第34 特定期間	2021年12月16日～2022年6月15日	△3.85
第35 特定期間	2022年6月16日～2022年12月15日	3.65
第36 特定期間	2022年12月16日～2023年6月15日	5.19
第37 特定期間	2023年6月16日～2023年12月15日	3.47

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

(4)【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第18 特定期間	2013年12月17日～2014年6月16日	548,220,875	8,763,039,619
第19 特定期間	2014年6月17日～2014年12月15日	848,123,250	9,300,633,130
第20 特定期間	2014年12月16日～2015年6月15日	1,077,889,968	7,702,577,651
第21 特定期間	2015年6月16日～2015年12月15日	822,766,387	4,936,873,357
第22 特定期間	2015年12月16日～2016年6月15日	559,222,913	2,691,021,175
第23 特定期間	2016年6月16日～2016年12月15日	788,561,373	3,167,580,874
第24 特定期間	2016年12月16日～2017年6月15日	535,316,706	4,530,717,126
第25 特定期間	2017年6月16日～2017年12月15日	675,282,245	4,636,099,733
第26 特定期間	2017年12月16日～2018年6月15日	900,474,282	2,591,559,940
第27 特定期間	2018年6月16日～2018年12月17日	1,657,593,437	2,463,297,514
第28 特定期間	2018年12月18日～2019年6月17日	1,553,018,779	2,252,941,131
第29 特定期間	2019年6月18日～2019年12月16日	1,375,802,750	2,295,826,563
第30 特定期間	2019年12月17日～2020年6月15日	1,727,094,985	2,087,383,750
第31 特定期間	2020年6月16日～2020年12月15日	1,154,110,398	1,927,320,256
第32 特定期間	2020年12月16日～2021年6月15日	2,277,192,099	2,890,774,812
第33 特定期間	2021年6月16日～2021年12月15日	2,642,144,579	1,866,998,446
第34 特定期間	2021年12月16日～2022年6月15日	2,197,942,225	1,407,308,080
第35 特定期間	2022年6月16日～2022年12月15日	2,127,865,577	1,212,529,506
第36 特定期間	2022年12月16日～2023年6月15日	1,533,696,702	1,347,087,591
第37 特定期間	2023年6月16日～2023年12月15日	1,301,936,668	2,696,216,303

(参考)

日本リートインデックス J-REIT マザーファンド

以下の運用状況は 2023 年 12 月 29 日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	60,424,740,300	98.97
コール・ローン等、その他資産 (負債控除後)	—	630,098,534	1.03
合計 (純資産総額)		61,054,838,834	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	6,848	569,733.13	3,901,532,541	611,000	4,184,128,000	6.85
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	6,030	544,819.2	3,285,259,793	584,000	3,521,520,000	5.77
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	18,984	162,114.28	3,077,577,664	165,000	3,132,360,000	5.13
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	28,139	97,475.87	2,742,873,657	101,900	2,867,364,100	4.70
日本	投資証券	GLP 投資法人 投資証券	19,829	144,632.11	2,867,910,221	140,500	2,785,974,500	4.56
日本	投資証券	日本プロジスリート投資法人 投資証券	10,226	294,433.63	3,010,878,364	271,400	2,775,336,400	4.55
日本	投資証券	KDX 不動産投資法人 投資証券	16,894	161,917.11	2,735,427,735	160,800	2,716,555,200	4.45
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	8,849	285,467.35	2,526,100,605	251,700	2,227,293,300	3.65
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	11,697	179,648.13	2,101,344,217	166,500	1,947,550,500	3.19
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	13,131	147,642.75	1,938,697,033	144,100	1,892,177,100	3.10
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,760	355,811.98	2,049,477,020	316,000	1,820,160,000	2.98
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	28,422	56,992.59	1,619,843,493	61,000	1,733,742,000	2.84
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	4,014	352,273.6	1,414,026,267	350,000	1,404,900,000	2.30
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	17,640	79,887.16	1,409,209,647	77,100	1,360,044,000	2.23
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	19,652	72,296.24	1,420,765,744	69,200	1,359,918,400	2.23
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	8,957	154,714.16	1,385,774,804	139,600	1,250,397,200	2.05
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	2,027	658,532.77	1,334,845,943	604,000	1,224,308,000	2.01
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資	3,080	405,628.03	1,249,334,340	388,500	1,196,580,000	1.96

		法人 投資証券						
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	7,504	159,795	1,199,101,683	152,000	1,140,608,000	1.87
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,442	507,934	1,240,374,844	457,500	1,117,215,000	1.83
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	3,760	316,302.59	1,189,297,754	286,000	1,075,360,000	1.76
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	7,201	154,205.02	1,110,430,378	141,400	1,018,221,400	1.67
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	6,903	149,911.48	1,034,838,966	140,200	967,800,600	1.59
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,178	485,133	1,056,619,677	433,000	943,074,000	1.54
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,886	347,167.19	1,001,924,536	317,000	914,862,000	1.50
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	8,645	113,122.5	977,944,047	104,300	901,673,500	1.48
日本	投資証券	森トラストリート投資法人 投資証券	11,316	71,137.05	804,986,881	72,500	820,410,000	1.34
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,493	155,746.55	855,515,850	149,200	819,555,600	1.34
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,216	617,005.01	750,278,103	665,000	808,640,000	1.32
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	2,027	418,350.81	847,997,092	374,500	759,111,500	1.24

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.97
合計	98.97

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2023年12月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	アメリカ	45,292,142,320	76.83
	カナダ	887,519,979	1.51
	ドイツ	23,410,322	0.04
	イタリア	6,254,168	0.01
	フランス	1,067,169,262	1.81
	オランダ	105,545,846	0.18
	スペイン	258,682,339	0.44
	ベルギー	689,618,425	1.17
	アイルランド	25,150,415	0.04
	イギリス	2,828,479,263	4.80
	オーストラリア	4,006,654,351	6.80
	ニュージーランド	78,448,759	0.13
	香港	703,649,863	1.19
	シンガポール	2,035,498,995	3.45
	韓国	108,047,476	0.18
	イスラエル	73,788,600	0.13
ガンジー	176,929,605	0.30	
	小計	58,366,989,988	99.01
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	583,618,037	0.99
合計（純資産総額）		58,950,608,025	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	—	32,990,046	△0.06

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	272,258	17,317.44	4,714,812,396	19,173.99	5,220,274,266	8.86
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	27,672	110,180.63	3,048,918,545	115,462.38	3,195,075,109	5.42
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	163,180	11,621.55	1,896,404,562	12,929.22	2,109,790,577	3.58
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	46,642	40,234.33	1,876,609,825	43,655.27	2,036,169,290	3.45

アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	96,129	15,808.37	1,519,642,972	20,463.23	1,967,110,067	3.34
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	213,550	8,597.98	1,836,100,757	8,308.40	1,774,259,119	3.01
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	89,275	15,241.05	1,360,644,900	19,305.89	1,723,534,187	2.92
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	62,264	20,219.28	1,258,933,549	22,999.15	1,432,019,250	2.43
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	304,753	4,577.53	1,395,018,054	4,564.08	1,390,919,937	2.36
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	509,425	1,920.30	978,250,366	2,443.85	1,244,962,056	2.11
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	41,899	26,937.77	1,128,665,705	26,890.96	1,126,704,668	1.91
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	101,836	9,393.40	956,586,375	8,864.37	902,712,493	1.53
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	86,006	8,091.40	695,909,077	10,013.19	861,195,107	1.46
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	118,672	6,572.40	779,960,114	7,226.23	857,552,175	1.45
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	46,007	17,228.09	792,612,741	18,281.88	841,094,775	1.43
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	169,553	4,829.31	818,824,253	4,921.50	834,455,259	1.42
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	36,680	18,938.55	694,666,377	19,165.48	702,990,096	1.19
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	18,944	33,128.65	627,589,172	35,847.53	679,095,656	1.15
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	34,384	21,668.78	745,059,586	19,366.88	665,911,025	1.13
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	64,525	9,746.25	628,876,833	9,315.39	601,075,824	1.02
香港	投資証券	LINK REIT	754,780	841.07	634,823,569	795.87	600,712,419	1.02
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	361,740	1,364.13	493,461,833	1,621.06	586,402,592	0.99
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	207,751	2,466.42	512,401,991	2,789.79	579,582,930	0.98
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	182,189	2,740.15	499,226,209	3,091.89	563,309,076	0.96
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	54,954	9,600.47	527,584,377	10,157.86	558,215,291	0.95
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	78,764	7,076.41	557,366,504	7,044.69	554,868,444	0.94
アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	62,112	7,532.20	467,840,427	8,081.47	501,956,476	0.85
アメリカ	投資証券	UDR INC	89,309	6,080.25	543,021,234	5,498.74	491,087,783	0.83
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	93,555	4,951.28	463,217,496	5,148.42	481,661,275	0.82
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	48,327	8,644.53	417,764,612	9,594.79	463,687,875	0.79

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.01
合計	99.01

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	加ドル	売建	50,000.00	5,353,000	5,356,580	△0.01
	豪ドル	売建	120,000.00	11,612,400	11,622,228	△0.02
	香港ドル	売建	350,000.00	6,342,350	6,346,165	△0.01
	シンガポールドル	売建	90,000.00	9,662,490	9,665,073	△0.02

(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 2023 年 12 月 29 日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	46,019,047,370	87.68
地方債証券	日本	2,730,784,294	5.20
特殊債券	日本	2,412,615,820	4.60
社債券	日本	1,198,778,172	2.28
コール・ローン等、その他資産 (負債控除後)	—	124,308,686	0.24
合計 (純資産総額)		52,485,534,342	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
日本	国債証券	第341回利付国債 (10年)	700,000,000	100.47	703,297,000	100.54	703,836,000	0.300	2025/12/20	1.34
日本	国債証券	第344回利付国債 (10年)	700,000,000	99.87	699,090,000	100.16	701,134,000	0.100	2026/9/20	1.34
日本	国債証券	第347回利付国債 (10年)	680,000,000	99.54	676,919,600	100.06	680,462,400	0.100	2027/6/20	1.30
日本	国債証券	第345回利付国債 (10年)	660,000,000	99.78	658,548,000	100.14	660,970,200	0.100	2026/12/20	1.26
日本	国債証券	第346回利付国債 (10年)	660,000,000	99.67	657,881,400	100.12	660,838,200	0.100	2027/3/20	1.26
日本	国債証券	第343回利付国債 (10年)	645,000,000	99.94	644,658,150	100.15	646,025,550	0.100	2026/6/20	1.23
日本	国債証券	第342回利付国債 (10年)	630,000,000	100.00	630,000,000	100.15	630,970,200	0.100	2026/3/20	1.20
日本	国債証券	第340回利付国債 (10年)	620,000,000	100.65	624,054,800	100.66	624,129,200	0.400	2025/9/20	1.19
日本	国債証券	第349回利付国債 (10年)	590,000,000	99.24	585,521,900	99.92	589,533,900	0.100	2027/12/20	1.12
日本	国債証券	第358回利付国債 (10年)	590,000,000	97.34	574,306,000	98.90	583,521,800	0.100	2030/3/20	1.11
日本	国債証券	第339回利付国債 (10年)	570,000,000	100.61	573,516,900	100.58	573,323,100	0.400	2025/6/20	1.09
日本	国債証券	第360回利付国債 (10年)	580,000,000	96.68	560,784,600	98.49	571,242,000	0.100	2030/9/20	1.09
日本	国債証券	第357回利付国債 (10年)	560,000,000	97.61	546,638,400	99.03	554,579,200	0.100	2029/12/20	1.06
日本	国債証券	第350回利付国債 (10年)	540,000,000	99.06	534,967,200	99.74	538,644,600	0.100	2028/3/20	1.03
日本	国債証券	第351回利付国債 (10年)	535,000,000	98.87	529,002,650	99.64	533,106,100	0.100	2028/6/20	1.02
日本	国債証券	第352回利付国債 (10年)	520,000,000	98.67	513,120,400	99.46	517,207,600	0.100	2028/9/20	0.99

日本	国債証券	第348回利付国債 (10年)	500,000,000	99.40	497,005,000	100.00	500,000,000	0.100	2027/9/20	0.95
日本	国債証券	第363回利付国債 (10年)	500,000,000	95.57	477,875,000	97.68	488,430,000	0.100	2031/6/20	0.93
日本	国債証券	第364回利付国債 (10年)	500,000,000	95.18	475,940,000	97.39	486,960,000	0.100	2031/9/20	0.93
日本	国債証券	第371回利付国債 (10年)	480,000,000	96.49	463,182,700	98.16	471,196,800	0.400	2033/6/20	0.90
日本	国債証券	第361回利付国債 (10年)	460,000,000	96.30	443,016,800	98.23	451,876,400	0.100	2030/12/20	0.86
日本	国債証券	第368回利付国債 (10年)	450,000,000	95.06	427,781,400	97.13	437,089,500	0.200	2032/9/20	0.83
日本	国債証券	第370回利付国債 (10年)	420,000,000	96.87	406,854,000	99.30	417,060,000	0.500	2033/3/20	0.79
日本	国債証券	第359回利付国債 (10年)	420,000,000	97.02	407,488,200	98.70	414,544,200	0.100	2030/6/20	0.79
日本	国債証券	第367回利付国債 (10年)	420,000,000	95.37	400,583,400	97.40	409,109,400	0.200	2032/6/20	0.78
日本	国債証券	第365回利付国債 (10年)	410,000,000	95.19	390,290,800	97.12	398,208,400	0.100	2031/12/20	0.76
日本	国債証券	第353回利付国債 (10年)	400,000,000	98.48	393,944,000	99.38	397,544,000	0.100	2028/12/20	0.76
日本	国債証券	第338回利付国債 (10年)	390,000,000	100.55	392,172,300	100.50	391,973,400	0.400	2025/3/20	0.75
日本	国債証券	第362回利付国債 (10年)	400,000,000	95.95	383,800,000	97.96	391,868,000	0.100	2031/3/20	0.75
日本	国債証券	第366回利付国債 (10年)	400,000,000	95.31	381,268,000	97.67	390,692,000	0.200	2032/3/20	0.74

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	87.68
地方債証券	5.20
特殊債券	4.60
社債券	2.28
合計	99.76

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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2023年12月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	73,753,900,933	46.46
	カナダ	3,152,184,923	1.99
	メキシコ	1,432,145,993	0.90
	ドイツ	10,443,858,460	6.58
	イタリア	11,954,022,326	7.53
	フランス	13,333,067,736	8.40
	オランダ	2,411,345,374	1.52
	スペイン	7,794,162,235	4.91
	ベルギー	2,839,827,499	1.79
	オーストリア	1,903,960,009	1.20
	フィンランド	838,867,950	0.53
	アイルランド	926,028,498	0.58
	イギリス	8,314,571,693	5.24
	スウェーデン	340,097,834	0.21
	ノルウェー	286,894,696	0.18
	デンマーク	450,780,724	0.28
	ポーランド	813,763,749	0.51
	オーストラリア	2,269,082,042	1.43
	ニュージーランド	392,673,675	0.25
	シンガポール	676,870,592	0.43
マレーシア	796,551,325	0.50	
中国	11,794,494,297	7.43	
イスラエル	475,917,349	0.30	
	小計	157,395,069,912	99.16
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	1,338,576,395	0.84
合計（純資産総額）		158,733,646,307	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	—	39,671,070	0.02

(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	6,750,000	13,715.40	925,789,545	14,013.45	945,908,308	3.625	2026/5/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,190,000	11,863.29	852,971,229	12,673.82	911,248,342	1.750	2029/11/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	13,324.26	814,112,402	14,462.77	883,675,483	4.125	2032/11/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,950,000	13,714.84	816,033,429	14,329.80	852,623,590	4.125	2028/7/31	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,130,000	10,828.11	772,044,288	11,768.55	839,098,114	1.250	2031/8/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,830,000	10,850.54	741,092,438	11,810.38	806,649,136	1.375	2031/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,740,000	13,414.01	769,964,285	13,620.10	781,794,033	1.125	2025/2/28	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,330,000	11,257.04	712,571,082	12,192.94	771,813,148	1.625	2031/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,240,000	11,236.14	701,135,220	12,229.50	763,121,080	1.875	2032/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,950,000	11,978.96	712,748,227	12,498.20	743,642,985	0.375	2027/7/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,136.45	706,822,570	14,309.03	715,451,507	5.000	2025/8/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,900,000	13,396.28	656,417,875	14,284.64	699,947,828	4.000	2030/7/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,672.18	683,609,254	13,869.69	693,484,877	3.000	2025/7/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,663.32	683,166,035	13,855.84	692,792,037	2.875	2025/6/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,382.42	669,121,319	13,855.01	692,750,906	3.250	2027/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,910,000	10,801.23	638,352,920	11,675.20	690,004,585	0.875	2030/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,980,000	12,978.55	646,331,854	13,743.65	684,433,930	3.250	2029/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	11,961.91	610,057,605	13,029.51	664,505,050	2.750	2032/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	13,038.37	631,057,358	13,375.77	647,387,488	1.625	2026/5/15	0.41
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	2,022.35	647,153,970	2,023.02	647,367,117	3.020	2025/10/22	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,730,000	13,408.75	634,233,876	13,642.82	645,305,682	2.000	2025/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	12,420.64	597,433,206	13,158.60	632,928,874	2.375	2029/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	12,135.32	582,495,810	13,182.70	632,769,666	2.875	2032/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,930,000	11,999.58	591,579,485	12,682.97	625,270,793	1.500	2028/11/30	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,530,000	13,589.35	615,597,843	13,760.82	623,365,546	2.000	2025/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,590,000	12,656.93	580,953,434	13,360.82	613,261,898	2.625	2029/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,630,000	12,444.74	576,191,727	13,178.54	610,166,669	2.375	2029/3/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,090,000	10,673.53	543,282,682	11,521.74	586,456,791	0.625	2030/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	13,624.54	572,230,864	13,852.52	581,805,921	3.000	2025/9/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	12,940.86	543,516,416	13,570.79	569,973,214	2.875	2028/8/15	0.36

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.16
合計	99.16

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	280,000.00	39,666,800	39,671,070	0.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2023年12月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	53,522,227,690	99.53
コール・ローン等、その他資産 (負債控除後)	—	253,818,641	0.47
合計 (純資産総額)		53,776,046,331	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	260,260,000	0.48

(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	875,100	2,595.45	2,271,279,480	2,590.50	2,266,946,550	4.22
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	112,700	12,259.68	1,381,666,728	13,410.00	1,511,307,000	2.81
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	957,200	1,226.59	1,174,091,948	1,211.50	1,159,647,800	2.16
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,900	52,568.03	835,831,712	62,120.00	987,708,000	1.84
日本	株式	信越化学工業	化学	144,800	4,260.64	616,940,684	5,917.00	856,781,600	1.59
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	33,700	19,433.86	654,921,356	25,255.00	851,093,500	1.58
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4,755,500	173.45	824,885,060	172.30	819,372,650	1.52
日本	株式	日立製作所	電気機器	77,400	8,736.31	676,190,422	10,170.00	787,158,000	1.46
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	111,600	7,115.40	794,079,190	6,880.00	767,808,000	1.43
日本	株式	三菱商事	卸売業	332,700	2,302.44	766,024,597	2,253.50	749,739,450	1.39
日本	株式	任天堂	その他製品	100,600	6,131.02	616,781,000	7,359.00	740,315,400	1.38
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	121,300	4,248.27	515,315,680	5,963.00	723,311,900	1.35
日本	株式	三井物産	卸売業	127,100	5,329.74	677,410,191	5,298.00	673,375,800	1.25
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	111,200	5,353.47	595,306,897	5,767.00	641,290,400	1.19
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	141,500	4,339.95	614,103,660	4,054.00	573,641,000	1.07
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	388,700	1,591.19	618,497,580	1,466.00	569,834,200	1.06
日本	株式	KDDI	情報・通信業	123,600	4,456.91	550,874,320	4,486.00	554,469,600	1.03
日本	株式	HOYA	精密機器	31,400	14,461.24	454,082,936	17,625.00	553,425,000	1.03
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	155,200	3,340.56	518,455,050	3,529.00	547,700,800	1.02
日本	株式	第一三共	医薬品	139,300	4,023.24	560,438,544	3,872.00	539,369,600	1.00

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	211,900	2,500.77	529,914,300	2,412.50	511,208,750	0.95
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	78,900	6,044.40	476,903,198	6,293.00	496,517,700	0.92
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	86,700	4,670.28	404,913,381	5,251.00	455,261,700	0.85
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	257,300	1,683.18	433,084,276	1,759.50	452,719,350	0.84
日本	株式	ダイキン工業	機械	19,200	21,202.10	407,080,478	22,985.00	441,312,000	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	145,100	2,497.35	362,366,388	2,993.00	434,284,300	0.81
日本	株式	SMC	機械	4,800	68,484.58	328,726,000	75,760.00	363,648,000	0.68
日本	株式	三菱電機	電気機器	179,300	1,731.68	310,491,216	1,999.00	358,420,700	0.67
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	95,400	3,460.28	330,111,664	3,645.00	347,733,000	0.65
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	58,200	5,418.06	315,331,444	5,595.00	325,629,000	0.61

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	0.34
		建設業	2.11
		食料品	3.36
		繊維製品	0.40
		パルプ・紙	0.17
		化学	6.17
		医薬品	4.60
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.69
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.96
		非鉄金属	0.67
		金属製品	0.52
		機械	5.31
		電気機器	17.47
		輸送用機器	8.15
		精密機器	2.35
		その他製品	2.36
		電気・ガス業	1.40
		陸運業	2.83
		海運業	0.84
		空運業	0.45
		倉庫・運輸関連業	0.15
情報・通信業	7.69		
卸売業	6.96		
小売業	4.28		

		銀行業	6.84
		証券、商品先物取引業	0.80
		保険業	2.37
		その他金融業	1.15
		不動産業	1.94
		サービス業	4.97
合 計			99.53

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2024年03月	買建	11	日本円	258,711,950	260,260,000	0.48

(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2023年12月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	231,444,510,147	69.42
	カナダ	11,328,975,187	3.40
	ドイツ	8,074,776,103	2.42
	イタリア	1,838,652,400	0.55
	フランス	10,333,937,312	3.10
	オランダ	6,302,182,981	1.89
	スペイン	2,391,606,409	0.72
	ベルギー	730,597,788	0.22
	オーストリア	164,348,727	0.05
	ルクセンブルク	175,433,317	0.05
	フィンランド	1,025,041,864	0.31
	アイルランド	6,223,970,726	1.87
	ポルトガル	168,114,478	0.05
	イギリス	12,784,172,680	3.83
	スイス	10,418,117,395	3.12
	スウェーデン	3,012,244,914	0.90
	ノルウェー	619,822,310	0.19
	デンマーク	3,138,046,479	0.94
	ケイマン	415,128,990	0.12
	オーストラリア	6,534,999,568	1.96
	バミューダ	336,874,410	0.10
	ニュージーランド	254,588,872	0.08
	香港	1,642,009,416	0.49
	シンガポール	999,459,226	0.30
	イスラエル	652,594,235	0.20
	ジャージー	889,950,383	0.27
アラブ首長国連邦	0	0.00	
マン島	44,755,347	0.01	
小計		321,944,911,664	96.56
投資証券	アメリカ	5,973,502,069	1.79
	カナダ	14,674,292	0.00
	フランス	134,675,118	0.04
	ベルギー	34,881,520	0.01
	イギリス	107,463,115	0.03

	オーストラリア	402,016,140	0.12
	香港	82,898,600	0.02
	シンガポール	134,600,597	0.04
	小計	6,884,711,451	2.06
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	4,585,643,744	1.38
合計（純資産総額）		333,415,266,859	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,112,148,105	1.23
	買建	ドイツ	771,522,048	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	—	4,109,590,310	1.23

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	639,314	24,312.36	15,543,237,456	27,455.45	17,552,654,456	5.26
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	288,724	48,395.39	13,972,910,923	53,225.96	15,367,612,768	4.61
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	379,880	17,312.07	6,576,509,769	21,753.88	8,263,865,986	2.48
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	101,040	59,411.53	6,002,941,523	70,237.05	7,096,751,795	2.13
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・エンターテインメント	242,760	17,842.46	4,331,437,042	19,888.82	4,828,210,162	1.45
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・エンターテインメント	90,840	42,591.43	3,869,005,543	50,820.52	4,616,536,546	1.38
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・エンターテインメント	213,370	17,985.43	3,837,551,490	20,037.74	4,275,453,096	1.28
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	116,905	30,210.39	3,531,746,779	35,908.51	4,197,885,460	1.26
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	18,175	122,070.96	2,218,639,784	159,191.41	2,893,303,882	0.87
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	119,000	19,947.80	2,373,788,881	24,153.64	2,874,284,231	0.86
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	37,925	75,212.12	2,852,419,803	74,446.56	2,823,386,053	0.85

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	33,019	83,190.66	2,746,872,471	82,381.95	2,720,169,789	0.82
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	53,565	47,851.11	2,563,144,806	50,714.15	2,716,503,611	0.81
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	65,802	33,621.52	2,212,363,748	36,932.53	2,430,234,471	0.73
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	164,071	15,389.25	2,524,930,928	14,209.94	2,331,440,329	0.70
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	98,661	21,504.17	2,121,623,354	22,207.74	2,191,037,974	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	34,465	54,831.79	1,889,777,929	60,464.96	2,083,925,039	0.63
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	40,975	39,943.74	1,636,694,806	49,266.06	2,018,677,169	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	96,549	21,351.66	2,061,481,666	20,668.88	1,995,560,265	0.60
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	133,730	14,590.58	1,951,198,310	14,718.05	1,968,245,629	0.59
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	109,430	16,580.32	1,814,384,910	16,283.94	1,781,952,605	0.53
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	16,527	88,352.74	1,460,205,760	107,768.60	1,781,091,784	0.53
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	18,064	78,169.57	1,412,055,226	94,047.47	1,698,873,552	0.51
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	104,003	14,704.07	1,529,268,114	15,426.84	1,604,438,587	0.48
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	72,336	20,608.75	1,490,755,104	21,948.19	1,587,644,453	0.48
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	74,361	22,072.51	1,641,333,940	21,241.87	1,579,567,372	0.47
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	18,599	74,142.88	1,378,983,524	84,462.60	1,570,919,927	0.47
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	39,886	28,068.11	1,119,524,787	37,667.21	1,502,394,394	0.45
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	293,229	3,638.01	1,066,772,555	4,805.20	1,409,024,108	0.42
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	168,402	7,965.36	1,341,383,821	8,332.51	1,403,211,770	0.42

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	4.64
		素材	4.02
		資本財	6.86
		商業・専門サービス	1.56
		運輸	1.81
		自動車・自動車部品	2.07
		耐久消費財・アパレル	1.53
		消費者サービス	2.08
		メディア・娯楽	5.94
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.58
		生活必需品流通・小売り	1.69
		食品・飲料・タバコ	3.49
		家庭用品・パーソナル用品	1.61
		ヘルスケア機器・サービス	4.31
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.84
		銀行	5.43
		金融サービス	6.70
		保険	3.00
		ソフトウェア・サービス	9.98
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.69
		電気通信サービス	1.15
公益事業	2.66		
半導体・半導体製造装置	6.57		
不動産管理・開発	0.35		
投資証券	—	—	2.06
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	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 EMINI2403	買建	120	米ドル	28,399,637.5	4,027,920,587	28,993,500	4,112,148,105	1.23
	ドイツ	ユーレックス ・ドイツ 金融先物取 引所	DJSTX5 2403	買建	120	ユーロ	4,923,160	773,526,899	4,910,400	771,522,048	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	24,600,000.00	3,555,071,680	3,468,772,640	1.04
	ユーロ	買建	4,100,000.00	645,804,035	640,817,670	0.19

(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。

運用実績

2023年12月29日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 11,069円

純資産総額…………… 388.50億円

※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、2013年12月末の基準価額を起点として指数化しています。
※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2023年8月	2023年9月	2023年10月	2023年11月	2023年12月	直近1年間累計	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	120円	5,420円

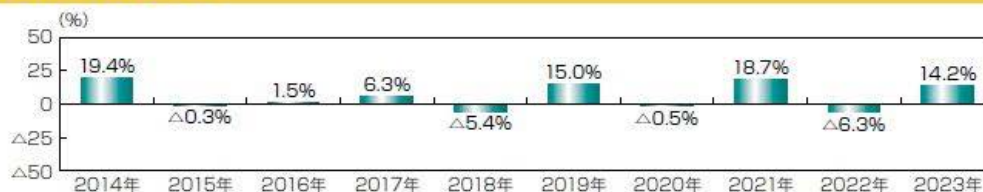
主要な資産の状況

組入資産	投資対象	比率*1	組入上位の銘柄名	国名	比率*2
日本リートインデックス J-REITマザーファンド	日本リート	16.1%	日本ビルファンド投資法人 投資証券	日本	6.9%
			ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	日本	5.8%
			野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	日本	5.1%
			日本都市ファンド投資法人 投資証券	日本	4.7%
			GLP投資法人 投資証券	日本	4.6%
海外リートインデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外リート	16.9%	PROLOGIS INC	アメリカ	8.9%
			EQUINIX INC	アメリカ	5.4%
			WELLTOWER INC	アメリカ	3.6%
			PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.5%
			SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.3%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	16.1%	第341回利付国債(10年)	日本	1.3%
			第344回利付国債(10年)	日本	1.3%
			第347回利付国債(10年)	日本	1.3%
			第345回利付国債(10年)	日本	1.3%
			第346回利付国債(10年)	日本	1.3%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外債券	16.4%	US TREASURY N/B(3.625%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(1.75%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(4.125%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(4.125%)	アメリカ	0.5%
			US TREASURY N/B(1.25%)	アメリカ	0.5%
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	16.5%	トヨタ自動車	日本	4.2%
			ソニーグループ	日本	2.8%
			三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	2.2%
			キーエンス	日本	1.8%
			信越化学工業	日本	1.6%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	海外株式	16.5%	APPLE INC	アメリカ	5.3%
			MICROSOFT CORP	アメリカ	4.6%
			AMAZON.COM INC	アメリカ	2.5%
			VIDIA CORP	アメリカ	2.1%
			ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.4%
現金その他		1.7%			

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

*2:各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

(2) コースの選択

収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース＞と＜分配金受取りコース＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。

＜分配金再投資コース＞

収益分配金を自動的に再投資するコースです。なお、販売会社によっては、収益分配金を定期的に取り取るための「定期引出契約」を結ぶことができる場合があります。

＜分配金受取りコース＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 取扱時間

原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続が完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の扱いとなります。

(5) 取得申込不可日

販売会社の営業日であっても、取得申込日が下記のいずれかに該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

●ニューヨーク証券取引所の休業日

●ニューヨークの銀行休業日

(6) 申込金額

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

(7) 申込単位

販売会社の照会先にお問い合わせください。

(8) 申込代金の支払い

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

(9) 受付の中止および取消

委託会社は、投資対象とする投資信託証券（マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。）への投資ができない場合、金融商品取引所[※]における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。

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

(10) 償還乗換

- ・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができる場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。

(11) 乗換優遇

受益者は、信託期間終了日の1年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができる場合があります。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

2【換金（解約）手続等】

＜解約請求による換金＞

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

原則として、午後3時までに、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。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の扱いとなります。

(3) 解約請求不可日

販売会社の営業日であっても、解約請求日が下記のいずれかに該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

- ニューヨーク証券取引所の休業日
- ニューヨークの銀行休業日

(4) 解約制限

ファンドの規模および商品性格などにに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(5) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た額）を控除した価額とします。

- ・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 手取額

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

(7) 解約単位

1口単位

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

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

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

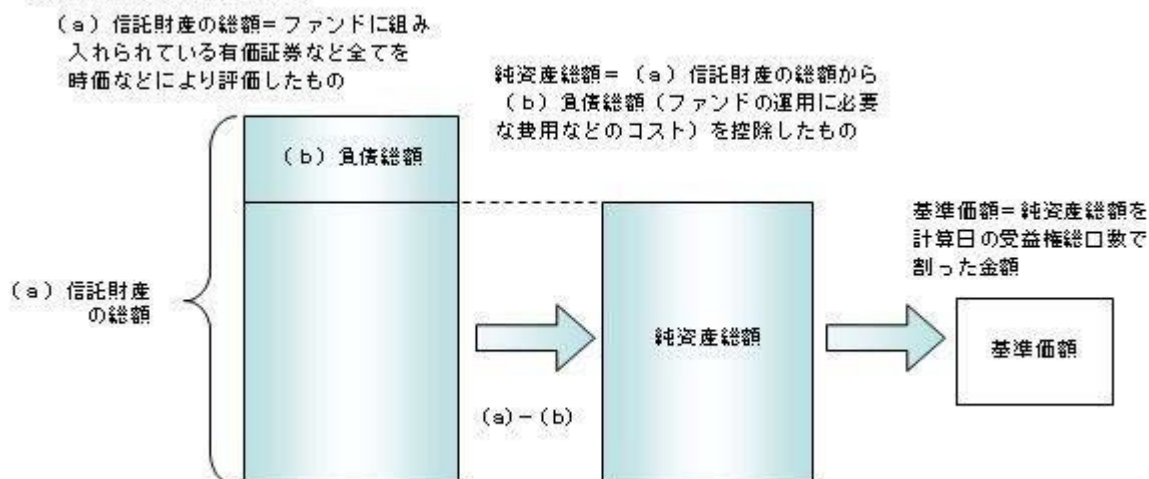
3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

① 基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



② 有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

◇マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

◇国内上場株式

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

◇外国株式

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

◇公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。

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

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

*外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

◇国内上場不動産投信

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

◇海外上場不動産投信

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

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

③ 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします（2005年9月29日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

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

(5) 【その他】

① 信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回るようになった場合
 - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合
 - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）
 - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

② 償還金について

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

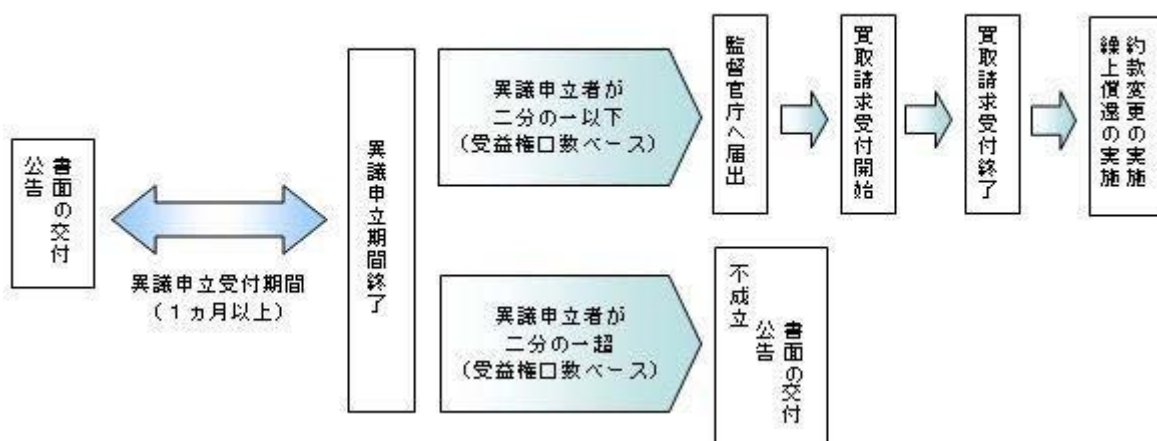
③ 信託約款の変更

- 1) 委託会社は、受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。

④ 異議の申立て

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

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



⑤ 公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

⑥ 運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

⑦ 関係法人との契約について

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

4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 38 年大蔵省令第 59 号）並びに同規則第 2 条の 2 の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、6 ヶ月未満であるため、財務諸表は 6 ヶ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、2023 年 6 月 16 日から 2023 年 12 月 15 日までの特定期間の財務諸表について、PwC Japan 有限責任監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年3月6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 榎原 康太
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2023年6月16日から2023年12月15日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2023年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、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) 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。

1 【財務諸表】

【世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 2023年6月15日現在	当期 2023年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	815,533,330	751,819,572
親投資信託受益証券	38,660,635,437	38,309,538,727
未収入金	35,302,831	86,192,280
流動資産合計	39,511,471,598	39,147,550,579
資産合計	39,511,471,598	39,147,550,579
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	36,865,702	35,471,422
未払解約金	69,300,347	100,274,126
未払受託者報酬	1,803,533	1,769,167
未払委託者報酬	32,463,791	31,845,225
未払利息	1,504	95
その他未払費用	7,199,945	3,670,271
流動負債合計	147,634,822	173,030,306
負債合計	147,634,822	173,030,306
純資産の部		
元本等		
元本	36,865,702,370	35,471,422,735
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,498,134,406	3,503,097,538
（分配準備積立金）	6,617,799,400	7,303,442,520
元本等合計	39,363,836,776	38,974,520,273
純資産合計	39,363,836,776	38,974,520,273
負債純資産合計	39,511,471,598	39,147,550,579

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期		当期	
	自 2022年12月16日 至 2023年6月15日		自 2023年6月16日 至 2023年12月15日	
営業収益				
有価証券売買等損益		2,156,149,726		1,545,406,846
営業収益合計		2,156,149,726		1,545,406,846
営業費用				
支払利息		85,276		113,840
受託者報酬		10,192,653		10,806,422
委託者報酬		183,468,905		194,516,792
その他費用		4,882,573		4,393,209
営業費用合計		198,629,407		209,830,263
営業利益又は営業損失(△)		1,957,520,319		1,335,576,583
経常利益又は経常損失(△)		1,957,520,319		1,335,576,583
当期純利益又は当期純損失(△)		1,957,520,319		1,335,576,583
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(△)		8,716,214		402,296
期首剰余金又は期首欠損金(△)		764,741,380		2,498,134,406
剰余金増加額又は欠損金減少額		30,385,099		102,484,690
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,691,813		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		25,693,286		102,484,690
剰余金減少額又は欠損金増加額		24,652,570		215,306,593
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		21,093,349		215,306,593
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,559,221		-
分配金		221,143,608		217,389,252
期末剰余金又は期末欠損金(△)		2,498,134,406		3,503,097,538

(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)

	前期 2023年6月15日現在	当期 2023年12月15日現在
1. 期首元本額	36,679,093,259円	36,865,702,370円
期中追加設定元本額	1,533,696,702円	1,301,936,668円
期中一部解約元本額	1,347,087,591円	2,696,216,303円
2. 受益権の総数	36,865,702,370口	35,471,422,735口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2022年12月16日 至 2023年6月15日		当期 自 2023年6月16日 至 2023年12月15日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
自 2022年12月16日 至 2023年1月16日		自 2023年6月16日 至 2023年7月18日	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	44,066,122円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	71,954,080円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	70,212,173円
C 信託約款に定める収益調整金	2,407,803,695円	C 信託約款に定める収益調整金	2,682,826,878円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	6,391,329,136円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	6,509,669,723円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	8,843,198,953円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)	9,334,662,854円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,404円	F 分配対象収益(1万口当たり)	2,551円
G 分配金額	36,774,256円	G 分配金額	36,589,520円
H 分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	10円
自 2023年1月17日 至 2023年2月15日		自 2023年7月19日 至 2023年8月15日	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	51,614,248円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	54,842,374円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	410,289,912円
C 信託約款に定める収益調整金	2,451,561,194円	C 信託約款に定める収益調整金	2,732,924,374円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	6,375,950,253円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	6,569,029,512円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	8,879,125,695円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)	9,767,086,172円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,408円	F 分配対象収益(1万口当たり)	2,668円
G 分配金額	36,860,987円	G 分配金額	36,602,246円
H 分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	10円
自 2023年2月16日 至 2023年3月15日		自 2023年8月16日 至 2023年9月15日	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	64,368,345円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	92,709,562円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	536,305,097円
C 信託約款に定める収益調整金	2,476,287,031円	C 信託約款に定める収益調整金	2,760,601,929円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	6,358,298,618円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	6,939,372,860円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	8,898,953,994円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)	10,328,989,448円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,416円	F 分配対象収益(1万口当たり)	2,831円
G 分配金額	36,826,933円	G 分配金額	36,484,543円

H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2023年3月16日			自 2023年9月16日	
	至 2023年4月17日			至 2023年10月16日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	133,304,946円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	83,541,200円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	2,508,631,918円	C	信託約款に定める収益調整金	2,791,854,096円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,360,907,032円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	7,431,358,513円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	9,002,843,896円	E	分配対象収益 (A+B+C+D)	10,306,753,809円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,442円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,844円
G	分配金額	36,855,503円	G	分配金額	36,234,130円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2023年4月18日			自 2023年10月17日	
	至 2023年5月15日			至 2023年11月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	52,907,524円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	51,574,092円
B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	2,574,817,052円	C	信託約款に定める収益調整金	2,799,397,868円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,417,258,177円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	7,407,596,684円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	9,044,982,753円	E	分配対象収益 (A+B+C+D)	10,258,568,644円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,447円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,849円
G	分配金額	36,960,227円	G	分配金額	36,007,391円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2023年5月16日			自 2023年11月16日	
	至 2023年6月15日			至 2023年12月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	67,809,078円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	53,234,632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	243,165,850円	B	費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C	信託約款に定める収益調整金	2,642,555,179円	C	信託約款に定める収益調整金	2,786,209,481円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,343,690,174円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	7,285,679,310円
E	分配対象収益 (A+B+C+D)	9,297,220,281円	E	分配対象収益 (A+B+C+D)	10,125,123,423円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,521円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,854円
G	分配金額	36,865,702円	G	分配金額	35,471,422円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	前期 自 2022年12月16日 至 2023年6月15日	当期 自 2023年6月16日 至 2023年12月15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	同左

	に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	前期 2023年6月15日現在	当期 2023年12月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

前期 (2023年6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,361,007,222
合計	1,361,007,222

当期 (2023年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	173,156,405
合計	173,156,405

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前期 2023年6月15日現在	当期 2023年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.0678円	1口当たり純資産額 1.0988円
(1万口当たり純資産額)	(10,678円)	(1万口当たり純資産額) (10,988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	1,204,160,715	6,431,181,546	
	日本債券インデックスマザーファンド	4,634,497,139	6,217,177,911	
	海外債券インデックス (ヘッジなし) マザーファンド	2,280,511,304	6,363,082,640	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	2,642,431,737	6,307,484,556	
	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	2,487,307,940	6,220,508,427	
	海外リートインデックス (ヘッジなし) マザーファンド	2,138,039,996	6,770,103,647	
合計		15,386,948,831	38,309,538,727	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(参考)

日本リートインデックス J-REIT マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2023年6月15日現在	2023年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	255,529,598	116,027,060
投資証券	59,748,471,000	60,414,707,300
未収配当金	322,087,439	324,881,832
流動資産合計	60,326,088,037	60,855,616,192
資産合計	60,326,088,037	60,855,616,192
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	4,233,592
未払利息	471	14
流動負債合計	471	4,233,606
負債合計	471	4,233,606
純資産の部		
元本等		
元本	23,882,441,576	24,331,712,371
剰余金		
剰余金又は欠損金(△)	36,443,645,990	36,519,670,215
元本等合計	60,326,087,566	60,851,382,586
純資産合計	60,326,087,566	60,851,382,586
負債純資産合計	60,326,088,037	60,855,616,192

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2023年6月15日現在	2023年12月15日現在
1.	期首	2022年12月16日	2023年6月16日
	期首元本額	23,057,537,880円	23,882,441,576円
	期首からの追加設定元本額	4,207,546,971円	2,898,862,648円
	期首からの一部解約元本額	3,382,643,275円	2,449,591,853円
	元本の内訳 ※		
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,493,894,999円	2,487,307,940円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	1,509,151,180円	1,568,056,361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）	152,677,611円	152,908,220円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	19,253,210,679円	19,527,581,580円
	財産3分法（適格機関投資家専用）	473,107,791円	592,477,458円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	399,316円	1,056,413円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	－円	668,219円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	－円	299,332円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）奇数月分配型	－円	1,356,848円	
計	23,882,441,576円	24,331,712,371円	
2.	受益権の総数	23,882,441,576口	24,331,712,371口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	自 2022年12月16日 至 2023年6月15日	自 2023年6月16日 至 2023年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。当該有価証	同左

	券の性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	2023年 6月 15日現在	2023年 12月 15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2023年 6月 15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	△343,718,700
合計	△343,718,700

(2023年 12月 15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	△1,774,272,705
合計	△1,774,272,705

(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 6月 15日現在		2023年 12月 15日現在	
1口当たり純資産額	2,5260円	1口当たり純資産額	2,5009円
(1万円当たり純資産額)	(25,260円)	(1万円当たり純資産額)	(25,009円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	1,191	135,893,100	
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,877	171,182,400	
	S O S i L A物流リート投資法人 投資証券	2,922	353,562,000	
	東海道リート投資法人 投資証券	872	107,866,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	2,022	1,225,332,000	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	6,887	966,246,100	
	産業ファンド投資法人 投資証券	8,937	1,226,156,400	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,747	1,833,293,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	3,073	1,200,006,500	
	G L P投資法人 投資証券	19,784	2,759,868,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,880	934,560,000	
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	10,203	2,717,058,900	
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	1,081	652,924,000	
	O n e リート投資法人 投資証券	1,022	265,924,400	
	イオンリート投資法人 投資証券	7,184	1,002,168,000	
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,480	825,288,000	
	日本リート投資法人 投資証券	1,902	650,484,000	
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	17,599	1,409,679,900	
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	1,233	163,619,100	
	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	1,444	201,582,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,595	173,855,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	18,940	3,147,828,000	
	いちごホテルリート投資法人 投資証券	970	105,924,000	
	ラサールロジポート投資法人 投資証券	7,486	1,140,866,400	
	スターアジア不動産投資法人 投資証券	9,027	519,052,500	
	マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	902	112,930,400	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,436	1,109,598,000	
	大江戸温泉リート投資法人 投資証券	896	66,752,000	
	投資法人みらい 投資証券	8,037	345,591,000	
	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	2,023	759,636,500	

CRE ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,521	396,049,100	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	950	111,530,000	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	2,777	274,367,600	
アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	2,566	328,704,600	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	6,832	4,229,008,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	6,016	3,501,312,000	
日本都市ファンド投資法人 投資証券	28,074	2,827,051,800	
オリックス不動産投資法人 投資証券	11,669	1,945,222,300	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	4,005	1,463,827,500	
NTT都市開発リート投資法人 投資証券	5,938	744,031,400	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	3,926	679,590,600	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	4,325	479,642,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	13,101	1,873,443,000	
森トラストリート投資法人 投資証券	11,289	824,097,000	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	28,357	1,636,198,900	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,173	949,601,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	4,375	590,187,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	3,752	1,054,312,000	
福岡リート投資法人 投資証券	3,029	504,328,500	
KDX 不動産投資法人 投資証券	16,855	2,663,090,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	4,799	404,075,800	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,213	816,349,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	2,793	387,947,700	
スターツプロシード投資法人 投資証券	1,015	202,188,000	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	8,829	2,312,315,100	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	19,606	1,323,405,000	
大和証券リビング投資法人 投資証券	8,625	950,475,000	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	5,090	657,628,000	
合計	370,152	60,414,707,300	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年6月15日現在	2023年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	80,982,762	477,393,957
コール・ローン	21,972,843	44,402,589
投資証券	57,212,329,686	58,225,890,535
未収入金	2,106,554	949,116
未収配当金	152,006,629	173,346,581
流動資産合計	57,469,398,474	58,921,982,778
資産合計	57,469,398,474	58,921,982,778
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	5,760
未払解約金	11,569,680	41,841,846
未払利息	40	5
流動負債合計	11,569,720	41,847,611
負債合計	11,569,720	41,847,611
純資産の部		
元本等		
元本	20,078,950,947	18,594,523,388
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	37,378,877,807	40,285,611,779
元本等合計	57,457,828,754	58,880,135,167
純資産合計	57,457,828,754	58,880,135,167
負債純資産合計	57,469,398,474	58,921,982,778

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2023 年 6 月 15 日現在	2023 年 12 月 15 日現在
1.	期首	2022 年 12 月 16 日	2023 年 6 月 16 日
	期首元本額	19,559,991,666 円	20,078,950,947 円
	期首からの追加設定元本額	3,069,776,747 円	1,479,766,747 円
	期首からの一部解約元本額	2,550,817,466 円	2,964,194,306 円
	元本の内訳 ※		
	世界の財産 3 分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,280,965,859 円	2,138,039,996 円
	インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）	7,247,382 円	8,410,515 円
	グローバル 3 倍 3 分法ファンド（適格機関投資家向け）	17,560,828,477 円	16,214,506,178 円
	Tracers グローバル 3 分法（おとなのバランス）	4,297,153 円	11,490,212 円
	Ni つみインデックススラップ世界 10 指数（均等型）	－円	552,803 円
	Ni つみインデックススラップ世界 10 指数（安定成長型）	－円	495,666 円
海外先進国 REIT インデックスファンド（適格機関投資家向け）	225,612,076 円	221,028,018 円	
計	20,078,950,947 円	18,594,523,388 円	
2.	受益権の総数	20,078,950,947 口	18,594,523,388 口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	自 2022 年 12 月 16 日 至 2023 年 6 月 15 日	自 2023 年 6 月 16 日 至 2023 年 12 月 15 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	同左

	記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、為替予約取引があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	2023年6月15日現在	2023年12月15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 「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 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6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	△1,487,263,996
合計	△1,487,263,996

(2023年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	3,842,320,941
合計	3,842,320,941

(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6月15日現在)

該当事項はありません。

(2023年12月15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	28,480,000	—	28,485,760	△5,760
	米ドル	28,480,000	—	28,485,760	△5,760
合計		28,480,000	—	28,485,760	△5,760

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年6月15日現在		2023年12月15日現在	
1口当たり純資産額	2,8616円	1口当たり純資産額	3,1665円
(1万口当たり純資産額)	(28,616円)	(1万口当たり純資産額)	(31,665円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	28,618	493,660.50	
		AGREE REALTY CORPORATION	28,566	1,773,091.62	

ALEXANDER & BALDWIN INC	20,947	387,100.56	
ALEXANDER'S INC	617	123,764.03	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	46,007	6,185,641.15	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	4,286	73,719.20	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	14,639	343,577.33	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	94,094	3,432,549.12	
AMERICOLD REALTY TRUST INC	75,217	2,291,109.82	
APARTMENT INCOME REIT CO	44,052	1,535,212.20	
APARTMENT INVT&MGMT CO -A	40,822	309,430.76	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	62,701	1,091,624.41	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	19,895	259,629.75	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	8,742	18,533.04	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	42,053	8,050,626.32	
BOSTON PROPERTIES INC	42,694	3,115,808.12	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	17,457	43,467.93	
BRANDYWINE REALTY TRUST	48,905	270,444.65	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	88,720	2,141,700.80	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	55,609	967,040.51	
BRT APARTMENTS CORP	3,398	66,872.64	
CAMDEN PROPERTY TRUST	31,622	3,213,111.42	
CARETRUST REIT INC	29,325	660,985.50	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,546	181,481.30	
CENTERSPACE	4,468	261,467.36	
CHATHAM LODGING TRUST	14,483	159,023.34	
CITY OFFICE REIT INC	11,825	78,518.00	
CLIPPER REALTY INC	3,393	18,593.64	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	7,488	211,011.84	
COPT DEFENSE PROPERTIES	33,629	862,583.85	
COUSINS PROPERTIES INC	44,943	1,114,586.40	
CTO REALTY GROWTH INC	6,385	110,013.55	
CUBESMART	66,461	3,021,981.67	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	60,552	561,317.04	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	219,824	140,687.36	
DIGITAL REALTY TRUST INC	89,551	11,904,014.43	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	65,324	199,891.44	
DOUGLAS EMMETT INC	49,120	774,131.20	

EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	68,595.90	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	27,032	381,962.16	
EASTGROUP PROPERTIES INC	13,433	2,499,343.98	
ELME COMMUNITIES	26,672	392,345.12	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	38,903	378,526.19	
EPR PROPERTIES	22,420	1,080,868.20	
EQUINIX INC	27,672	22,283,984.88	
EQUITY COMMONWEALTH	33,027	647,989.74	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	55,224	4,015,889.28	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	102,165	6,365,901.15	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	46,200	1,204,896.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	19,028	4,728,458.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	62,481	9,666,435.51	
FARMLAND PARTNERS INC	13,317	170,324.43	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	21,703	2,323,306.15	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	39,077	2,108,985.69	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	26,732	677,121.56	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	26,426	67,650.56	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	77,793	3,722,395.05	
GETTY REALTY CORPORATION	13,470	393,189.30	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	12,260	170,536.60	
GLADSTONE LAND CORP	9,886	144,928.76	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	18,459	207,848.34	
GLOBAL NET LEASE INC	56,618	546,929.88	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	112,751	1,966,377.44	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	161,984	3,259,118.08	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	31,113	752,934.60	
HOST HOTELS & RESORTS INC	210,356	4,093,527.76	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	36,680	327,919.20	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	66,474	1,063,584.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	18,055	86,664.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	8,246	814,704.80	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	19,535	523,538.00	
INVITATION HOMES INC	170,157	6,004,840.53	
IRON MOUNTAIN INC	86,300	5,907,235.00	
JBG SMITH PROPERTIES	27,353	489,618.70	

KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	219,100	70,112.00	
KILROY REALTY CORPORATION	31,749	1,365,207.00	
KIMCO REALTY CORP	183,132	4,136,951.88	
KITE REALTY GROUP TRUST	64,481	1,510,789.83	
LTC PROPERTIES INC	12,540	425,356.80	
LXP INDUSTRIAL TRUST	86,867	849,559.26	
MACERICH CO/THE	63,596	1,042,974.40	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	584,347	45,579.06	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	177,380	970,268.60	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	34,534	4,781,232.30	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	24,598	989,577.54	
NATL HEALTH INVESTORS INC	12,840	735,090.00	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	4,209	82,664.76	
NETSTREIT CORP	19,225	336,437.50	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	10,027	85,129.23	
NEXPOINT RESIDENTIAL	6,746	242,316.32	
NNN REIT INC	54,075	2,290,076.25	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	15,503	105,265.37	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	72,629	2,266,751.09	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,565	104,995.00	
ORION OFFICE REIT INC	17,145	104,927.40	
PARAMOUNT GROUP INC	49,457	283,883.18	
PARK HOTELS & RESORTS INC	63,883	1,070,040.25	
PEAKSTONE REALTY TRUST	10,885	211,386.70	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	35,023	515,888.79	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	34,668	1,291,383.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	71,190	958,929.30	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	36,153	271,147.50	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	9,920	252,166.40	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	5,728	84,373.44	
PRIME US REIT	184,200	36,840.00	
PROLOGIS INC	273,165	37,456,384.80	
PUBLIC STORAGE	46,806	13,625,226.60	
REALTY INCOME CORP	209,840	12,132,948.80	
REGENCY CENTERS CORP	48,625	3,299,206.25	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	36,462	521,041.98	

		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	60,938	3,497,231.82	
		RLJ LODGING TRUST	46,036	539,081.56	
		RPT REALTY	23,731	324,165.46	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	17,607	1,943,108.52	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	68,932	989,863.52	
		SAFEHOLD INC	13,393	315,806.94	
		SAUL CENTERS INC	3,710	150,922.80	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	49,195	418,649.45	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	96,758	14,182,787.64	
		SITE CENTERS CORP	52,734	762,006.30	
		SL GREEN REALTY CORP	18,982	911,136.00	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	41,707	1,848,454.24	
		STAG INDUSTRIAL INC	53,121	2,073,843.84	
		STAR HOLDINGS	3,277	47,975.28	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	29,619	199,335.87	
		SUN COMMUNITIES INC	36,829	5,016,846.38	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	61,695	665,689.05	
		TANGER INC	31,189	863,935.30	
		TERRENO REALTY CORP	24,695	1,524,916.25	
		UDR INC	89,848	3,445,670.80	
		UMH PROPERTIES INC	17,827	274,000.99	
		UNITI GROUP INC	71,677	410,709.21	
		UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	3,614	163,786.48	
		URBAN EDGE PROPERTIES	34,436	643,264.48	
		VENTAS INC	119,108	6,018,527.24	
		VERIS RESIDENTIAL INC	24,106	374,366.18	
		VICI PROPERTIES INC	299,667	9,568,367.31	
		VORNADO REALTY TRUST	47,045	1,474,390.30	
		WELLTOWER INC	163,762	15,044,814.94	
		WHITESTONE REIT	13,006	160,754.16	
		WP CAREY INC	63,358	4,142,979.62	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	31,602	421,570.68	
			8,302,177	318,957,545.53	
		米ドル小計		(45,451,450,238)	
加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	19,262	394,871.00	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,987	105,993.81	

		BOARDWALK EQUITIES INC	6,694	475,675.64	
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	5,317	84,168.11	
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	10,240	30,310.40	
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	24,517	1,309,943.31	
		CHOICE PROPERTIES REIT	48,035	664,324.05	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,026	224,043.48	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	15,585	229,255.35	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	39,145	539,418.10	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,293	54,570.83	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	31,571	478,616.36	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	9,091	721,643.58	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	39,243	397,924.02	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	21,570	293,136.30	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	16,371	309,411.90	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,648	92,062.40	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	5,901	86,744.70	
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	9,851	81,073.73	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	32,841	159,278.85	
		PRIMARIS REIT	15,120	203,666.40	
		PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	8,609	41,323.20	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	43,633	823,791.04	
		SLATE GROCERY REIT	9,035	103,450.75	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	20,844	520,266.24	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	2,223	19,006.65	
			477,652	8,443,970.20	
				(897,087,394)	
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	14,143	903,030.55	
		ALTAREA	1,428	106,957.20	
		CARE PROPERTY INVEST	11,694	167,224.20	
		CARMILA	16,603	252,033.54	
		COFINIMMO	10,093	718,621.60	
		COVIVIO	14,120	690,468.00	
		CROMWELL REIT EUR	97,560	131,706.00	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	12,876	280,954.32	
		GECINA SA	15,169	1,683,759.00	
		HAMBORNER REIT AG	21,815	149,214.60	

	ICADE	9,067	318,070.36	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	17,269	39,373.32	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	85,150	566,673.25	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	8,508	176,115.60	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	144,730	148,492.98	
	KLEPIERRE	57,328	1,422,880.96	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	15,711	95,051.55	
	MERCIALYS	28,370	262,706.20	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	99,623	1,000,214.92	
	MONTEA	4,596	382,387.20	
	NSI NV	5,548	102,527.04	
	RETAIL ESTATES	3,761	241,456.20	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	9,300	404,550.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	29,912	1,983,763.84	
	VASTNED RETAIL	4,809	98,584.50	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	47,484	1,336,199.76	
	WERELDHAVE NV	11,149	158,984.74	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	8,631	264,108.60	
		806,447	14,086,110.03	
	ユーロ小計		(2,204,194,497)	
英債券	投資証券	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	133,422	66,711.00
		AEW UK REIT PLC	48,766	47,741.91
		ASSURA PLC	901,567	407,508.28
		BALANCED COMM PROPERTY TRUST	212,634	151,395.40
		BIG YELLOW GROUP PLC	51,383	629,955.58
		BRITISH LAND COMPANY PLC	275,827	1,139,441.33
		CLS HOLDINGS PLC	40,564	40,523.43
		CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	141,978	119,261.52
		DERWENT LONDON PLC	33,173	794,161.62
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	178,296	170,985.86
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	75,679	328,900.93
		HAMMERSON PLC	1,110,356	314,452.81
		HELICAL PLC	33,388	70,114.80
		HOME REIT PLC	256,438	97,574.65
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	122,092	110,126.98
		INTU PROPERTIES PLC	758,746	—

		LAND SECURITIES GROUP PLC	221,345	1,567,565.29	
		LIFE SCIENCE REIT PLC	110,213	70,095.46	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	288,049	578,402.39	
		LXI REIT PLC	502,683	504,693.73	
		NEWRIVER REIT PLC	103,025	87,571.25	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	169,809	114,790.88	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	407,011	411,081.11	
		PRS REIT PLC/THE	145,505	119,750.61	
		REGIONAL REIT LTD	147,696	49,330.46	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	63,198	546,978.69	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	159,661	73,444.06	
		SEGRO PLC	361,740	3,212,251.20	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	580,313	774,717.85	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	376,076	315,903.84	
		TARGET HEALTHCARE REIT PLC	186,494	155,349.50	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	103,176	63,865.94	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	565,694	953,194.39	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	267,309	159,583.47	
		UNITE GROUP PLC/THE	116,374	1,218,435.78	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	140,511	171,985.46	
		WAREHOUSE REIT PLC	121,094	105,351.78	
		WORKSPACE GROUP PLC	39,948	225,506.46	
		英債券小計	9,551,233	15,968,705.70 (2,901,513,825)	
豪ドル	投資証券	ABACUS GROUP	142,410	160,923.30	
		ABACUS STORAGE KING	164,070	191,961.90	
		ARENA REIT	106,512	390,899.04	
		BWP TRUST	149,523	551,739.87	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	240,921	414,384.12	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	166,023	546,215.67	
		CENTURIA OFFICE REIT	121,951	165,243.60	
		CHARTER HALL GROUP	138,874	1,713,705.16	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	198,786	739,483.92	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	159,840	581,817.60	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	103,968	307,745.28	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	422,166	196,307.19	

		DEXUS INDUSTRIA REIT	65,834	186,968.56	
		DEXUS/AU	319,976	2,540,609.44	
		GDI PROPERTY GROUP	181,454	112,501.48	
		GOODMAN GROUP	507,192	12,451,563.60	
		GPT GROUP	568,733	2,644,608.45	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	88,622	229,530.98	
		HEALTHCO REIT	149,818	225,476.09	
		HMC CAPITAL LTD	73,395	408,076.20	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	524,956	658,819.78	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	60,162	173,868.18	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	108,326	462,552.02	
		MIRVAC GROUP	1,169,888	2,503,560.32	
		NATIONAL STORAGE REIT	371,211	887,194.29	
		REGION RE LTD	353,044	822,592.52	
		RURAL FUNDS GROUP	122,187	251,705.22	
		SCENTRE GROUP	1,544,485	4,525,341.05	
		STOCKLAND	708,577	3,146,081.88	
		VICINITY CENTRES	1,145,325	2,347,916.25	
		WAYPOINT REIT	208,543	531,784.65	
豪ドル小計			10,386,772	41,071,177.61	(3,920,243,902)
ニュージーランドドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	391,267	841,224.05	
ニュージーランドドル小計			391,267	841,224.05	(74,322,144)
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	573,000	1,380,930.00	
		FORTUNE REIT	434,900	2,131,010.00	
		LINK REIT	758,680	30,574,804.00	
		PROSPERITY REIT	411,000	563,070.00	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	306,000	645,660.00	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	670,610	777,907.60	
香港ドル小計			3,154,190	36,073,381.60	(658,339,214)
シンガポールドル	投資証券	AIMS APAC REIT	215,817	282,720.27	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,055,532	3,156,040.68	
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	697,892	694,402.54	

		CAPITALAND CHINA TRUST	353,785	311,330.80	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,499,092	2,998,184.00	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	205,300	225,830.00	
		EC WORLD REIT	70,300	19,684.00	
		ESR-LOGOS REIT	1,755,919	553,114.48	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	319,100	213,797.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	324,205	716,493.05	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERC	856,060	975,908.40	
		KEPPEL DC REIT	401,977	836,112.16	
		KEPPEL REIT	677,200	623,024.00	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	534,452	342,049.28	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	620,008	1,512,819.52	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	976,887	1,650,939.03	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	682,731	1,017,269.19	
		PARAGON REIT	392,500	339,512.50	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	113,300	403,348.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	154,400	106,536.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	443,600	230,672.00	
		SUNTEC REIT	683,200	826,672.00	
シンガポールドル小計			13,033,257	18,036,458.90	(1,934,590,581)
韓国ウォン	投資証券	D&D PLATFORM REIT CO LTD	16,715	54,574,475.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	49,349	181,357,575.00	
		JR REIT XXVII	51,594	222,628,110.00	
		KORAMCO LIFE INFRA REIT	16,399	87,570,660.00	
		LOTTE REIT CO LTD	39,257	126,014,970.00	
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,699	44,636,985.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	20,630	137,189,500.00	
		SK REITS CO LTD	37,743	150,217,140.00	
韓国ウォン小計			244,386	1,004,189,415.00	(110,862,511)
イスラエルシェケル	投資証券	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	225,077	371,377.05	
		REIT 1 LTD	57,765	973,917.90	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	63,926	545,352.70	
イスラエルシェケル小計			346,768	1,890,647.65	(73,286,229)

合計		58,225,890,535	
		(58,225,890,535)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 142 銘柄	100.0%	78.2%
加ドル	投資証券 26 銘柄	100.0%	1.5%
ユーロ	投資証券 28 銘柄	100.0%	3.8%
英ポンド	投資証券 38 銘柄	100.0%	5.0%
豪ドル	投資証券 31 銘柄	100.0%	6.7%
ニュージーランドドル	投資証券 1 銘柄	100.0%	0.1%
香港ドル	投資証券 6 銘柄	100.0%	1.1%
シンガポールドル	投資証券 22 銘柄	100.0%	3.3%
韓国ウォン	投資証券 8 銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 3 銘柄	100.0%	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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6月15日現在	2023年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	296,558,632	229,396,195
国債証券	44,440,267,790	45,460,262,000
地方債証券	2,843,860,300	2,728,652,612
特殊債券	2,923,300,000	2,407,153,000
社債券	701,132,000	1,196,809,000
未収利息	132,015,132	141,083,762
前払費用	7,368,092	3,800,469
流動資産合計	51,344,501,946	52,167,157,038
資産合計	51,344,501,946	52,167,157,038
負債の部		
流動負債		
未払金	402,831,300	-
未払解約金	4,699,238	13,855,986
未払利息	547	29
流動負債合計	407,531,085	13,856,015
負債合計	407,531,085	13,856,015
純資産の部		
元本等		
元本	37,056,558,627	38,876,887,677
剰余金		
剰余金又は欠損金(△)	13,880,412,234	13,276,413,346
元本等合計	50,936,970,861	52,153,301,023
純資産合計	50,936,970,861	52,153,301,023
負債純資産合計	51,344,501,946	52,167,157,038

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2023年6月15日現在	2023年12月15日現在
1.	期首	2022年12月16日	2023年6月16日
	期首元本額	35,610,435,312円	37,056,558,627円
	期首からの追加設定元本額	2,431,462,731円	2,454,562,009円
	期首からの一部解約元本額	985,339,416円	634,232,959円
	元本の内訳 ※		
	DCインデックスバランス（株式20）	5,276,352,595円	5,774,757,942円
	DCインデックスバランス（株式40）	5,091,284,567円	5,582,044,245円
	DCインデックスバランス（株式60）	3,960,723,790円	4,434,324,560円
	DCインデックスバランス（株式80）	660,838,148円	805,916,042円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	2,253,893,287円	2,196,381,287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	4,563,048,523円	4,634,497,139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）	1,669,721,425円	1,729,528,043円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	6,290,886円	16,547,519円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	－円	1,255,173円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	－円	1,124,883円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	3,121,256,326円	3,086,148,563円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,532,126,635円	1,584,535,452円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,520,578,323円	1,607,037,096円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	888,849,982円	944,938,176円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	128,873,086円	144,661,389円
	インデックスファンド日本債券（1年決算型）	5,984,700,943円	5,925,655,949円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	398,020,111円	407,534,219円	
計	37,056,558,627円	38,876,887,677円	
2.	受益権の総数	37,056,558,627口	38,876,887,677口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	自 2022 年 12 月 16 日 至 2023 年 6 月 15 日	自 2023 年 6 月 16 日 至 2023 年 12 月 15 日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	2023 年 6 月 15 日現在	2023 年 12 月 15 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 6 月 15 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	503,576,350
地方債証券	△3,033,700
特殊債券	△440,000
社債券	△786,000
合計	499,316,650

(2023 年 12 月 15 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	750,960,620
地方債証券	△57,788
特殊債券	4,283,000
社債券	691,000
合計	755,876,832

(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6月15日現在		2023年12月15日現在	
1口当たり純資産額	1.3746円	1口当たり純資産額	1.3415円
(1万円当たり純資産額)	(13,746円)	(1万円当たり純資産額)	(13,415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449回利付国債(2年)	80,000,000	79,964,800	
	第450回利付国債(2年)	200,000,000	199,892,000	
	第451回利付国債(2年)	50,000,000	49,971,500	
	第149回利付国債(5年)	100,000,000	99,725,000	
	第150回利付国債(5年)	50,000,000	49,827,500	
	第152回利付国債(5年)	100,000,000	99,870,000	
	第153回利付国債(5年)	300,000,000	298,326,000	
	第157回利付国債(5年)	120,000,000	119,772,000	
	第158回利付国債(5年)	180,000,000	178,900,200	
	第159回利付国債(5年)	120,000,000	119,091,600	
	第160回利付国債(5年)	120,000,000	119,625,600	
	第162回利付国債(5年)	100,000,000	99,976,000	
	第163回利付国債(5年)	100,000,000	100,421,000	
	第1回利付国債(40年)	70,000,000	81,784,500	
	第2回利付国債(40年)	125,000,000	140,767,500	

第3回利付国債（40年）	85,000,000	95,576,550	
第4回利付国債（40年）	95,000,000	106,830,350	
第5回利付国債（40年）	95,000,000	102,592,400	
第6回利付国債（40年）	110,000,000	116,459,200	
第7回利付国債（40年）	130,000,000	131,443,000	
第8回利付国債（40年）	115,000,000	107,848,150	
第9回利付国債（40年）	180,000,000	123,535,800	
第10回利付国債（40年）	175,000,000	140,917,000	
第11回利付国債（40年）	140,000,000	108,270,400	
第12回利付国債（40年）	175,000,000	120,352,750	
第13回利付国債（40年）	180,000,000	122,486,400	
第14回利付国債（40年）	190,000,000	138,008,400	
第15回利付国債（40年）	210,000,000	167,760,600	
第16回利付国債（40年）	100,000,000	87,493,000	
第338回利付国債（10年）	390,000,000	391,950,000	
第339回利付国債（10年）	570,000,000	573,123,600	
第340回利付国債（10年）	620,000,000	623,751,000	
第341回利付国債（10年）	700,000,000	703,290,000	
第342回利付国債（10年）	630,000,000	630,352,800	
第343回利付国債（10年）	645,000,000	645,154,800	
第344回利付国債（10年）	700,000,000	699,902,000	
第345回利付国債（10年）	660,000,000	659,604,000	
第346回利付国債（10年）	660,000,000	659,142,000	
第347回利付国債（10年）	680,000,000	678,456,400	
第348回利付国債（10年）	500,000,000	498,320,000	
第349回利付国債（10年）	590,000,000	587,303,700	
第350回利付国債（10年）	540,000,000	536,700,600	
第351回利付国債（10年）	535,000,000	530,950,050	
第352回利付国債（10年）	520,000,000	514,997,600	
第353回利付国債（10年）	400,000,000	395,664,000	
第354回利付国債（10年）	325,000,000	321,057,750	
第355回利付国債（10年）	350,000,000	345,366,000	
第356回利付国債（10年）	350,000,000	344,963,500	
第357回利付国債（10年）	560,000,000	551,112,800	
第358回利付国債（10年）	590,000,000	579,557,000	
第359回利付国債（10年）	420,000,000	411,751,200	

第360回利付国債（10年）	580,000,000	567,245,800	
第361回利付国債（10年）	460,000,000	448,605,800	
第362回利付国債（10年）	400,000,000	388,936,000	
第363回利付国債（10年）	500,000,000	484,655,000	
第364回利付国債（10年）	500,000,000	483,260,000	
第365回利付国債（10年）	350,000,000	337,274,000	
第366回利付国債（10年）	400,000,000	387,568,000	
第367回利付国債（10年）	360,000,000	347,785,200	
第368回利付国債（10年）	390,000,000	375,612,900	
第369回利付国債（10年）	390,000,000	384,855,900	
第370回利付国債（10年）	420,000,000	413,599,200	
第371回利付国債（10年）	480,000,000	467,582,400	
第372回利付国債（10年）	300,000,000	302,601,000	
第1回利付国債（30年）	50,000,000	56,960,000	
第3回利付国債（30年）	70,000,000	78,421,700	
第5回利付国債（30年）	80,000,000	89,857,600	
第6回利付国債（30年）	50,000,000	57,131,000	
第8回利付国債（30年）	170,000,000	186,971,100	
第9回利付国債（30年）	70,000,000	74,561,200	
第11回利付国債（30年）	170,000,000	185,893,300	
第13回利付国債（30年）	180,000,000	201,974,400	
第14回利付国債（30年）	108,000,000	125,501,400	
第15回利付国債（30年）	147,000,000	172,551,540	
第16回利付国債（30年）	35,000,000	41,157,550	
第17回利付国債（30年）	50,000,000	58,327,500	
第18回利付国債（30年）	110,000,000	127,295,300	
第19回利付国債（30年）	40,000,000	46,320,400	
第20回利付国債（30年）	40,000,000	47,256,000	
第21回利付国債（30年）	70,000,000	81,189,500	
第22回利付国債（30年）	70,000,000	82,861,800	
第23回利付国債（30年）	55,000,000	65,146,400	
第24回利付国債（30年）	68,000,000	80,587,480	
第25回利付国債（30年）	60,000,000	69,658,200	
第26回利付国債（30年）	170,000,000	199,483,100	
第27回利付国債（30年）	89,000,000	105,718,650	
第28回利付国債（30年）	144,000,000	171,050,400	

第29回利付国債（30年）	176,000,000	206,752,480	
第30回利付国債（30年）	147,000,000	170,483,250	
第31回利付国債（30年）	120,000,000	137,264,400	
第32回利付国債（30年）	160,000,000	185,067,200	
第33回利付国債（30年）	175,000,000	194,124,000	
第34回利付国債（30年）	160,000,000	182,088,000	
第35回利付国債（30年）	193,000,000	213,568,010	
第36回利付国債（30年）	195,000,000	215,293,650	
第37回利付国債（30年）	211,000,000	229,226,180	
第38回利付国債（30年）	165,000,000	176,076,450	
第39回利付国債（30年）	165,000,000	178,459,050	
第40回利付国債（30年）	130,000,000	138,260,200	
第41回利付国債（30年）	160,000,000	167,240,000	
第42回利付国債（30年）	135,000,000	140,945,400	
第43回利付国債（30年）	155,000,000	161,634,000	
第44回利付国債（30年）	150,000,000	156,357,000	
第45回利付国債（30年）	120,000,000	120,674,400	
第46回利付国債（30年）	160,000,000	160,646,400	
第47回利付国債（30年）	125,000,000	127,655,000	
第48回利付国債（30年）	85,000,000	83,537,150	
第49回利付国債（30年）	140,000,000	137,342,800	
第50回利付国債（30年）	145,000,000	125,654,100	
第51回利付国債（30年）	140,000,000	107,658,600	
第52回利付国債（30年）	130,000,000	104,487,500	
第53回利付国債（30年）	105,000,000	86,111,550	
第54回利付国債（30年）	110,000,000	94,207,300	
第55回利付国債（30年）	110,000,000	93,925,700	
第56回利付国債（30年）	140,000,000	119,182,000	
第57回利付国債（30年）	190,000,000	161,258,700	
第58回利付国債（30年）	140,000,000	118,463,800	
第59回利付国債（30年）	170,000,000	139,986,500	
第60回利付国債（30年）	120,000,000	103,363,200	
第61回利付国債（30年）	100,000,000	81,807,000	
第62回利付国債（30年）	120,000,000	92,835,600	
第63回利付国債（30年）	120,000,000	90,004,800	
第64回利付国債（30年）	100,000,000	74,705,000	

第65回利付国債(30年)	110,000,000	81,922,500	
第66回利付国債(30年)	180,000,000	133,408,800	
第67回利付国債(30年)	110,000,000	85,928,700	
第68回利付国債(30年)	140,000,000	108,971,800	
第69回利付国債(30年)	110,000,000	87,772,300	
第70回利付国債(30年)	110,000,000	87,556,700	
第71回利付国債(30年)	120,000,000	95,191,200	
第72回利付国債(30年)	160,000,000	126,603,200	
第73回利付国債(30年)	150,000,000	118,395,000	
第74回利付国債(30年)	130,000,000	111,146,100	
第75回利付国債(30年)	180,000,000	166,015,800	
第76回利付国債(30年)	150,000,000	141,718,500	
第77回利付国債(30年)	160,000,000	158,430,400	
第78回利付国債(30年)	150,000,000	141,484,500	
第79回利付国債(30年)	140,000,000	125,505,800	
第80回利付国債(30年)	80,000,000	82,808,000	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	115,295,030	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	120,515,760	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	10,262,900	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	21,499,380	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	41,001,600	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	164,726,400	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	62,152,200	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	136,210,100	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	316,563,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	16,921,120	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	265,080,000	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	63,557,400	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	63,622,800	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	53,181,000	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	88,113,920	
第96回利付国債(20年)	248,000,000	264,764,800	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	48,382,200	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	100,714,420	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	125,783,190	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	32,481,600	

第101回利付国債（20年）	66,000,000	72,015,240	
第102回利付国債（20年）	81,000,000	88,716,870	
第103回利付国債（20年）	11,000,000	11,999,020	
第104回利付国債（20年）	33,000,000	35,703,030	
第105回利付国債（20年）	77,000,000	83,518,820	
第106回利付国債（20年）	2,000,000	2,178,700	
第107回利付国債（20年）	130,000,000	141,468,600	
第108回利付国債（20年）	134,000,000	144,501,580	
第109回利付国債（20年）	27,000,000	29,203,470	
第110回利付国債（20年）	98,000,000	107,010,120	
第111回利付国債（20年）	25,000,000	27,527,250	
第112回利付国債（20年）	80,000,000	87,654,400	
第113回利付国債（20年）	290,000,000	318,814,400	
第114回利付国債（20年）	52,000,000	57,352,360	
第115回利付国債（20年）	125,000,000	138,601,250	
第116回利付国債（20年）	135,000,000	150,095,700	
第117回利付国債（20年）	343,000,000	379,258,530	
第118回利付国債（20年）	70,000,000	77,148,400	
第119回利付国債（20年）	60,000,000	65,365,800	
第120回利付国債（20年）	170,000,000	182,989,700	
第121回利付国債（20年）	22,000,000	24,146,980	
第122回利付国債（20年）	17,000,000	18,547,340	
第123回利付国債（20年）	195,000,000	216,997,950	
第124回利付国債（20年）	90,000,000	99,540,900	
第125回利付国債（20年）	50,000,000	56,085,500	
第126回利付国債（20年）	105,000,000	116,265,450	
第127回利付国債（20年）	50,000,000	55,014,000	
第128回利付国債（20年）	65,000,000	71,607,250	
第129回利付国債（20年）	85,000,000	93,025,700	
第130回利付国債（20年）	150,000,000	164,314,500	
第131回利付国債（20年）	92,000,000	100,093,240	
第132回利付国債（20年）	135,000,000	146,959,650	
第133回利付国債（20年）	110,000,000	120,588,600	
第134回利付国債（20年）	120,000,000	131,736,000	
第135回利付国債（20年）	30,000,000	32,684,400	
第136回利付国債（20年）	220,000,000	237,952,000	

第137回利付国債（20年）	200,000,000	218,064,000	
第138回利付国債（20年）	120,000,000	128,842,800	
第139回利付国債（20年）	230,000,000	248,809,400	
第140回利付国債（20年）	318,000,000	346,810,800	
第141回利付国債（20年）	235,000,000	256,537,750	
第142回利付国債（20年）	165,000,000	181,605,600	
第143回利付国債（20年）	94,000,000	101,837,720	
第144回利付国債（20年）	330,000,000	354,479,400	
第145回利付国債（20年）	315,000,000	344,449,350	
第146回利付国債（20年）	195,000,000	213,197,400	
第147回利付国債（20年）	208,000,000	225,397,120	
第148回利付国債（20年）	180,000,000	193,219,200	
第149回利付国債（20年）	185,000,000	198,508,700	
第150回利付国債（20年）	210,000,000	223,141,800	
第151回利付国債（20年）	240,000,000	249,708,000	
第152回利付国債（20年）	250,000,000	259,785,000	
第153回利付国債（20年）	270,000,000	283,176,000	
第154回利付国債（20年）	160,000,000	165,808,000	
第155回利付国債（20年）	270,000,000	273,221,100	
第156回利付国債（20年）	160,000,000	150,507,200	
第157回利付国債（20年）	150,000,000	137,043,000	
第158回利付国債（20年）	170,000,000	160,746,900	
第159回利付国債（20年）	150,000,000	143,094,000	
第160回利付国債（20年）	140,000,000	134,848,000	
第161回利付国債（20年）	120,000,000	113,746,800	
第162回利付国債（20年）	150,000,000	141,715,500	
第163回利付国債（20年）	165,000,000	155,269,950	
第164回利付国債（20年）	255,000,000	235,711,800	
第165回利付国債（20年）	170,000,000	156,554,700	
第166回利付国債（20年）	150,000,000	141,663,000	
第167回利付国債（20年）	160,000,000	146,129,600	
第168回利付国債（20年）	140,000,000	125,316,800	
第169回利付国債（20年）	160,000,000	140,259,200	
第170回利付国債（20年）	140,000,000	122,089,800	
第171回利付国債（20年）	170,000,000	147,476,700	
第172回利付国債（20年）	230,000,000	201,818,100	

	第173回利付国債（20年）	190,000,000	165,860,500	
	第174回利付国債（20年）	200,000,000	173,798,000	
	第175回利付国債（20年）	180,000,000	158,400,000	
	第176回利付国債（20年）	190,000,000	166,468,500	
	第177回利付国債（20年）	200,000,000	171,400,000	
	第178回利付国債（20年）	220,000,000	191,296,600	
	第179回利付国債（20年）	190,000,000	164,462,100	
	第180回利付国債（20年）	190,000,000	173,048,200	
	第181回利付国債（20年）	190,000,000	175,649,300	
	第182回利付国債（20年）	200,000,000	190,944,000	
	第183回利付国債（20年）	190,000,000	190,427,500	
	第184回利付国債（20年）	170,000,000	161,408,200	
	第185回利付国債（20年）	130,000,000	122,987,800	
	第186回利付国債（20年）	120,000,000	121,387,200	
	国債証券 合計	45,767,000,000	45,460,262,000	
地方債証券	第4回東京都公募公債（東京グリーンボンド（5年））	100,000,000	99,736,000	
	第6回東京都公募公債（20年）	100,000,000	102,374,000	
	第32回東京都公募公債（5年）	200,000,000	199,592,000	
	第739回東京都公募公債	100,000,000	100,197,000	
	第744回東京都公募公債	100,000,000	100,644,000	
	令和2年度第2回北海道公募公債（5年）	100,000,000	99,806,000	
	令和3年度第6回北海道公募公債（5年）	100,000,000	99,439,000	
	第214回神奈川県公募公債	100,000,000	100,615,000	
	平成27年度第10回静岡県公募公債	200,000,000	201,022,000	
	平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	102,882,000	
	平成26年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	100,384,000	
	第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,429,752	
	第142回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,542,000	
	第144回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,452,000	
	第147回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,597,000	
	第165回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,458,000	
	平成28年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	99,680,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	100,585,000	
	平成29年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	99,471,000	
	平成27年度第2回熊本県公募公債（10年）	100,000,000	100,571,000	

	第2回名古屋市定時償還公募公債（10年）	20,000,000	20,026,360	
	平成27年度第5回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,527,000	
	令和元年度第1回鹿児島県公募公債（5年）	100,000,000	99,912,500	
	令和2年度第1回鹿児島県公募公債（5年）	100,000,000	99,710,000	
地方債証券 合計		2,720,000,000	2,728,652,612	
特殊債券	第5回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	99,738,000	
	第13回新関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,345,000	
	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	199,042,000	
	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,350,000	
	第28回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,611,000	
	第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,698,000	
	第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,345,000	
	第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,451,000	
	第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,657,000	
	第324回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,608,000	
	第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,038,000	
	第69回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,398,000	
	第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,118,000	
	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,604,000	
	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,984,000	
	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	98,938,000	
	第363回信金中金債（5年）	100,000,000	99,802,000	
	第395回信金中金債（5年）	100,000,000	99,294,000	
	第29回国際協力機構債券	100,000,000	100,585,000	
第37回国際協力機構債券	100,000,000	99,547,000		
特殊債券 合計		2,400,000,000	2,407,153,000	
社債券	第25回西日本高速道路株式会社社債（一般担保付、独立行政法人日本高速道路保有・債務返済機構重畳的債務引受条項付）	100,000,000	100,373,000	
	第22回味の素株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,977,000	
	第25回味の素株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,760,000	
	第10回株式会社資生堂無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,779,000	

第14回株式会社小松製作所無担保社債（社債間限定同順位特約付）（グリーンボンド）	100,000,000	99,721,000	
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	99,595,000	
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	99,836,000	
第510回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,666,000	
第552回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,020,000	
第400回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,130,000	
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	99,113,000	
第31回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,839,000	
社債券 合計	1,200,000,000	1,196,809,000	
合計	52,087,000,000	51,792,876,612	

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6月15日現在	2023年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	99,870,012	202,917,443
コール・ローン	115,992,044	83,791,558
国債証券	153,679,818,554	156,553,952,255
派生商品評価勘定	88,849	24,050
未収利息	973,446,039	1,011,253,988
前払費用	62,937,415	77,691,070
流動資産合計	154,932,152,913	157,929,630,364
資産合計	154,932,152,913	157,929,630,364
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,210	158,416
未払金	86,521,240	-
未払解約金	71,316,388	114,537,194
未払利息	213	10
流動負債合計	157,850,051	114,695,620
負債合計	157,850,051	114,695,620
純資産の部		
元本等		
元本	58,234,773,394	56,559,461,172
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	96,539,529,468	101,255,473,572
元本等合計	154,774,302,862	157,814,934,744
純資産合計	154,774,302,862	157,814,934,744
負債純資産合計	154,932,152,913	157,929,630,364

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2023 年 6 月 15 日現在	2023 年 12 月 15 日現在
1.	期首	2022 年 12 月 16 日	2023 年 6 月 16 日
	期首元本額	57,789,894,452 円	58,234,773,394 円
	期首からの追加設定元本額	1,763,828,462 円	1,779,240,850 円
	期首からの一部解約元本額	1,318,949,520 円	3,454,553,072 円
	元本の内訳 ※		
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用）	18,107,486,656 円	19,265,198,903 円
	DCインデックスバランス（株式20）	424,146,388 円	424,170,404 円
	DCインデックスバランス（株式40）	587,133,502 円	594,863,816 円
	DCインデックスバランス（株式60）	824,018,681 円	851,180,829 円
	DCインデックスバランス（株式80）	689,692,157 円	769,679,137 円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	16,425,921,543 円	14,495,459,509 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	2,397,909,894 円	2,280,511,304 円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	12,597,623,368 円	12,021,092,590 円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	868,786,172 円	844,143,089 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）	145,804,201 円	140,319,112 円
	財産3分法（適格機関投資家専用）	269,545,966 円	319,670,818 円
	N i つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	— 円	602,411 円
	N i つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	— 円	1,078,556 円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）奇数月分配型	— 円	724,046 円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	170,528,921 円	— 円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	547,947,381 円	492,848,150 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	61,993,711 円	58,197,651 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	88,020,645 円	85,976,760 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	92,217,478 円	91,085,746 円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式80)	68,072,457 円	69,136,151 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	3,545,827,443 円	3,419,877,706 円
海外債券インデックスファンド (個人型年金向け)	322,096,830 円	333,644,484 円
計	58,234,773,394 円	56,559,461,172 円
2. 受益権の総数	58,234,773,394 口	56,559,461,172 口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	自 2022 年 12 月 16 日 至 2023 年 6 月 15 日	自 2023 年 6 月 16 日 至 2023 年 12 月 15 日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	2023 年 6 月 15 日現在	2023 年 12 月 15 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 6 月 15 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	979,686,290
合計	979,686,290

(2023年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	8,766,367,299
合計	8,766,367,299

(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6月15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	89,760,524	—	89,837,163	76,639
	米ドル	64,471,300	—	64,549,707	78,407
	ユーロ	19,616,617	—	19,625,311	8,694
	中国元	5,672,607	—	5,662,145	△10,462
合計		89,760,524	—	89,837,163	76,639

(2023年12月15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	52,665,800	—	52,689,850	24,050
	米ドル	52,665,800	—	52,689,850	24,050
	売建	43,857,000	—	44,015,416	△158,416
	メキシコペソ	43,857,000	—	44,015,416	△158,416
合計		96,522,800	—	96,705,266	△134,366

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年6月15日現在		2023年12月15日現在	
1口当たり純資産額	2,6578円	1口当たり純資産額	2,7902円
(1万口当たり純資産額)	(26,578円)	(1万口当たり純資産額)	(27,902円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,400,000.00	1,363,149.20	
		US TREASURY N/B-1.5%-24/11/30	3,470,000.00	3,359,279.24	
		US TREASURY N/B-4.5%-24/11/30	2,150,000.00	2,140,860.35	
		US TREASURY N/B-1.0%-24/12/15	2,450,000.00	2,357,568.85	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	1,849,771.60	
		US TREASURY N/B-1.75%-24/12/31	1,300,000.00	1,259,133.20	
		US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,462,528.50	
		US TREASURY N/B-1.375%-25/01/31	3,510,000.00	3,379,470.12	
		US TREASURY N/B-4.125%-25/01/31	1,190,000.00	1,181,144.02	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,530,000.00	4,386,666.27	
		US TREASURY N/B-1.5%-25/02/15	3,000,000.00	2,889,432.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	2,012,321.30	
		US TREASURY N/B-1.125%-25/02/28	5,740,000.00	5,499,298.84	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	2,010,000.00	1,958,256.57	
		US TREASURY N/B-0.5%-25/03/31	3,470,000.00	3,288,636.98	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/04/15	2,600,000.00	2,531,799.40	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,147,877.60	
		US TREASURY N/B-0.375%-25/04/30	2,150,000.00	2,028,600.25	
		US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	3,800,000.00	3,670,560.60	

US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,420,000.00	1,385,553.64	
US TREASURY N/B-0.25%-25/05/31	3,820,000.00	3,586,693.50	
US TREASURY N/B-2.875%-25/06/15	5,000,000.00	4,876,265.00	
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	1,370,000.00	1,333,715.55	
US TREASURY N/B-3.0%-25/07/15	5,000,000.00	4,882,910.00	
US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	1,440,000.00	1,403,183.52	
US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	3,000,000.00	2,800,488.00	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	4,730,000.00	4,541,627.75	
US TREASURY N/B-2.75%-25/08/31	3,000,000.00	2,915,154.00	
US TREASURY N/B-5.0%-25/08/31	5,000,000.00	5,041,990.00	
US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	4,200,000.00	4,096,310.40	
US TREASURY N/B-0.25%-25/09/30	1,570,000.00	1,457,799.95	
US TREASURY N/B-4.25%-25/10/15	170,000.00	169,485.24	
US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,364,834.80	
US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	2,110,000.00	1,953,769.27	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	3,440,000.00	3,305,891.60	
US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,283,492.76	
US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	3,420,000.00	3,166,037.64	
US TREASURY N/B-4.0%-25/12/15	210,000.00	208,560.24	
US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	1,933,828.00	
US TREASURY N/B-3.875%-26/01/15	1,150,000.00	1,139,779.95	
US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	1,787,416.35	
US TREASURY N/B-0.375%-26/01/31	3,000,000.00	2,761,992.00	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	1,863,702.00	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,310,000.00	3,128,724.54	
US TREASURY N/B-4.0%-26/02/15	3,000,000.00	2,981,892.00	
US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,723,503.29	
US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	3,650,000.00	3,362,416.50	
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	1,981,054.17	
US TREASURY N/B-0.75%-26/03/31	2,400,000.00	2,220,326.40	
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	1,050,000.00	1,006,687.50	
US TREASURY N/B-0.75%-26/04/30	2,740,000.00	2,527,540.40	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	4,840,000.00	4,556,027.52	
US TREASURY N/B-3.625%-26/05/15	6,750,000.00	6,662,324.25	
US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	2,740,000.00	2,609,312.96	
US TREASURY N/B-0.75%-26/05/31	2,800,000.00	2,576,929.60	

US TREASURY N/B-4.125%-26/06/15	3,000,000.00	2,995,956.00	
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	1,891,484.00	
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	960,000.00	905,886.72	
US TREASURY N/B-0.625%-26/07/31	3,260,000.00	2,976,787.50	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,733,592.00	
US TREASURY N/B-0.75%-26/08/31	3,000,000.00	2,742,069.00	
US TREASURY N/B-4.625%-26/09/15	2,600,000.00	2,633,311.20	
US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,514,952.72	
US TREASURY N/B-0.875%-26/09/30	2,000,000.00	1,831,914.00	
US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	250,000.00	233,271.25	
US TREASURY N/B-1.125%-26/10/31	3,950,000.00	3,634,000.00	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,040,000.00	2,866,564.96	
US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,400,000.00	2,236,500.00	
US TREASURY N/B-1.25%-26/11/30	2,210,000.00	2,036,565.83	
US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	1,869,100.00	
US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	4,000,000.00	3,702,420.00	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	2,680,000.00	2,538,043.08	
US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,390,000.00	1,269,487.00	
US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	670,000.00	600,041.95	
US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	2,020,000.00	1,797,048.56	
US TREASURY N/B-2.75%-27/04/30	1,430,000.00	1,372,742.80	
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,345,017.41	
US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	2,100,000.00	1,863,462.30	
US TREASURY N/B-2.625%-27/05/31	1,750,000.00	1,671,250.00	
US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	3,100,000.00	2,743,013.30	
US TREASURY N/B-3.25%-27/06/30	5,000,000.00	4,876,365.00	
US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	5,950,000.00	5,226,581.15	
US TREASURY N/B-2.75%-27/07/31	930,000.00	890,637.75	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	2,784,190.80	
US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	3,800,000.00	3,345,706.20	
US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	4,090,000.00	3,574,995.38	
US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	3,860,000.00	3,381,645.64	
US TREASURY N/B-4.125%-27/10/31	800,000.00	803,687.20	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	1,400,000.00	1,508,500.00	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	2,831,778.50	
US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	220,000.00	193,320.60	

US TREASURY N/B-3.875%-27/11/30	2,320,000.00	2,310,891.68	
US TREASURY N/B-0.625%-27/12/31	3,960,000.00	3,470,797.44	
US TREASURY N/B-0.75%-28/01/31	2,850,000.00	2,503,935.90	
US TREASURY N/B-3.5%-28/01/31	1,450,000.00	1,424,171.15	
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	3,813,280.00	
US TREASURY N/B-1.125%-28/02/29	3,830,000.00	3,413,636.87	
US TREASURY N/B-4.0%-28/02/29	2,650,000.00	2,653,879.60	
US TREASURY N/B-1.25%-28/03/31	960,000.00	858,112.32	
US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	3,370,000.00	3,006,275.90	
US TREASURY N/B-3.5%-28/04/30	3,000,000.00	2,946,501.00	
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	2,440,000.00	2,333,201.20	
US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	4,300,000.00	3,828,509.30	
US TREASURY N/B-3.625%-28/05/31	1,020,000.00	1,007,289.78	
US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	3,300,000.00	2,932,875.00	
US TREASURY N/B-4.0%-28/06/30	200,000.00	200,566.40	
US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	2,920,000.00	2,559,561.04	
US TREASURY N/B-4.125%-28/07/31	5,950,000.00	5,999,736.05	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	4,009,601.40	
US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	2,960,000.00	2,604,450.72	
US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	4,000,000.00	3,533,984.00	
US TREASURY N/B-1.375%-28/10/31	3,800,000.00	3,371,903.40	
US TREASURY N/B-4.875%-28/10/31	2,100,000.00	2,188,920.30	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,132,652.78	
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	2,610,000.00	2,515,181.31	
US TREASURY N/B-1.5%-28/11/30	4,930,000.00	4,393,280.76	
US TREASURY N/B-1.375%-28/12/31	870,000.00	769,032.15	
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,590,000.00	4,309,665.75	
US TREASURY N/B-2.375%-29/03/31	4,630,000.00	4,287,180.91	
US TREASURY N/B-2.875%-29/04/30	2,000,000.00	1,897,968.00	
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	4,810,000.00	4,449,153.80	
US TREASURY N/B-3.25%-29/06/30	4,980,000.00	4,811,825.40	
US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	1,670,000.00	1,481,014.45	
US TREASURY N/B-4.0%-29/10/31	1,920,000.00	1,925,773.44	
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	7,190,000.00	6,397,554.15	
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	3,769,780.42	
US TREASURY N/B-4.0%-30/02/28	1,650,000.00	1,655,606.70	

US TREASURY N/B-3.625%-30/03/31	2,550,000.00	2,506,170.60	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,199,249.02	
US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	4,590,000.00	3,739,684.14	
US TREASURY N/B-3.75%-30/05/31	710,000.00	702,635.88	
US TREASURY N/B-4.0%-30/07/31	4,900,000.00	4,919,712.70	
US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	5,090,000.00	4,116,435.70	
US TREASURY N/B-4.625%-30/09/30	800,000.00	833,124.80	
US TREASURY N/B-4.875%-30/10/31	3,000,000.00	3,170,154.00	
US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	5,910,000.00	4,841,927.07	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	560,000.00	613,440.24	
US TREASURY N/B-1.125%-31/02/15	4,400,000.00	3,660,764.80	
US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	6,930,000.00	5,929,751.52	
US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	7,130,000.00	5,887,540.46	
US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	6,830,000.00	5,658,627.68	
US TREASURY N/B-1.875%-32/02/15	6,240,000.00	5,354,207.04	
US TREASURY N/B-2.875%-32/05/15	4,800,000.00	4,440,374.40	
US TREASURY N/B-2.75%-32/08/15	5,100,000.00	4,661,915.10	
US TREASURY N/B-4.125%-32/11/15	6,110,000.00	6,200,574.64	
US TREASURY N/B-3.5%-33/02/15	2,610,000.00	2,525,683.95	
US TREASURY N/B-3.375%-33/05/15	1,490,000.00	1,427,023.66	
US TREASURY N/B-3.875%-33/08/15	2,200,000.00	2,192,436.40	
US TREASURY N/B-4.5%-33/11/15	3,000,000.00	3,145,077.00	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	851,093.60	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	836,454.75	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	701,615.29	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	720,000.00	762,046.56	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	753,343.20	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	1,485,852.70	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	1,495,298.34	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	777,260.25	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	724,837.16	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	1,641,953.25	
US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	2,368,000.00	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,397,024.64	
US TREASURY N/B-1.125%-40/08/15	3,000,000.00	1,903,710.00	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	1,024,774.28	

US TREASURY N/B-1.375%-40/11/15	3,100,000.00	2,045,212.60	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	1,614,609.00	
US TREASURY N/B-1.875%-41/02/15	4,200,000.00	3,006,116.40	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	894,587.07	
US TREASURY N/B-2.25%-41/05/15	4,900,000.00	3,719,212.70	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	910,855.68	
US TREASURY N/B-1.75%-41/08/15	3,190,000.00	2,211,068.75	
US TREASURY N/B-2.0%-41/11/15	3,000,000.00	2,163,396.00	
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	432,333.50	
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	648,328.00	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	1,615,390.00	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	1,765,000.00	1,508,764.36	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	1,682,601.05	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	1,950,000.00	1,792,362.00	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	1,954,108.20	
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	1,080,000.00	990,561.96	
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,000,000.00	1,764,178.00	
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	2,150,000.00	1,820,865.10	
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	1,900,000.00	1,573,547.70	
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	2,120,000.00	1,606,892.16	
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	1,400,000.00	1,156,229.20	
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	1,390,000.00	1,121,392.23	
US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	1,190,000.00	979,634.18	
US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	1,500,000.00	1,125,673.50	
US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	1,500,000.00	1,123,476.00	
US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	1,650,000.00	1,173,979.95	
US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	540,000.00	432,769.50	
US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,000,000.00	1,636,484.00	
US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	1,530,000.00	1,251,342.63	
US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	1,700,000.00	1,326,231.20	
US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,740,000.00	1,356,961.62	
US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	2,245,760.00	
US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	2,003,623.20	
US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	3,344,939.90	
US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	2,576,928.25	
US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	2,692,011.30	

		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	2,391,093.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,950,000.00	2,065,920.40	
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	2,230,605.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	2,443,010.10	
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	2,450,000.00	1,325,246.65	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,920,000.00	1,632,119.40	
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	3,000,000.00	1,792,791.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	4,750,000.00	3,025,061.25	
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	4,100,000.00	2,937,822.20	
		US TREASURY N/B-2.0%-51/08/15	2,000,000.00	1,311,874.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/11/15	1,400,000.00	889,273.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-52/02/15	2,000,000.00	1,393,358.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-52/05/15	600,000.00	479,847.60	
		US TREASURY N/B-3.0%-52/08/15	1,100,000.00	902,987.80	
		US TREASURY N/B-4.0%-52/11/15	1,500,000.00	1,485,585.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-53/02/15	2,900,000.00	2,687,595.30	
		US TREASURY N/B-3.625%-53/05/15	2,150,000.00	1,995,636.45	
		US TREASURY N/B-4.125%-53/08/15	1,500,000.00	1,521,913.50	
			576,495,000.00	519,017,156.81	
				(73,959,944,845)	
米ドル小計					
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-25/02/01	550,000.00	546,051.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	710,000.00	685,242.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-25/04/01	760,000.00	733,886.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-25/05/01	530,000.00	526,957.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	950,000.00	925,775.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-25/08/01	510,000.00	505,455.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-25/09/01	1,755,000.00	1,656,386.55	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-25/10/01	430,000.00	422,969.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-25/11/01	450,000.00	454,702.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	995,000.00	922,971.95	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-26/04/01	700,000.00	688,828.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	670,000.00	636,922.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-26/09/01	990,000.00	925,343.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	520,000.00	485,851.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	750,000.00	693,810.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-27/09/01	620,000.00	606,682.40	

		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-28/03/01	580,000.00	584,576.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	897,000.00	852,840.69	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-28/09/01	630,000.00	630,308.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	410,000.00	462,803.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	364,000.00	347,984.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	1,998,000.00	1,775,882.34	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-30/12/01	1,405,000.00	1,172,865.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	1,846,000.00	1,644,564.48	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/12/01	1,820,000.00	1,609,753.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-32/06/01	1,070,000.00	979,178.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-32/12/01	890,000.00	845,135.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	710,000.00	859,589.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-33/06/01	500,000.00	484,060.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-33/12/01	200,000.00	201,848.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	290,000.00	348,127.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	600,000.00	675,978.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	730,000.00	785,509.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	650,000.00	622,635.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	2,123,000.00	1,726,657.13	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-53/12/01	1,241,000.00	942,415.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-55/12/01	200,000.00	190,386.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	319,992.00	
			31,379,000.00	29,480,927.64	
				(3,132,053,752)	
加ドル小計					
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	11,700,000.00	11,636,352.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-25/03/06	6,400,000.00	6,043,520.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	24,250,000.00	22,347,830.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.0%-26/09/03	2,500,000.00	2,352,362.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	13,350,000.00	11,939,772.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	21,600,000.00	20,485,764.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/03/01	1,000,000.00	974,515.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	14,120,000.00	13,812,466.40	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	20,900,000.00	19,451,734.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-33/05/26	10,800,000.00	9,749,268.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	5,300,000.00	4,832,990.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-35/05/24	600,000.00	551,958.00	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	4,400,000.00	4,723,686.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	11,170,000.00	10,643,390.35	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	14,100,000.00	12,343,492.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	13,570,000.00	12,088,902.35	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-53/07/31	8,150,000.00	7,202,114.25	
メキシコペソ小計			183,910,000.00	171,180,119.10 (1,418,860,653)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	270,000.00	120,507.21	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,135,000.00	1,100,805.85	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	585,000.00	609,655.99	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	772,000.00	743,999.56	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	830,000.00	785,609.94	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	545,000.00	497,791.55	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	970,000.00	1,092,198.66	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	900,000.00	840,524.40	
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	950,000.00	877,537.80	
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	730,000.00	627,508.00	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	855,000.00	765,799.56	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-31/10/22	750,000.00	614,874.00	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	565,000.00	624,156.63	
		BELGIUM KINGDOM-0.35%-32/06/22	675,000.00	559,158.52	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	525,000.00	465,699.15	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-33/06/22	373,000.00	382,410.79	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	543,000.00	554,688.07	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	974,000.00	1,177,413.08	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	340,000.00	284,602.10	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	485,000.00	424,074.30	
		BELGIUM KINGDOM-2.75%-39/04/22	160,000.00	154,902.72	
		BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	405,000.00	266,803.06	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,112,000.00	1,288,424.36	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	585,000.00	640,590.79	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	658,000.00	489,405.26	
		BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	650,000.00	479,069.50	
BELGIUM KINGDOM-1.4%-53/06/22	485,000.00	321,314.44			
BELGIUM KINGDOM-3.3%-54/06/22	370,000.00	373,854.66			
BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	412,000.00	335,101.84			

BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	446,000.00	350,199.64	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-71/10/31	345,000.00	171,931.44	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-25/01/31	1,350,000.00	1,303,786.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%-25/04/30	1,350,000.00	1,324,193.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	1,390,000.00	1,427,225.59	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%-25/10/31	1,455,000.00	1,438,736.01	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-26/01/31	1,455,000.00	1,372,043.17	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-26/04/30	1,055,000.00	1,035,593.27	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.8%-26/05/31	225,000.00	225,125.77	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	1,360,000.00	1,466,162.96	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%-26/10/31	1,640,000.00	1,577,470.08	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-27/01/31	755,000.00	694,680.03	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%-27/04/30	1,275,000.00	1,227,066.37	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%-27/07/30	1,315,000.00	1,230,682.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-27/10/31	1,400,000.00	1,337,964.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-28/01/31	1,125,000.00	1,009,256.62	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/04/30	1,270,000.00	1,204,252.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/07/30	1,275,000.00	1,205,489.55	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-28/10/31	1,095,000.00	1,217,295.07	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	1,545,000.00	1,787,062.87	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-29/04/30	1,275,000.00	1,196,262.37	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.5%-29/05/31	190,000.00	197,273.96	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%-29/07/30	515,000.00	463,507.21	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%-29/10/31	1,280,000.00	1,133,158.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-30/04/30	1,290,000.00	1,120,891.32	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-30/07/30	1,180,000.00	1,120,784.06	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%-30/10/31	1,180,000.00	1,065,288.66	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%-31/04/30	1,325,000.00	1,085,780.52	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-31/10/31	1,175,000.00	979,780.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.7%-32/04/30	1,270,000.00	1,062,297.85	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	1,350,000.00	1,637,585.10	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.55%-32/10/31	1,045,000.00	1,010,713.55	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-33/04/30	1,082,000.00	1,091,917.61	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%-33/07/30	1,165,000.00	1,098,829.16	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.55%-33/10/31	895,000.00	929,863.83	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%-35/07/30	1,065,000.00	926,411.55	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	1,190,000.00	1,304,060.31	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.85%-37/07/30	670,000.00	487,524.83	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.9%-39/07/30	340,000.00	356,634.84	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	1,045,000.00	1,226,626.22	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%-40/10/31	1,000,000.00	707,770.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	1,265,000.00	1,463,765.65	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-42/07/30	390,000.00	256,775.61	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-43/07/30	300,000.00	293,621.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	830,000.00	1,020,993.79	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	980,000.00	873,801.32	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	985,000.00	835,949.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-50/10/31	1,170,000.00	650,232.18	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.9%-52/10/31	650,000.00	444,460.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	848,000.00	787,064.41	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-25/04/11	1,300,000.00	1,252,511.00	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-25/10/10	1,650,000.00	1,575,934.80	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-26/04/10	1,600,000.00	1,515,564.80	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-27/04/16	1,150,000.00	1,070,725.90	
BUNDESOBLIGATION-1.3%-27/10/15	1,130,000.00	1,096,875.18	
BUNDESOBLIGATION-2.2%-28/04/13	750,000.00	752,829.74	
BUNDESOBLIGATION-2.4%-28/10/19	265,000.00	268,790.82	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	1,990,000.00	1,934,397.41	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15	2,070,000.00	2,014,621.29	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	1,820,000.00	1,746,655.82	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-26/08/15	2,010,000.00	1,893,084.33	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	1,915,000.00	1,802,867.17	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6. 5%-27/07/04	910,000.00	1,042,530.58
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 5%-27/08/15	1,770,000.00	1,669,986.15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-27/11/15	1,565,000.00	1,442,523.10
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5. 625%- 28/01/04	650,000.00	737,940.45
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 5%-28/02/15	1,690,000.00	1,585,377.17
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4. 75%- 28/07/04	970,000.00	1,082,139.76
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 25%- 28/08/15	1,670,000.00	1,538,821.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-28/11/15	1,180,000.00	1,068,866.42
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 25%- 29/02/15	1,705,000.00	1,558,741.69
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-29/08/15	1,760,000.00	1,572,420.96
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2. 1%-29/11/15	620,000.00	621,799.24
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6. 25%- 30/01/04	660,000.00	817,122.24
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-30/02/15	1,490,000.00	1,318,685.76
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-30/08/15	1,800,000.00	1,577,023.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-30/08/15	740,000.00	649,109.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5. 5%-31/01/04	1,110,000.00	1,360,087.44
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-31/02/15	1,920,000.00	1,664,405.76
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-31/08/15	1,565,000.00	1,342,421.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-31/08/15	400,000.00	343,221.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-32/02/15	1,623,000.00	1,375,643.43
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1. 7%-32/08/15	1,680,000.00	1,631,380.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2. 3%-33/02/15	1,450,000.00	1,474,995.10
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2. 3%-33/02/15	170,000.00	173,024.81
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2. 6%-33/08/15	1,215,000.00	1,265,394.55
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4. 75%- 34/07/04	1,375,000.00	1,707,766.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-35/05/15	1,200,000.00	934,575.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-36/05/15	1,000,000.00	758,192.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4. 0%-37/01/04	1,790,000.00	2,136,293.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1. 0%-38/05/15	50,000.00	42,027.85
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4. 25%- 39/07/04	1,235,000.00	1,539,084.17
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4. 75%- 40/07/04	1,165,000.00	1,544,713.11
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3. 25%- 42/07/04	955,000.00	1,079,229.26

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-44/07/04	1,635,000.00	1,669,413.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-46/08/15	1,827,000.00	1,872,952.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%-48/08/15	2,040,000.00	1,634,501.04	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	1,630,000.00	892,169.09	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	640,000.00	352,123.52	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-52/08/15	750,000.00	392,373.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%-53/08/15	1,040,000.00	923,762.32	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%-53/08/15	500,000.00	445,249.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.2%-24/12/12	240,000.00	237,763.92	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.5%-25/03/13	680,000.00	676,292.64	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.8%-25/06/12	910,000.00	909,588.68	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-3.1%-25/12/12	200,000.00	202,065.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-72/03/01	220,000.00	133,755.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-24/12/01	1,080,000.00	1,071,551.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-24/12/15	870,000.00	842,521.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%-25/02/01	1,485,000.00	1,437,901.74	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-25/03/01	1,540,000.00	1,570,926.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.4%-25/03/28	270,000.00	270,486.27	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-25/05/15	855,000.00	835,558.15	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-25/06/01	1,300,000.00	1,270,088.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%-25/07/01	1,000,000.00	980,916.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.6%-25/09/29	85,000.00	85,744.26	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-25/11/15	1,100,000.00	1,090,266.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-25/12/01	1,085,000.00	1,064,750.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-26/01/15	810,000.00	818,169.66	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%-26/02/01	850,000.00	806,562.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-26/03/01	1,330,000.00	1,372,240.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-26/04/01	1,020,000.00	953,248.14	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%-26/04/15	950,000.00	967,465.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%-26/06/01	1,330,000.00	1,287,909.49	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%-26/07/15	950,000.00	930,156.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-26/08/01	870,000.00	805,730.49	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	720,000.00	804,414.24	

BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,080,000.00	1,028,826.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%- 27/01/15	1,005,000.00	943,302.04	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.1%-27/04/01	410,000.00	386,340.54	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%-27/06/01	1,160,000.00	1,131,382.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	995,000.00	963,642.57	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 27/09/15	775,000.00	719,582.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	1,560,000.00	1,757,474.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.65%- 27/12/01	950,000.00	937,200.65	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-28/02/01	1,650,000.00	1,584,980.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%- 28/03/15	1,230,000.00	1,094,706.15	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%-28/07/15	1,130,000.00	1,006,695.53	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%-28/08/01	110,000.00	113,161.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,330,000.00	1,424,255.77	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-28/12/01	1,030,000.00	1,015,407.99	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 29/02/15	735,000.00	640,508.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-29/06/15	305,000.00	298,463.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-29/08/01	2,025,000.00	2,003,077.35	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	1,750,000.00	1,937,811.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 29/12/15	535,000.00	550,814.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-30/03/01	1,620,000.00	1,639,504.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 30/04/01	1,075,000.00	956,115.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.7%-30/06/15	540,000.00	550,279.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 30/08/01	1,087,000.00	932,430.77	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-30/11/15	585,000.00	605,920.77	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 30/12/01	1,287,000.00	1,148,108.24	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%-31/04/01	1,295,000.00	1,086,233.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	1,515,000.00	1,772,247.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%-31/08/01	1,120,000.00	907,660.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-31/10/30	290,000.00	300,205.39	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-	1,010,000.00	833,162.13	

31/12/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,250,000.00	1,085,351.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 32/06/01	1,200,000.00	974,791.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-32/12/01	630,000.00	577,529.82	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,475,000.00	1,713,600.42	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.4%-33/05/01	865,000.00	916,121.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	1,365,000.00	1,230,173.49	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.35%- 33/11/01	700,000.00	736,521.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.2%-34/03/01	240,000.00	248,889.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	1,520,000.00	1,678,458.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	980,000.00	934,333.96	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-35/04/30	400,000.00	405,700.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 36/03/01	900,000.00	686,073.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	965,000.00	803,119.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	1,825,000.00	1,836,092.35	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 37/03/01	400,000.00	277,727.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 38/03/01	200,000.00	182,458.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	855,000.00	751,654.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	1,250,000.00	1,372,432.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%-40/03/01	810,000.00	712,604.79	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	1,070,000.00	1,176,962.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%-41/03/01	730,000.00	522,383.62	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.45%- 43/09/01	500,000.00	513,822.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	935,000.00	1,001,487.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-45/04/30	440,000.00	276,815.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	820,000.00	706,758.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%-47/03/01	970,000.00	760,099.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	1,015,000.00	901,599.12	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 49/09/01	650,000.00	611,055.25	

BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-50/09/01	870,000.00	631,771.38	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%-51/09/01	750,000.00	457,357.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-52/09/01	280,000.00	185,515.68	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-53/10/01	475,000.00	487,685.35	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	500,000.00	364,045.00	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	332,000.00	337,964.04	
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	280,000.00	271,434.52	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	335,000.00	319,613.78	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-26/09/15	180,000.00	168,047.82	
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-27/04/15	170,000.00	164,166.11	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	400,000.00	372,988.80	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	385,923.06	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	246,656.61	
FINNISH GOVERNMENT-2.875%-29/04/15	105,000.00	107,246.26	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	375,000.00	336,319.87	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-30/09/15	172,000.00	145,626.89	
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	365,000.00	322,284.05	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-31/09/15	200,000.00	166,123.00	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-32/09/15	230,000.00	210,340.06	
FINNISH GOVERNMENT-3.0%-33/09/15	110,000.00	113,194.07	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	325,000.00	279,412.25	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	278,000.00	200,740.18	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-38/04/15	210,000.00	206,244.36	
FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15	263,000.00	171,580.67	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	277,000.00	266,015.28	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-43/04/15	235,000.00	151,617.77	
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	195,290.42	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-52/04/15	250,000.00	121,500.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	515,000.00	211,927.65	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/02/25	375,000.00	361,896.37	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/03/25	2,865,000.00	2,758,803.04	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	2,610,000.00	2,524,227.57	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	1,670,000.00	1,768,957.52	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	2,070,000.00	2,006,554.50	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-26/02/25	2,440,000.00	2,308,393.72	

FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	2,470,000.00	2,522,245.44	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,450,000.00	2,333,794.05	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-26/09/24	1,360,000.00	1,359,466.88	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,620,000.00	2,457,539.04	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-27/02/25	2,005,000.00	1,856,710.20	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	1,775,000.00	1,692,444.75	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,020,000.00	3,057,275.86	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/02/25	1,275,000.00	1,192,501.12	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	3,765,000.00	3,508,467.96	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	3,080,000.00	2,848,963.04	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-29/02/25	140,000.00	142,232.02	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	2,105,000.00	2,426,117.75	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	3,060,000.00	2,768,115.78	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-29/11/25	2,580,000.00	2,241,405.96	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	3,065,000.00	3,081,014.62	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-30/11/25	3,049,000.00	2,579,508.88	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	3,040,000.00	2,845,582.88	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-31/11/25	2,605,000.00	2,142,503.09	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-32/05/25	1,983,000.00	1,607,064.84	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	1,850,000.00	2,311,353.00	
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-32/11/25	2,075,000.00	1,982,631.37	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-33/05/25	1,130,000.00	1,167,109.20	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	2,475,000.00	2,155,217.62	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	1,425,000.00	1,703,111.55	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	2,555,000.00	2,140,563.67	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-38/05/25	190,000.00	152,994.65	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	1,590,000.00	1,801,827.75	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	1,890,000.00	1,625,086.26	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	2,780,000.00	3,354,837.28	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-43/05/25	135,000.00	124,154.50	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-44/06/25	1,050,000.00	648,070.50	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	1,580,000.00	1,630,912.34	
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	1,580,000.00	1,291,495.16	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-50/05/25	1,840,000.00	1,319,193.52	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-52/05/25	1,500,000.00	847,090.50	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-53/05/25	1,320,000.00	730,280.76	

FRANCE (GOVT OF)-3.0%-54/05/25	850,000.00	825,609.25	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,300,000.00	1,520,308.40	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,070,000.00	1,266,838.27	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	945,000.00	667,451.61	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	580,000.00	597,449.30	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	595,000.00	574,552.23	
IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15	327,000.00	304,459.89	
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	425,000.00	400,188.50	
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	525,000.00	492,220.05	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	476,000.00	477,532.24	
IRISH TREASURY-0.2%-30/10/18	282,000.00	243,609.93	
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	335,000.00	312,636.40	
IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	485,000.00	403,639.31	
IRISH TREASURY-0.35%-32/10/18	205,000.00	171,577.21	
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	285,000.00	257,742.60	
IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	250,000.00	196,817.00	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	365,000.00	322,510.35	
IRISH TREASURY-0.55%-41/04/22	185,000.00	127,856.46	
IRISH TREASURY-3.0%-43/10/18	170,000.00	174,604.79	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	541,000.00	461,586.61	
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	479,000.00	356,510.12	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	940,000.00	904,580.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-26/01/15	455,000.00	431,664.41	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,100,000.00	1,048,083.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	778,000.00	724,493.05	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	870,000.00	824,349.36	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	655,000.00	735,088.81	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	961,000.00	897,721.99	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	620,000.00	552,992.88	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	595,000.00	532,682.08	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-30/01/15	365,000.00	368,975.58	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-30/07/15	670,000.00	577,339.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-31/07/15	710,000.00	596,985.75	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-32/07/15	700,000.00	599,282.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	855,000.00	862,483.81	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/07/15	370,000.00	372,200.02	

NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	985,000.00	1,139,777.97	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-38/01/15	395,000.00	275,660.62	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	848,000.00	619,753.16	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	922,000.00	1,075,268.67	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-44/01/15	170,000.00	187,191.25	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,004,000.00	1,038,453.26	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	907,000.00	456,596.49	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-54/01/15	365,000.00	323,750.25	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.7%-71/04/20	200,000.00	93,860.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	173,000.00	107,543.02	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	363,000.00	280,500.62	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.85%-99/99/99	192,000.00	90,096.96	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-25/04/20	460,000.00	442,635.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	710,000.00	691,645.08	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	550,000.00	576,134.35	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.0%-26/07/15	170,000.00	167,891.66	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	773,000.00	736,331.97	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	642,705.36	
REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	487,000.00	549,571.22	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	660,000.00	616,024.86	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-28/10/20	317,000.00	281,937.89	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	800,000.00	724,471.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-29/05/23	150,000.00	153,606.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	680,000.00	583,614.08	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-31/02/20	745,000.00	620,970.91	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.9%-32/02/20	610,000.00	533,473.06	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-33/02/20	650,000.00	662,367.54	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	455,000.00	442,306.86	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-36/10/20	270,000.00	194,995.35	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	840,000.00	956,146.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	255,000.00	157,640.49	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	394,000.00	407,054.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	503,000.00	382,094.39	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.85%-49/05/23	200,000.00	161,539.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	455,000.00	272,839.38	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-53/10/20	106,000.00	109,686.89	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	245,000.00	290,289.23	
ユーロ小計			349,221,000.00	330,194,866.28 (51,668,892,675)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	760,000.00	379,848.00	
		UK TREASURY-1.125%-73/10/22	513,000.00	204,225.30	
		UK TREASURY-0.25%-25/01/31	1,590,000.00	1,514,745.30	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	805,000.00	809,210.15	
		UK TREASURY-0.625%-25/06/07	813,000.00	770,122.38	
		UK TREASURY-3.5%-25/10/22	1,200,000.00	1,182,620.40	
		UK TREASURY-0.125%-26/01/30	710,000.00	654,442.50	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	820,000.00	771,415.00	
		UK TREASURY-0.375%-26/10/22	1,260,000.00	1,141,204.68	
		UK TREASURY-4.125%-27/01/29	1,495,000.00	1,502,415.20	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	755,000.00	691,542.25	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	850,000.00	865,172.50	
		UK TREASURY-0.125%-28/01/31	745,000.00	643,829.00	
		UK TREASURY-4.5%-28/06/07	795,000.00	817,919.85	
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	720,000.00	655,855.92	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	710,000.00	783,378.50	
		UK TREASURY-0.5%-29/01/31	1,055,000.00	898,596.25	
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	856,000.00	732,551.10	
		UK TREASURY-0.375%-30/10/22	870,000.00	698,488.20	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	945,000.00	1,006,930.57	
		UK TREASURY-0.25%-31/07/31	1,445,000.00	1,116,493.70	
		UK TREASURY-1.0%-32/01/31	1,645,000.00	1,332,598.05	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,140,000.00	1,184,631.00	
		UK TREASURY-3.25%-33/01/31	1,450,000.00	1,391,395.34	
		UK TREASURY-0.875%-33/07/31	1,340,000.00	1,025,428.30	
		UK TREASURY-4.625%-34/01/31	220,000.00	233,964.06	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	849,000.00	894,772.98	
		UK TREASURY-0.625%-35/07/31	1,097,000.00	760,203.44	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	970,000.00	997,518.90	
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,350,000.00	1,023,551.10	
UK TREASURY-3.75%-38/01/29	440,000.00	422,918.32			
UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,005,000.00	1,075,251.51			
UK TREASURY-1.125%-39/01/31	300,000.00	198,997.20			

		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	850,000.00	859,095.00	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	815,000.00	820,826.43	
		UK TREASURY-1.25%-41/10/22	1,360,000.00	860,172.80	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,090,000.00	1,127,053.46	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,175,000.00	1,014,025.00	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,160,000.00	1,034,695.64	
		UK TREASURY-0.875%-46/01/31	435,000.00	225,843.30	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	720,000.00	716,096.16	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,140,000.00	673,205.34	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	675,000.00	415,517.17	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	895,000.00	890,123.14	
		UK TREASURY-0.625%-50/10/22	660,000.00	281,556.00	
		UK TREASURY-1.25%-51/07/31	600,000.00	309,720.00	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	872,000.00	797,656.76	
		UK TREASURY-1.5%-53/07/31	580,000.00	312,894.92	
		UK TREASURY-3.75%-53/10/22	970,000.00	882,894.00	
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	925,000.00	511,927.37	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	962,000.00	960,112.55	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	606,945.00	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	751,000.00	724,114.20	
		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	1,050,000.00	340,095.00	
		UK TREASURY-4.0%-63/10/22	370,000.00	356,384.00	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	830,000.00	724,741.06	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	765,000.00	737,051.49	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	742,000.00	503,150.20	
英ボンド小計			52,985,000.00	45,068,132.94 (8,188,879,755)	
スウェーデン デンクローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,000,000.00	3,973,444.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	4,400,000.00	4,227,687.20	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,550,000.00	3,339,932.30	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	3,780,000.00	3,497,966.64	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	2,700,000.00	2,334,590.10	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,800,000.00	1,812,956.40	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.75%-33/11/11	1,480,000.00	1,425,587.80	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	2,645,000.00	3,033,762.10	
スウェーデンクローナ小計			24,355,000.00	23,645,926.54	

				(328,441,919)	
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	2,990,000.00	2,914,756.65	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,400,000.00	2,301,609.60	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,400,000.00	2,290,356.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,040,000.00	1,943,177.52	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	2,050,000.00	1,899,023.65	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	2,885,000.00	2,577,963.87	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.25%-31/09/17	2,040,000.00	1,776,325.92	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.125%-32/05/18	2,130,000.00	1,965,221.07	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-33/08/15	1,900,000.00	1,868,005.90	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.5%-42/10/06	1,050,000.00	1,123,733.10	
ノルウェークローネ小計			21,885,000.00	20,660,173.28	(280,151,949)
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	3,170,000.00	3,121,156.64	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	3,130,000.00	2,931,598.69	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	2,730,000.00	2,476,568.64	
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-31/11/15	1,350,000.00	1,132,963.20	
		KINGDOM OF DENMARK-2.25%-33/11/15	700,000.00	693,728.70	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	7,760,000.00	9,817,765.76	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	1,550,000.00	864,807.00	
デンマーククローネ小計			20,390,000.00	21,038,588.63	(441,599,975)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	1,440,000.00	1,360,958.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,270,000.00	2,209,164.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-25/10/25	300,000.00	274,218.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,390,000.00	2,256,518.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,950,000.00	1,720,173.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	1,310,000.00	1,269,062.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,140,000.00	1,985,064.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,160,000.00	1,991,368.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-7.5%-28/07/25	1,720,000.00	1,906,465.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	855,000.00	889,977.19	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	2,665,000.00	2,398,579.95	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	2,025,000.00	1,611,900.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-32/04/25	1,770,000.00	1,381,502.70	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.0%-33/10/25	1,230,000.00	1,311,622.80	

ポーランドズロチ小計			24,225,000.00	22,566,575.04 (816,555,721)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	1,060,000.00	1,049,521.90
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	950,000.00	887,090.05
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	1,000,000.00	1,010,522.00
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,210,000.00	1,108,069.60
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,080,000.00	1,113,616.08
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	930,000.00	896,181.48
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	700,000.00	656,880.70
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	720,000.00	686,594.16
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,030,000.00	1,001,547.28
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	890,000.00	837,784.59
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,120,000.00	1,030,886.08
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	1,010,000.00	828,212.12
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,183,000.00	992,379.66
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,485,000.00	1,181,647.17
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,580,000.00	1,264,669.92
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	1,295,000.00	1,069,044.51
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,190,000.00	1,225,315.63
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-33/11/21	1,010,000.00	917,826.39
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-34/05/21	960,000.00	928,534.08
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.5%-34/12/21	855,000.00	805,212.49
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	530,000.00	461,059.19
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	550,000.00	522,062.20
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	582,000.00	509,369.31
AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	790,000.00	629,293.46		
AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	720,000.00	564,737.76		
AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	1,020,000.00	579,364.08		
AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-54/06/21	260,000.00	271,588.72		
豪ドル小計			25,710,000.00	23,029,010.61 (2,198,119,062)
ニュージーランドドル	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-25/04/15	590,000.00	573,110.66
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.5%-26/05/15	215,000.00	195,263.43
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-27/04/15	700,000.00	700,886.20
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.25%-28/05/15	370,000.00	308,893.76
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.0%-29/04/20	680,000.00	634,937.76

		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.5%-31/05/15	350,000.00	284,348.75	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.0%-32/05/15	190,000.00	156,647.40	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.5%-33/04/14	430,000.00	395,563.88	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.25%-34/05/15	220,000.00	213,614.50	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-37/04/15	430,000.00	345,396.64	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.75%-41/05/15	225,000.00	143,732.70	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-51/05/15	500,000.00	343,892.50	
ニュージーランドドル小計			4,900,000.00	4,296,288.18 (379,577,060)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-72/08/01	240,000.00	251,880.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	480,000.00	473,184.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-25/11/01	314,000.00	298,409.90	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	470,000.00	459,331.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-26/11/01	255,000.00	243,015.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	533,000.00	542,860.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-27/09/01	110,000.00	110,583.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	347,000.00	345,889.60	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-28/08/01	60,000.00	60,544.20	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	365,000.00	367,628.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	490,000.00	493,675.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-31/07/01	300,000.00	277,200.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-32/08/01	170,000.00	168,555.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	335,000.00	353,461.85	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	421,000.00	399,108.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	220,000.00	209,216.70	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	352,000.00	347,744.32	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	382,000.00	374,169.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	367,000.00	299,472.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-51/10/01	222,000.00	181,576.02	
シンガポールドル小計			6,433,000.00	6,257,503.09 (671,179,781)	
マレーシアリングgit	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	770,000.00	774,662.35	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,380,000.00	1,392,668.40	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	830,000.00	838,470.15	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	1,170,000.00	1,182,916.80	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,200,000.00	1,214,496.00	

		MALAYSIA GOVERNMENT-3.519%-28/04/20	240,000.00	238,800.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.504%-29/04/30	200,000.00	208,145.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,320,000.00	1,333,853.40	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	985,000.00	911,647.05	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	752,906.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,100,000.00	1,092,190.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	960,000.00	985,843.20	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,320,000.00	1,422,154.80	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	1,080,000.00	1,190,489.40	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	1,490,000.00	1,427,978.75	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.696%-42/10/15	750,000.00	811,301.25	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	660,000.00	721,822.20	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	620,000.00	664,005.12	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	510,000.00	562,088.85	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	1,410,000.00	1,357,830.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.457%-53/03/31	580,000.00	603,052.10	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	650,000.00	662,983.10	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	948,332.75	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,510,000.00	1,517,859.55	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	910,000.00	949,578.63	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,061,794.08	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	1,010,000.00	1,007,966.87	
		マレーシアリングット小計	25,340,000.00	25,835,835.80 (787,690,712)	
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-2.26%-25/02/24	4,000,000.00	3,995,164.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.99%-25/04/09	22,000,000.00	21,883,609.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.24%-25/05/25	19,800,000.00	19,754,222.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-25/08/25	24,000,000.00	23,910,576.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	32,000,000.00	32,415,358.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.46%-26/02/15	10,900,000.00	10,908,087.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	17,000,000.00	17,261,358.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.3%-26/05/15	16,000,000.00	15,961,792.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-26/06/06	11,000,000.00	11,247,940.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	16,000,000.00	16,106,863.20	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-26/08/15	12,000,000.00	11,926,500.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-26/12/05	23,000,000.00	23,509,680.00	

CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	24,000,000.00	24,313,848.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	5,000,000.00	5,002,195.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.44%-27/10/15	5,000,000.00	4,989,845.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.28%-27/12/03	19,500,000.00	20,160,933.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.64%-28/01/15	10,000,000.00	10,053,510.50	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-28/04/15	11,000,000.00	11,064,042.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	13,000,000.00	13,283,504.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.4%-28/07/15	9,000,000.00	8,956,386.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	22,000,000.00	22,384,758.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-29/03/24	4,000,000.00	4,048,012.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-29/05/23	14,000,000.00	14,577,472.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-29/09/25	24,000,000.00	24,030,504.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-30/03/25	15,000,000.00	15,166,290.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	21,000,000.00	21,070,896.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-30/06/25	11,000,000.00	10,999,076.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-30/09/15	5,000,000.00	4,997,395.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	11,000,000.00	11,500,203.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	10,000,000.00	10,274,320.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.89%-31/11/18	9,000,000.00	9,155,079.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	10,000,000.00	10,069,080.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.76%-32/05/15	9,000,000.00	9,070,785.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-32/08/15	9,000,000.00	9,022,864.50	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-32/09/01	8,100,000.00	8,064,473.40	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-32/11/15	6,000,000.00	6,070,986.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-33/02/25	11,000,000.00	11,207,416.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/05/25	12,000,000.00	12,013,152.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.52%-33/08/25	5,000,000.00	4,946,415.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	13,000,000.00	14,952,821.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	7,000,000.00	7,945,707.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.53%-51/10/18	10,000,000.00	11,015,200.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.32%-52/04/15	10,000,000.00	10,622,470.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-52/10/25	8,000,000.00	8,211,632.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-53/04/15	9,000,000.00	9,412,326.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.0%-53/10/15	2,000,000.00	2,030,670.20	
中国元小計	579,300,000.00	589,565,417.40 (11,806,872,875)	

イスラエル シケル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-0.5%-25/04/30	1,360,000.00	1,301,841.68	
		ISRAEL FIXED BOND-1.75%-25/08/31	1,190,000.00	1,152,703.91	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-26/02/27	630,000.00	588,841.82	
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	950,000.00	1,018,749.81	
		ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,270,000.00	1,207,954.03	
		ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,160,000.00	1,091,771.83	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-29/02/28	420,000.00	422,967.02	
		ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	1,515,000.00	1,287,577.24	
		ISRAEL FIXED BOND-1.3%-32/04/30	830,000.00	682,486.67	
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	1,050,000.00	767,569.91	
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,160,000.00	1,342,693.35	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,300,000.00	1,174,758.06	
		ISRAEL FIXED BOND-2.8%-52/11/29	300,000.00	217,589.25	
		イスラエルシケル小計		13,135,000.00	12,257,504.58
合計			156,553,952,255	(156,553,952,255)	

(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 217 銘柄	100.0%	47.4%
加ドル	国債証券 38 銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 17 銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 358 銘柄	100.0%	33.0%
英ポンド	国債証券 58 銘柄	100.0%	5.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 8 銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 10 銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7 銘柄	100.0%	0.3%
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 27 銘柄	100.0%	1.4%
ニュージーランドドル	国債証券 12 銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 20 銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券 27 銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券 46 銘柄	100.0%	7.5%
イスラエルシケル	国債証券 13 銘柄	100.0%	0.3%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2023年6月15日現在	2023年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	122,739,645	311,319,484
株式	50,071,963,440	52,293,397,800
派生商品評価勘定	16,600,450	-
未収入金	594,922,650	-
未収配当金	382,602,772	20,746,829
前払金	-	2,201,500
流動資産合計	51,188,828,957	52,627,665,613
資産合計	51,188,828,957	52,627,665,613
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,554,250
前受金	17,872,000	-
未払金	-	186,364,060
未払解約金	340,654,800	22,925,777
未払利息	226	39
流動負債合計	358,527,026	210,844,126
負債合計	358,527,026	210,844,126
純資産の部		
元本等		
元本	21,889,552,957	21,959,599,100
剰余金		
剰余金又は欠損金(△)	28,940,748,974	30,457,222,387
元本等合計	50,830,301,931	52,416,821,487
純資産合計	50,830,301,931	52,416,821,487
負債純資産合計	51,188,828,957	52,627,665,613

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2023年6月15日現在	2023年12月15日現在
1.	期首	2022年12月16日	2023年6月16日
	期首元本額	22,694,142,047円	21,889,552,957円
	期首からの追加設定元本額	870,681,557円	1,043,491,379円
	期首からの一部解約元本額	1,675,270,647円	973,445,236円
	元本の内訳 ※		
	DCインデックスバランス（株式20）	769,024,455円	739,007,576円
	DCインデックスバランス（株式40）	2,076,629,419円	2,067,728,438円
	DCインデックスバランス（株式60）	4,277,847,008円	4,433,581,108円
	DCインデックスバランス（株式80）	4,951,606,936円	5,336,061,172円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,655,172,124円	1,826,969,072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	2,847,628,025円	2,642,431,737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）	526,361,865円	485,320,175円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	430,539円	1,119,147円
	Niつみインデックススラップ世界10指数（均等型）	－円	696,827円
	Niつみインデックススラップ世界10指数（安定成長型）	－円	311,821円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,990,867,816円	1,708,257,471円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	225,725,780円	202,958,766円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	614,384,448円	598,057,674円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	976,734,427円	954,286,999円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	977,140,115円	962,811,117円
計	21,889,552,957円	21,959,599,100円	
2.	受益権の総数	21,889,552,957口	21,959,599,100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	727,360,000円	715,615,500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)

I 金融商品の状況に関する事項

	自 2022 年 12 月 16 日 至 2023 年 6 月 15 日	自 2023 年 6 月 16 日 至 2023 年 12 月 15 日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	2023 年 6 月 15 日現在	2023 年 12 月 15 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 6 月 15 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	8,182,417,023
合計	8,182,417,023

(2023 年 12 月 15 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	2,391,691,564
合計	2,391,691,564

(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6月15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	464,708,000	—	481,320,000	16,612,000
合計		464,708,000	—	481,320,000	16,612,000

(2023年12月15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	117,951,500	—	116,400,000	△1,551,500
合計		117,951,500	—	116,400,000	△1,551,500

(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6月15日現在		2023年12月15日現在	
1口当たり純資産額	2,3221円	1口当たり純資産額	2,3870円
(1万口当たり純資産額)	(23,221円)	(1万口当たり純資産額)	(23,870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	800	3,725.00	2,980,000	
ニッセイ	22,100	762.70	16,855,670	
マルハニチロ	3,300	2,774.50	9,155,850	
雪国まいたけ	1,900	927.00	1,761,300	
カネコ種苗	700	1,400.00	980,000	
サカタのタネ	2,500	3,885.00	9,712,500	
ホクト	1,800	1,722.00	3,099,600	
ホクリヨウ	200	1,062.00	212,400	
住石ホールディングス	2,200	1,034.00	2,274,800	
日鉄鉱業	900	5,090.00	4,581,000	
三井松島ホールディングス	1,300	2,734.00	3,554,200	
I N P E X	81,700	1,900.00	155,230,000	
石油資源開発	2,600	5,120.00	13,312,000	
K&Oエナジーグループ	1,000	2,062.00	2,062,000	
ショーボンドホールディングス	3,000	5,874.00	17,622,000	
ミライト・ワン	7,400	1,813.00	13,416,200	
サンヨーホームズ	300	726.00	217,800	
日本アクア	600	853.00	511,800	
ファーストコーポレーション	400	742.00	296,800	
ベステラ	400	1,105.00	442,000	
キャンディル	400	561.00	224,400	
ダイセキ環境ソリューション	300	1,072.00	321,600	
第一カッター興業	700	1,303.00	912,100	
安藤・間	12,900	1,082.00	13,957,800	
東急建設	7,100	782.00	5,552,200	
コムシスホールディングス	7,100	3,102.00	22,024,200	
ビーアールホールディングス	3,500	351.00	1,228,500	
高松コンストラクショングループ	1,700	2,717.00	4,618,900	
東建コーポレーション	700	9,020.00	6,314,000	
ソネック	200	953.00	190,600	
ヤマウラ	1,200	1,437.00	1,724,400	
オリエンタル白石	8,500	332.00	2,822,000	
大成建設	14,500	4,927.00	71,441,500	

大林組	55,400	1,211.00	67,089,400
清水建設	44,000	932.20	41,016,800
飛島建設	1,700	1,280.00	2,176,000
長谷工コーポレーション	14,200	1,785.00	25,347,000
松井建設	1,600	813.00	1,300,800
銭高組	200	3,895.00	779,000
鹿島建設	34,300	2,335.00	80,090,500
不動テトラ	1,100	2,206.00	2,426,600
大末建設	400	1,304.00	521,600
鉄建建設	1,100	1,905.00	2,095,500
西松建設	3,000	3,834.00	11,502,000
三井住友建設	11,800	393.00	4,637,400
大豊建設	600	3,730.00	2,238,000
ナカノフドー建設	800	454.00	363,200
奥村組	2,500	4,455.00	11,137,500
東鉄工業	2,000	3,050.00	6,100,000
イチケン	300	2,222.00	666,600
富士ピー・エス	600	449.00	269,400
浅沼組	1,200	3,615.00	4,338,000
戸田建設	21,000	909.90	19,107,900
熊谷組	2,600	3,585.00	9,321,000
北野建設	200	3,100.00	620,000
植木組	300	1,449.00	434,700
矢作建設工業	2,200	1,362.00	2,996,400
ピーエス三菱	2,100	880.00	1,848,000
日本ハウスホールディングス	3,600	316.00	1,137,600
新日本建設	2,300	1,078.00	2,479,400
東亜道路工業	600	6,610.00	3,966,000
日本道路	1,900	1,970.00	3,743,000
東亜建設工業	1,200	3,425.00	4,110,000
日本国土開発	4,600	571.00	2,626,600
若築建設	600	2,973.00	1,783,800
東洋建設	4,000	1,233.00	4,932,000
五洋建設	22,000	789.90	17,377,800
福田組	600	5,040.00	3,024,000
住友林業	13,400	4,187.00	56,105,800

日本基礎技術	700	436.00	305,200
巴コーポレーション	1,300	550.00	715,000
大和ハウス工業	42,800	4,227.00	180,915,600
ライト工業	3,200	1,886.00	6,035,200
積水ハウス	47,000	3,070.00	144,290,000
日特建設	1,600	1,020.00	1,632,000
北陸電気工事	1,100	957.00	1,052,700
ユアテック	3,500	1,064.00	3,724,000
日本リーテック	1,300	1,144.00	1,487,200
四電工	700	2,966.00	2,076,200
中電工	2,400	2,551.00	6,122,400
関電工	9,700	1,372.00	13,308,400
きんでん	10,900	2,419.00	26,367,100
東京エネシス	1,600	1,008.00	1,612,800
トーエネック	500	4,320.00	2,160,000
住友電設	1,500	2,662.00	3,993,000
日本電設工業	3,000	1,916.00	5,748,000
エクシオグループ	7,800	3,076.00	23,992,800
新日本空調	1,000	2,233.00	2,233,000
九電工	3,400	5,030.00	17,102,000
三機工業	3,400	1,723.00	5,858,200
日揮ホールディングス	15,300	1,585.50	24,258,150
中外炉工業	500	2,241.00	1,120,500
ヤマト	800	900.00	720,000
太平電業	1,000	4,025.00	4,025,000
高砂熱学工業	4,200	3,135.00	13,167,000
三晃金属工業	100	4,560.00	456,000
朝日工業社	800	2,902.00	2,321,600
明星工業	3,100	1,089.00	3,375,900
大気社	1,800	4,095.00	7,371,000
ダイダン	2,100	1,373.00	2,883,300
日比谷総合設備	1,100	2,336.00	2,569,600
フィル・カンパニー	400	539.00	215,600
テスホールディングス	3,500	420.00	1,470,000
インフロニア・ホールディングス	17,900	1,405.50	25,158,450
東洋エンジニアリング	2,400	737.00	1,768,800

レイズネクスト	2,300	1,418.00	3,261,400
ニッポン	4,600	2,236.00	10,285,600
日清製粉グループ本社	14,400	1,922.00	27,676,800
日東富士製粉	300	4,730.00	1,419,000
昭和産業	1,500	3,090.00	4,635,000
鳥越製粉	800	667.00	533,600
中部飼料	2,100	1,087.00	2,282,700
フィード・ワン	2,200	750.00	1,650,000
東洋精糖	200	1,963.00	392,600
日本甜菜製糖	900	1,908.00	1,717,200
DM三井製糖ホールディングス	1,600	2,841.00	4,545,600
塩水港精糖	1,100	223.00	245,300
ウェルネオシュガー	800	2,065.00	1,652,000
森永製菓	3,300	4,994.00	16,480,200
中村屋	400	3,050.00	1,220,000
江崎グリコ	4,400	4,094.00	18,013,600
名糖産業	600	1,646.00	987,600
井村屋グループ	900	2,326.00	2,093,400
不二家	1,100	2,469.00	2,715,900
山崎製パン	10,400	3,152.00	32,780,800
第一屋製パン	100	697.00	69,700
モロゾフ	500	3,730.00	1,865,000
亀田製菓	900	3,925.00	3,532,500
寿スピリッツ	7,300	2,186.50	15,961,450
カルビー	7,100	2,731.00	19,390,100
森永乳業	5,600	2,649.00	14,834,400
六甲バター	1,100	1,318.00	1,449,800
ヤクルト本社	22,200	3,103.00	68,886,600
明治ホールディングス	19,000	3,302.00	62,738,000
雪印メグミルク	3,800	2,102.00	7,987,600
プリマハム	2,100	2,235.00	4,693,500
日本ハム	6,700	4,466.00	29,922,200
林兼産業	300	578.00	173,400
丸大食品	1,600	1,568.00	2,508,800
S Foods	1,700	3,270.00	5,559,000
柿安本店	600	2,417.00	1,450,200

伊藤ハム米久ホールディングス	2,400	3,765.00	9,036,000
サッポロホールディングス	5,100	5,798.00	29,569,800
アサヒグループホールディングス	35,900	5,315.00	190,808,500
麒麟ホールディングス	64,800	2,083.00	134,978,400
宝ホールディングス	10,600	1,188.00	12,592,800
オエノンホールディングス	4,500	362.00	1,629,000
養命酒製造	500	1,853.00	926,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	12,200	2,003.50	24,442,700
サントリー食品インターナショナル	10,900	4,633.00	50,499,700
ダイドーグループホールディングス	900	5,660.00	5,094,000
伊藤園	5,300	4,100.00	21,730,000
キーコーヒー	1,800	2,032.00	3,657,600
ユニカフェ	300	963.00	288,900
ジャパンフーズ	100	1,179.00	117,900
日清オイリオグループ	2,200	4,180.00	9,196,000
不二製油グループ本社	3,600	2,359.50	8,494,200
J-オイルミルズ	1,800	1,967.00	3,540,600
キッコーマン	10,300	8,688.00	89,486,400
味の素	36,900	5,083.00	187,562,700
ブルドックソース	800	2,089.00	1,671,200
キューピー	8,300	2,437.00	20,227,100
ハウス食品グループ本社	5,300	3,073.00	16,286,900
カゴメ	6,700	3,058.00	20,488,600
焼津水産化学工業	400	1,163.00	465,200
アリアケジャパン	1,600	4,480.00	7,168,000
ピエトロ	100	1,838.00	183,800
エバラ食品工業	400	2,821.00	1,128,400
やまみ	100	3,220.00	322,000
ニチレイ	7,100	3,542.00	25,148,200
東洋水産	7,900	7,223.00	57,061,700
イトアンドホールディングス	700	2,054.00	1,437,800
大冷	100	1,920.00	192,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	700	1,052.00	736,400
日清食品ホールディングス	5,500	14,365.00	79,007,500
永谷園ホールディングス	800	2,102.00	1,681,600

一正蒲鉾	300	730.00	219,000
フジッコ	1,600	1,895.00	3,032,000
ロック・フィールド	1,700	1,509.00	2,565,300
日本たばこ産業	94,400	3,715.00	350,696,000
ケンコーマヨネーズ	1,100	1,645.00	1,809,500
わらべや日洋ホールディングス	1,000	3,370.00	3,370,000
なとり	1,000	2,038.00	2,038,000
イフジ産業	200	1,358.00	271,600
ファーマフーズ	2,200	1,036.00	2,279,200
ユーグレナ	9,700	733.00	7,110,100
紀文食品	1,300	1,167.00	1,517,100
ピクルスホールディングス	900	1,194.00	1,074,600
ミヨシ油脂	300	1,351.00	405,300
理研ビタミン	1,300	2,184.00	2,839,200
片倉工業	1,500	1,645.00	2,467,500
グンゼ	1,100	5,140.00	5,654,000
東洋紡	6,900	1,026.00	7,079,400
ユニチカ	5,200	170.00	884,000
富士紡ホールディングス	700	3,575.00	2,502,500
倉敷紡績	1,200	2,469.00	2,962,800
シキボウ	700	1,064.00	744,800
日本毛織	4,200	1,257.00	5,279,400
ダイトウボウ	1,200	89.00	106,800
トーア紡コーポレーション	300	436.00	130,800
ダイドーリミテッド	1,200	422.00	506,400
帝国繊維	1,800	2,020.00	3,636,000
帝人	15,200	1,308.50	19,889,200
東レ	105,900	727.70	77,063,430
住江織物	200	2,098.00	419,600
日本フェルト	500	419.00	209,500
イチカワ	100	1,556.00	155,600
日東製網	100	1,486.00	148,600
アツギ	600	500.00	300,000
ダイニック	300	724.00	217,200
セーレン	3,000	2,471.00	7,413,000
ソトー	300	701.00	210,300

東海染工	100	912.00	91,200
小松マテーレ	2,300	734.00	1,688,200
ワコールホールディングス	3,200	3,364.00	10,764,800
ホギメディカル	2,100	3,545.00	7,444,500
クラウドディアホールディングス	100	375.00	37,500
T S I ホールディングス	5,200	764.00	3,972,800
マツオカコーポレーション	300	1,595.00	478,500
ワールド	2,300	1,696.00	3,900,800
三陽商会	500	2,687.00	1,343,500
ナイガイ	200	266.00	53,200
オンワードホールディングス	9,500	502.00	4,769,000
ルックホールディングス	400	2,520.00	1,008,000
ゴールドウイン	2,800	11,165.00	31,262,000
デザート	2,700	3,740.00	10,098,000
キング	300	680.00	204,000
ヤマトインターナショナル	600	294.00	176,400
特種東海製紙	900	3,785.00	3,406,500
王子ホールディングス	65,800	522.70	34,393,660
日本製紙	8,900	1,309.00	11,650,100
三菱製紙	1,200	515.00	618,000
北越コーポレーション	7,700	1,535.00	11,819,500
中越パルプ工業	300	1,763.00	528,900
大王製紙	7,000	1,103.50	7,724,500
阿波製紙	200	382.00	76,400
レンゴー	14,400	912.90	13,145,760
トーモク	900	2,073.00	1,865,700
ザ・パック	1,200	3,160.00	3,792,000
北の達人コーポレーション	6,600	198.00	1,306,800
クラレ	23,000	1,405.50	32,326,500
旭化成	106,900	1,017.50	108,770,750
共和レザー	500	712.00	356,000
巴川製紙所	200	922.00	184,400
レゾナック・ホールディングス	15,300	2,946.50	45,081,450
住友化学	117,300	333.50	39,119,550
住友精化	700	4,745.00	3,321,500
日産化学	7,400	5,063.00	37,466,200

ラサ工業	600	2,069.00	1,241,400	
クレハ	1,100	8,620.00	9,482,000	
多木化学	600	3,330.00	1,998,000	
テイカ	1,300	1,360.00	1,768,000	
石原産業	2,600	1,314.00	3,416,400	
片倉コープアグリ	200	1,092.00	218,400	
日本曹達	1,900	5,370.00	10,203,000	
東ソー	21,100	1,780.50	37,568,550	
トクヤマ	5,100	2,270.00	11,577,000	
セントラル硝子	1,700	2,643.00	4,493,100	
東亜合成	7,900	1,292.50	10,210,750	
大阪ソーダ	1,100	8,870.00	9,757,000	
関東電化工業	3,000	820.00	2,460,000	
デンカ	5,700	2,422.00	13,805,400	
信越化学工業	143,400	5,459.00	782,820,600	代用有価証券 24,000株
日本カーバイド工業	600	1,413.00	847,800	
堺化学工業	1,200	1,821.00	2,185,200	
第一稀元素化学工業	1,700	958.00	1,628,600	
エア・ウォーター	14,900	1,859.00	27,699,100	
日本酸素ホールディングス	15,300	3,769.00	57,665,700	
日本化学工業	600	1,870.00	1,122,000	
東邦アセチレン	200	1,934.00	386,800	
日本パーカライジング	7,100	1,110.00	7,881,000	
高压ガス工業	2,300	875.00	2,012,500	
四国化成ホールディングス	2,000	1,670.00	3,340,000	
戸田工業	400	1,586.00	634,400	
ステラ ケミファ	900	3,235.00	2,911,500	
保土谷化学工業	500	3,475.00	1,737,500	
日本触媒	2,400	5,269.00	12,645,600	
大日精化工業	1,100	2,474.00	2,721,400	
カネカ	4,000	3,538.00	14,152,000	
三菱瓦斯化学	11,800	2,209.50	26,072,100	
三井化学	13,000	4,214.00	54,782,000	
J S R	17,200	4,079.00	70,158,800	
東京応化工業	2,500	9,099.00	22,747,500	

大阪有機化学工業	1,300	2,637.00	3,428,100
三菱ケミカルグループ	115,700	942.10	109,000,970
KHネオケム	2,400	2,258.00	5,419,200
ダイセル	20,300	1,297.50	26,339,250
住友ベークライト	2,200	7,185.00	15,807,000
積水化学工業	32,000	2,022.00	64,704,000
日本ゼオン	10,800	1,327.50	14,337,000
アイカ工業	4,000	3,248.00	12,992,000
UBE	7,500	2,206.50	16,548,750
積水樹脂	2,400	2,475.00	5,940,000
タキロンシーアイ	4,000	620.00	2,480,000
旭有機材	1,100	3,825.00	4,207,500
ニチバン	800	1,698.00	1,358,400
リケンテクノス	3,300	776.00	2,560,800
大倉工業	700	2,688.00	1,881,600
積水化成成品工業	2,200	497.00	1,093,400
群栄化学工業	400	2,925.00	1,170,000
タイガースポリマー	400	807.00	322,800
ミライアル	300	1,476.00	442,800
ダイキアクシス	300	767.00	230,100
ダイキョーニシカワ	3,500	705.00	2,467,500
竹本容器	300	791.00	237,300
森六ホールディングス	900	2,803.00	2,522,700
恵和	1,100	1,224.00	1,346,400
日本化薬	12,100	1,305.00	15,790,500
カーリットホールディングス	1,700	907.00	1,541,900
日本精化	1,100	2,791.00	3,070,100
扶桑化学工業	1,700	4,140.00	7,038,000
トリケミカル研究所	1,900	3,645.00	6,925,500
ADEKA	5,500	2,756.00	15,158,000
日油	4,900	6,814.00	33,388,600
新日本理化	1,100	179.00	196,900
ハリマ化成グループ	900	781.00	702,900
花王	35,800	5,811.00	208,033,800
第一工業製薬	600	1,794.00	1,076,400
石原ケミカル	700	1,908.00	1,335,600

日華化学	400	933.00	373,200
ニイタカ	200	1,910.00	382,000
三洋化成工業	1,000	4,250.00	4,250,000
有機合成薬品工業	700	278.00	194,600
大日本塗料	1,700	999.00	1,698,300
日本ペイントホールディングス	83,900	1,116.00	93,632,400
関西ペイント	15,500	2,380.00	36,890,000
神東塗料	600	126.00	75,600
中国塗料	3,300	1,622.00	5,352,600
日本特殊塗料	600	1,172.00	703,200
藤倉化成	2,000	419.00	838,000
太陽ホールディングス	2,800	3,120.00	8,736,000
D I C	6,200	2,504.00	15,524,800
サカタインクス	3,500	1,312.00	4,592,000
東洋インキS Cホールディングス	3,400	2,671.00	9,081,400
T & K T O K A	1,500	1,435.00	2,152,500
富士フイルムホールディングス	29,400	8,578.00	252,193,200
資生堂	33,100	3,809.00	126,077,900
ライオン	20,700	1,305.00	27,013,500
高砂香料工業	1,200	3,355.00	4,026,000
マンダム	3,400	1,262.00	4,290,800
ミルボン	2,200	3,471.00	7,636,200
ファンケル	6,900	2,275.50	15,700,950
コーセー	3,200	10,645.00	34,064,000
コタ	1,400	1,521.00	2,129,400
ポーラ・オルビスホールディングス	8,100	1,588.00	12,862,800
ノエビアホールディングス	1,400	5,020.00	7,028,000
アジュバンホールディングス	200	919.00	183,800
新日本製薬	900	1,637.00	1,473,300
I - n e	300	2,292.00	687,600
アクシージア	800	956.00	764,800
エステー	1,200	1,499.00	1,798,800
アグロ カネショウ	600	1,496.00	897,600
コニシ	2,300	2,542.00	5,846,600
長谷川香料	3,000	3,215.00	9,645,000
小林製薬	4,600	6,562.00	30,185,200

荒川化学工業	1,300	1,024.00	1,331,200
メック	1,300	4,275.00	5,557,500
日本高純度化学	400	2,366.00	946,400
タカラバイオ	4,300	1,199.00	5,155,700
JCU	1,800	3,580.00	6,444,000
新田ゼラチン	600	757.00	454,200
OATアグリオ	500	1,744.00	872,000
デクセリアルズ	4,000	4,145.00	16,580,000
アース製薬	1,400	4,625.00	6,475,000
北興化学工業	1,600	941.00	1,505,600
大成ラミック	500	2,752.00	1,376,000
クミアイ化学工業	6,300	809.00	5,096,700
日本農薬	2,800	632.00	1,769,600
アキレス	1,000	1,554.00	1,554,000
有沢製作所	2,800	1,055.00	2,954,000
日東電工	10,200	9,931.00	101,296,200
レック	2,000	1,050.00	2,100,000
三光合成	2,000	502.00	1,004,000
きもと	1,300	184.00	239,200
藤森工業	1,300	3,775.00	4,907,500
前澤化成工業	1,000	1,527.00	1,527,000
未来工業	600	3,070.00	1,842,000
ウェーブロックホールディングス	300	631.00	189,300
JSP	1,100	1,762.00	1,938,200
エフピコ	3,000	2,871.00	8,613,000
天馬	1,100	2,254.00	2,479,400
信越ポリマー	3,400	1,541.00	5,239,400
東リ	2,200	325.00	715,000
ニフコ	4,700	3,492.00	16,412,400
バルカー	1,300	3,885.00	5,050,500
ユニ・チャーム	33,000	4,883.00	161,139,000
ショーエイコーポレーション	300	573.00	171,900
協和キリン	19,100	2,412.00	46,069,200
武田薬品工業	140,100	3,995.00	559,699,500
アステラス製薬	138,900	1,614.00	224,184,600
住友ファーマ	11,700	423.00	4,949,100

塩野義製薬	20,000	7,022.00	140,440,000
わかもと製薬	1,000	191.00	191,000
日本新薬	4,100	4,868.00	19,958,800
中外製薬	49,600	5,344.00	265,062,400
科研製薬	2,700	3,191.00	8,615,700
エーザイ	19,300	7,207.00	139,095,100
ロート製薬	15,300	2,805.00	42,916,500
小野薬品工業	33,600	2,542.00	85,411,200
久光製薬	3,500	4,467.00	15,634,500
持田製薬	1,800	3,255.00	5,859,000
参天製薬	28,800	1,334.00	38,419,200
扶桑薬品工業	600	1,864.00	1,118,400
日本ケミファ	100	1,617.00	161,700
ツムラ	5,000	2,600.50	13,002,500
キッセイ薬品工業	2,600	3,080.00	8,008,000
生化学工業	2,600	741.00	1,926,600
栄研化学	3,100	1,705.00	5,285,500
鳥居薬品	800	3,435.00	2,748,000
JCRファーマ	5,400	1,152.00	6,220,800
東和薬品	2,400	2,289.00	5,493,600
富士製薬工業	1,200	1,628.00	1,953,600
ゼリア新薬工業	2,200	1,948.00	4,285,600
そーせいグループ	5,100	1,425.00	7,267,500
第一三共	137,900	4,005.00	552,289,500
杏林製薬	3,400	1,743.00	5,926,200
大幸薬品	3,200	287.00	918,400
ダイト	1,200	1,906.00	2,287,200
大塚ホールディングス	32,900	5,230.00	172,067,000
大正製薬ホールディングス	3,500	8,620.00	30,170,000
ペプチドリーム	7,700	1,223.00	9,417,100
セルソース	400	1,664.00	665,600
あすか製薬ホールディングス	1,600	1,744.00	2,790,400
サワイグループホールディングス	3,600	4,952.00	17,827,200
日本コークス工業	15,700	119.00	1,868,300
ニチレキ	2,100	2,385.00	5,008,500
ユシロ化学工業	800	1,581.00	1,264,800

ビーピー・カストロール	300	887.00	266,100
富士石油	4,500	336.00	1,512,000
MORESCO	300	1,249.00	374,700
出光興産	17,600	3,849.00	67,742,400
ENEOSホールディングス	250,600	584.10	146,375,460
コスモエネルギーホールディングス	4,700	5,484.00	25,774,800
横浜ゴム	8,000	3,149.00	25,192,000
TOYO TIRE	9,100	2,358.00	21,457,800
ブリヂストン	46,300	5,941.00	275,068,300
住友ゴム工業	15,500	1,608.00	24,924,000
藤倉コンポジット	1,100	1,340.00	1,474,000
オカモト	700	5,030.00	3,521,000
フコク	800	1,327.00	1,061,600
ニッタ	1,600	3,685.00	5,896,000
住友理工	2,400	1,000.00	2,400,000
三ツ星ベルト	1,900	4,360.00	8,284,000
バンドー化学	2,400	1,530.00	3,672,000
日東紡績	2,000	4,285.00	8,570,000
AGC	14,100	5,363.00	75,618,300
日本板硝子	7,600	552.00	4,195,200
石塚硝子	100	3,595.00	359,500
日本山村硝子	300	1,381.00	414,300
日本電気硝子	6,500	3,108.00	20,202,000
オハラ	700	1,109.00	776,300
住友大阪セメント	2,600	3,628.00	9,432,800
太平洋セメント	9,400	2,736.00	25,718,400
日本ヒューム	1,400	863.00	1,208,200
日本コンクリート工業	3,100	314.00	973,400
三谷セキサン	700	4,505.00	3,153,500
アジアパイルホールディングス	2,200	683.00	1,502,600
東海カーボン	14,600	1,036.00	15,125,600
日本カーボン	800	4,580.00	3,664,000
東洋炭素	1,100	4,590.00	5,049,000
ノリタケカンパニーリミテド	900	6,640.00	5,976,000
TOTO	10,400	3,633.00	37,783,200
日本碍子	18,400	1,699.00	31,261,600

日本特殊陶業	13,300	3,319.00	44,142,700
ダントーホールディングス	500	922.00	461,000
MARUWA	600	26,800.00	16,080,000
品川リフラクトリーズ	2,000	1,655.00	3,310,000
黒崎播磨	300	10,620.00	3,186,000
ヨータイ	1,000	1,501.00	1,501,000
東京窯業	800	425.00	340,000
ニッカトー	300	551.00	165,300
フジミインコーポレーテッド	4,300	2,675.00	11,502,500
クニミネ工業	200	973.00	194,600
エーアンドエーマテリアル	200	1,261.00	252,200
ニチアス	4,000	3,255.00	13,020,000
ニチハ	2,000	2,880.00	5,760,000
日本製鉄	72,900	3,274.00	238,674,600
神戸製鋼所	32,800	1,677.00	55,005,600
合同製鐵	900	4,370.00	3,933,000
JFEホールディングス	45,300	2,139.00	96,896,700
東京製鐵	4,600	1,742.00	8,013,200
共英製鋼	1,900	1,996.00	3,792,400
大和工業	3,100	7,262.00	22,512,200
東京鐵鋼	700	3,855.00	2,698,500
大阪製鐵	800	2,200.00	1,760,000
淀川製鋼所	1,900	3,735.00	7,096,500
中部鋼鈹	1,100	2,009.00	2,209,900
丸一鋼管	5,000	3,744.00	18,720,000
モリ工業	300	4,155.00	1,246,500
大同特殊鋼	2,100	7,105.00	14,920,500
日本高周波鋼業	500	537.00	268,500
日本冶金工業	1,200	4,105.00	4,926,000
山陽特殊製鋼	1,600	2,845.00	4,552,000
愛知製鋼	1,000	3,080.00	3,080,000
日本金属	400	864.00	345,600
大平洋金属	1,400	1,208.00	1,691,200
新日本電工	8,300	279.00	2,315,700
栗本鐵工所	800	3,055.00	2,444,000
缸技	200	1,135.00	227,000

日本鋳鉄管	200	1,097.00	219,400
三菱製鋼	1,300	1,430.00	1,859,000
日亜鋼業	1,200	312.00	374,400
日本精線	300	4,740.00	1,422,000
エンビプロ・ホールディングス	1,100	593.00	652,300
シンニッタン	1,500	253.00	379,500
新家工業	200	2,797.00	559,400
大紀アルミニウム工業所	2,000	1,174.00	2,348,000
日本軽金属ホールディングス	4,800	1,670.00	8,016,000
三井金属鉱業	4,700	4,319.00	20,299,300
東邦亜鉛	1,100	1,109.00	1,219,900
三菱マテリアル	11,600	2,499.50	28,994,200
住友金属鉱山	18,900	4,238.00	80,098,200
DOWAホールディングス	4,000	5,062.00	20,248,000
古河機械金属	2,200	1,857.00	4,085,400
エス・サイエンス	5,200	21.00	109,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,800	2,725.00	7,630,000
東邦チタニウム	3,400	1,880.00	6,392,000
UACJ	2,300	3,785.00	8,705,500
CKサンエツ	400	3,695.00	1,478,000
古河電気工業	5,400	2,217.50	11,974,500
住友電気工業	61,000	1,764.00	107,604,000
フジクラ	19,200	1,053.50	20,227,200
SWCC	1,800	2,627.00	4,728,600
タツタ電線	2,900	681.00	1,974,900
カナレ電気	100	1,553.00	155,300
平河ヒューテック	1,100	1,271.00	1,398,100
リョービ	1,700	2,603.00	4,425,100
アーレスティ	1,000	712.00	712,000
AREホールディングス	6,100	1,884.00	11,492,400
稲葉製作所	800	1,510.00	1,208,000
宮地エンジニアリンググループ	800	3,165.00	2,532,000
トーカロ	4,700	1,429.00	6,716,300
アルファC o	300	1,380.00	414,000
SUMCO	28,900	2,188.00	63,233,200
川田テクノロジーズ	400	6,370.00	2,548,000

RS Technologies	1,100	2,854.00	3,139,400
ジェイテックコーポレーション	100	1,800.00	180,000
信和	600	736.00	441,600
東洋製罐グループホールディングス	9,700	2,191.50	21,257,550
ホッカンホールディングス	800	1,626.00	1,300,800
コロナ	900	946.00	851,400
横河ブリッジホールディングス	2,600	2,581.00	6,710,600
駒井ハルテック	200	2,031.00	406,200
高田機工	100	3,335.00	333,500
三和ホールディングス	16,300	2,149.00	35,028,700
文化シャッター	4,300	1,346.00	5,787,800
三協立山	1,800	790.00	1,422,000
アルインコ	1,200	986.00	1,183,200
東洋シャッター	200	615.00	123,000
LIXIL	25,400	1,730.50	43,954,700
日本ファイルコン	600	463.00	277,800
ノーリツ	2,700	1,524.00	4,114,800
長府製作所	1,600	2,042.00	3,267,200
リンナイ	8,000	3,205.00	25,640,000
ダイニチ工業	500	712.00	356,000
日東精工	2,400	532.00	1,276,800
三洋工業	100	2,468.00	246,800
岡部	2,900	714.00	2,070,600
ジーテクト	2,100	1,639.00	3,441,900
東プレ	2,900	1,946.00	5,643,400
高周波熱錬	2,500	964.00	2,410,000
東京製綱	1,000	1,300.00	1,300,000
サンコール	1,300	443.00	575,900
モリテック スチール	800	282.00	225,600
パイオラックス	2,000	2,154.00	4,308,000
エイチワン	1,700	760.00	1,292,000
日本発條	14,400	1,109.00	15,969,600
中央発條	1,200	690.00	828,000
アドバネクス	100	870.00	87,000
立川ブラインド工業	700	1,438.00	1,006,600
三益半導体工業	1,300	2,764.00	3,593,200

日本ドライケミカル	200	2,654.00	530,800
日本製鋼所	4,400	2,466.00	10,850,400
三浦工業	6,600	2,806.00	18,519,600
タクマ	5,400	1,740.00	9,396,000
ツガミ	3,500	1,195.00	4,182,500
オークマ	1,400	5,918.00	8,285,200
芝浦機械	1,600	3,610.00	5,776,000
アマダ	25,400	1,477.00	37,515,800
アイダエンジニアリング	3,600	839.00	3,020,400
F U J I	7,500	2,456.00	18,420,000
牧野フライス製作所	1,800	5,870.00	10,566,000
オーエスジー	7,000	1,972.50	13,807,500
ダイジェット工業	100	848.00	84,800
旭ダイヤモンド工業	3,800	829.00	3,150,200
DMG森精機	9,600	2,546.00	24,441,600
ソディック	3,900	729.00	2,843,100
ディスコ	7,700	32,930.00	253,561,000
日東工器	800	1,815.00	1,452,000
日進工具	1,500	987.00	1,480,500
パンチ工業	900	399.00	359,100
富士ダイス	900	636.00	572,400
豊和工業	500	739.00	369,500
リケンNPR	1,700	1,919.00	3,262,300
東洋機械金属	800	662.00	529,600
島精機製作所	2,500	1,506.00	3,765,000
オプトラン	2,600	1,687.00	4,386,200
NCホールディングス	200	1,785.00	357,000
イワキポンプ	1,100	2,062.00	2,268,200
フリー	1,500	1,421.00	2,131,500
ヤマシンフィルタ	3,900	320.00	1,248,000
日阪製作所	1,700	937.00	1,592,900
やまびこ	2,600	1,512.00	3,931,200
野村マイクロ・サイエンス	500	12,470.00	6,235,000
平田機工	800	6,010.00	4,808,000
PEGASUS	1,800	447.00	804,600
マルマエ	700	1,855.00	1,298,500

タツモ	1,000	2,607.00	2,607,000
ナブテスコ	10,000	2,797.50	27,975,000
三井海洋開発	2,000	1,896.00	3,792,000
レオン自動機	1,800	1,431.00	2,575,800
SMC	4,800	73,040.00	350,592,000
ホソカワミクロン	1,000	4,215.00	4,215,000
ユニオンツール	700	3,235.00	2,264,500
瑞光	1,200	1,350.00	1,620,000
オイレス工業	2,200	1,908.00	4,197,600
日精エー・エス・ビー機械	600	4,450.00	2,670,000
サトーホールディングス	2,300	1,983.00	4,560,900
技研製作所	1,500	1,741.00	2,611,500
日本エアータック	800	1,338.00	1,070,400
カワタ	300	1,008.00	302,400
日精樹脂工業	1,200	1,110.00	1,332,000
オカダアイヨン	300	2,254.00	676,200
ワイエイシイホールディングス	500	2,210.00	1,105,000
小松製作所	74,700	3,643.00	272,132,100
住友重機械工業	9,400	3,534.00	33,219,600
日立建機	6,300	3,651.00	23,001,300
日工	2,400	654.00	1,569,600
巴工業	600	3,305.00	1,983,000
井関農機	1,500	1,104.00	1,656,000
TOWA	1,800	6,840.00	12,312,000
丸山製作所	200	2,440.00	488,000
北川鉄工所	600	1,231.00	738,600
ローツェ	800	14,090.00	11,272,000
タカキタ	300	499.00	149,700
クボタ	83,700	2,086.00	174,598,200
荏原実業	800	2,875.00	2,300,000
三菱化工機	600	2,910.00	1,746,000
月島ホールディングス	2,200	1,275.00	2,805,000
帝国電機製作所	1,100	2,979.00	3,276,900
新東工業	3,200	1,098.00	3,513,600
澁谷工業	1,500	2,419.00	3,628,500
アイチ コーポレーション	2,200	1,067.00	2,347,400

小森コーポレーション	3,900	1,092.00	4,258,800
鶴見製作所	1,200	3,605.00	4,326,000
酒井重工業	200	5,790.00	1,158,000
荏原製作所	6,500	7,898.00	51,337,000
石井鐵工所	100	2,692.00	269,200
西島製作所	1,400	2,168.00	3,035,200
北越工業	1,600	2,404.00	3,846,400
ダイキン工業	19,000	22,335.00	424,365,000
オルガノ	1,900	5,330.00	10,127,000
トーヨーカネツ	600	3,760.00	2,256,000
栗田工業	8,900	5,455.00	48,549,500
椿本チエイン	2,200	3,945.00	8,679,000
大同工業	400	726.00	290,400
木村化工機	1,300	743.00	965,900
アネスト岩田	2,500	1,073.00	2,682,500
ダイフク	26,900	2,841.00	76,422,900
サムコ	400	3,940.00	1,576,000
加藤製作所	500	1,249.00	624,500
油研工業	200	2,092.00	418,400
タダノ	9,100	1,093.50	9,950,850
フジテック	3,700	3,597.00	13,308,900
CKD	4,400	2,484.00	10,929,600
平和	4,700	2,051.00	9,639,700
理想科学工業	1,300	2,638.00	3,429,400
SANKYO	3,900	7,920.00	30,888,000
日本金銭機械	1,900	1,315.00	2,498,500
マースグループホールディングス	800	2,351.00	1,880,800
フクシマガリレイ	1,000	4,850.00	4,850,000
オーイズミ	400	390.00	156,000
ダイコク電機	800	3,155.00	2,524,000
竹内製作所	2,900	4,095.00	11,875,500
アマノ	4,500	3,285.00	14,782,500
JUKI	2,500	482.00	1,205,000
サンデン	1,400	157.00	219,800
ジャノメ	1,600	680.00	1,088,000
マックス	2,300	2,964.00	6,817,200

グローリー	3,800	2,857.00	10,856,600	
新晃工業	1,600	2,512.00	4,019,200	
大和冷機工業	2,400	1,455.00	3,492,000	
セガサミーホールディングス	14,200	1,971.50	27,995,300	
T P R	2,000	1,551.00	3,102,000	
ツバキ・ナカシマ	3,200	702.00	2,246,400	
ホシザキ	9,400	4,909.00	46,144,600	
大豊工業	1,400	810.00	1,134,000	
日本精工	29,500	748.20	22,071,900	
N T N	34,400	260.70	8,968,080	
ジェイテクト	14,200	1,197.50	17,004,500	
不二越	1,200	3,595.00	4,314,000	
日本トムソン	4,300	583.00	2,506,900	
THK	9,200	2,879.50	26,491,400	
ユーシン精機	1,300	666.00	865,800	
前澤給装工業	1,200	1,265.00	1,518,000	
イーグル工業	1,800	1,583.00	2,849,400	
前澤工業	500	914.00	457,000	
日本ピラー工業	1,500	4,265.00	6,397,500	
キット	5,400	1,156.00	6,242,400	
マキタ	18,200	3,862.00	70,288,400	
三井E & S	7,700	617.00	4,750,900	
日立造船	14,000	920.00	12,880,000	
三菱重工業	27,900	7,612.00	212,374,800	
I H I	11,800	2,615.50	30,862,900	
サノヤスホールディングス	1,500	136.00	204,000	
スター精密	3,000	1,767.00	5,301,000	
日清紡ホールディングス	12,000	1,077.50	12,930,000	
イビデン	8,300	7,599.00	63,071,700	
コニカミノルタ	35,600	432.80	15,407,680	
ブラザー工業	21,300	2,454.00	52,270,200	
ミネベアミツミ	27,700	2,847.00	78,861,900	
日立製作所	76,600	9,859.00	755,199,400	代用有価証券 12,000株
三菱電機	177,400	2,033.00	360,654,200	
富士電機	9,700	5,968.00	57,889,600	

東洋電機製造	300	938.00	281,400
安川電機	17,300	5,689.00	98,419,700
シンフォニアテクノロジー	1,800	2,157.00	3,882,600
明電舎	3,000	2,409.00	7,227,000
オリジン	200	1,200.00	240,000
山洋電気	700	6,020.00	4,214,000
デンヨー	1,200	2,159.00	2,590,800
PHCホールディングス	3,000	1,421.00	4,263,000
KOKUSAI ELECTRIC	6,100	3,095.00	18,879,500
ソシオネクスト	2,300	11,140.00	25,622,000
東芝テック	2,000	2,799.00	5,598,000
芝浦メカトロニクス	900	6,340.00	5,706,000
マブチモーター	4,000	4,713.00	18,852,000
ニデック	35,200	5,588.00	196,697,600
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,000	361.00	361,000
トレックス・セミコンダクター	800	1,824.00	1,459,200
東光高岳	1,000	2,038.00	2,038,000
ダブル・スコープ	4,600	972.00	4,471,200
ダイヘン	1,600	6,200.00	9,920,000
ヤーマン	2,800	946.00	2,648,800
JVCケンウッド	12,600	770.00	9,702,000
ミマキエンジニアリング	1,500	911.00	1,366,500
I-PEX	1,100	1,475.00	1,622,500
大崎電気工業	3,400	626.00	2,128,400
オムロン	12,200	6,298.00	76,835,600
日東工業	2,200	3,470.00	7,634,000
IDEC	2,400	2,803.00	6,727,200
正興電機製作所	300	1,116.00	334,800
不二電機工業	200	1,148.00	229,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6,200	1,940.50	12,031,100
サクサホールディングス	200	2,578.00	515,600
メルコホールディングス	500	3,400.00	1,700,000
テクノメディカ	400	2,300.00	920,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	600	680.00	408,000
日本電気	20,900	8,131.00	169,937,900
富士通	14,700	20,735.00	304,804,500

沖電気工業	7,200	895.00	6,444,000
岩崎通信機	400	771.00	308,400
電気興業	700	2,302.00	1,611,400
サンケン電気	1,500	8,090.00	12,135,000
ナカヨ	100	1,202.00	120,200
アイホン	900	2,639.00	2,375,100
ルネサスエレクトロニクス	104,100	2,520.00	262,332,000
セイコーエプソン	20,400	2,038.00	41,575,200
ワコム	12,200	668.00	8,149,600
アルバック	3,800	6,631.00	25,197,800
アクセル	600	2,101.00	1,260,600
E I Z O	1,200	4,785.00	5,742,000
日本信号	3,600	950.00	3,420,000
京三製作所	3,300	462.00	1,524,600
能美防災	2,200	1,973.00	4,340,600
ホーチキ	1,200	1,592.00	1,910,400
星和電機	400	481.00	192,400
エレコム	3,800	1,785.00	6,783,000
パナソニック ホールディングス	188,400	1,367.50	257,637,000
シャープ	26,800	1,042.00	27,925,600
アンリツ	11,200	1,322.00	14,806,400
富士通ゼネラル	4,500	2,101.50	9,456,750
ソニーグループ	111,600	13,365.00	1,491,534,000
TDK	25,300	6,575.00	166,347,500
帝国通信工業	700	1,850.00	1,295,000
タムラ製作所	6,400	549.00	3,513,600
アルプスアルパイン	14,200	1,213.00	17,224,600
池上通信機	200	856.00	171,200
日本電波工業	1,900	1,135.00	2,156,500
鈴木	900	1,148.00	1,033,200
メイコー	1,600	4,035.00	6,456,000
日本トリム	400	3,060.00	1,224,000
ローランド ディー. ジー.	900	3,645.00	3,280,500
フォスター電機	1,200	986.00	1,183,200
SMK	400	2,496.00	998,400
ヨコオ	1,400	1,426.00	1,996,400

ホシデン	3,600	1,657.00	5,965,200
ヒロセ電機	2,300	16,250.00	37,375,000
日本航空電子工業	3,800	3,045.00	11,571,000
TOA	1,800	999.00	1,798,200
マクセル	3,500	1,576.00	5,516,000
古野電気	2,100	1,633.00	3,429,300
スミダコーポレーション	2,100	1,164.00	2,444,400
アイコム	600	3,240.00	1,944,000
リオン	700	2,228.00	1,559,600
横河電機	17,400	2,742.00	47,710,800
新電元工業	600	3,040.00	1,824,000
アズビル	10,900	4,688.00	51,099,200
東亜ディーケーケー	400	880.00	352,000
日本光電工業	6,800	3,747.00	25,479,600
チノー	700	2,031.00	1,421,700
共和電業	700	404.00	282,800
日本電子材料	1,000	1,644.00	1,644,000
堀場製作所	3,000	10,560.00	31,680,000
アドバンテスト	45,200	4,845.00	218,994,000
小野測器	300	447.00	134,100
エスベック	1,300	2,261.00	2,939,300
キーエンス	15,800	62,500.00	987,500,000
日置電機	800	6,200.00	4,960,000
シスメックス	13,600	7,829.00	106,474,400
日本マイクロニクス	2,800	3,470.00	9,716,000
メガチップス	1,300	4,485.00	5,830,500
OBARA GROUP	900	3,700.00	3,330,000
澤藤電機	100	1,197.00	119,700
原田工業	400	756.00	302,400
コーセル	1,900	1,275.00	2,422,500
イリソ電子工業	1,500	3,680.00	5,520,000
オブテックスグループ	2,900	1,700.00	4,930,000
千代田インテグレ	600	2,978.00	1,786,800
レーザーテック	7,200	32,700.00	235,440,000
スタンレー電気	10,100	2,647.50	26,739,750
ウシオ電機	8,000	2,151.00	17,208,000

岡谷電機産業	600	284.00	170,400
ヘリオス テクノ ホールディング	800	509.00	407,200
エノモト	200	1,547.00	309,400
日本セラミック	1,300	2,851.00	3,706,300
遠藤照明	400	1,165.00	466,000
古河電池	1,200	846.00	1,015,200
双信電機	300	310.00	93,000
山一電機	1,400	1,831.00	2,563,400
図研	1,400	3,940.00	5,516,000
日本電子	3,900	6,098.00	23,782,200
カシオ計算機	11,400	1,204.00	13,725,600
ファナック	77,000	4,111.00	316,547,000
日本シイエムケイ	3,300	742.00	2,448,600
エンプラス	500	11,830.00	5,915,000
大真空	2,400	850.00	2,040,000
ローム	29,200	2,900.00	84,680,000
浜松ホトニクス	12,700	5,728.00	72,745,600
三井ハイテック	1,400	7,827.00	10,957,800
新光電気工業	5,600	5,421.00	30,357,600
京セラ	24,500	8,095.00	198,327,500
太陽誘電	7,700	3,602.00	27,735,400
村田製作所	143,600	2,822.00	405,239,200
双葉電子工業	2,900	518.00	1,502,200
北陸電気工業	300	1,323.00	396,900
ニチコン	4,200	1,333.00	5,598,600
日本ケミコン	1,600	1,320.00	2,112,000
KOA	2,400	1,547.00	3,712,800
市光工業	2,800	546.00	1,528,800
小糸製作所	17,100	2,257.00	38,594,700
ミツバ	2,900	913.00	2,647,700
S C R E E Nホールディングス	5,400	11,225.00	60,615,000
キヤノン電子	1,800	2,011.00	3,619,800
キヤノン	78,700	3,631.00	285,759,700
リコー	39,500	1,085.50	42,877,250
象印マホービン	4,300	1,506.00	6,475,800
MUTOHホールディングス	100	1,904.00	190,400

東京エレクトロン	33,400	24,370.00	813,958,000	
イノテック	1,100	1,587.00	1,745,700	
トヨタ紡織	6,600	2,229.00	14,711,400	
芦森工業	200	2,011.00	402,200	
ユニプレス	2,800	940.00	2,632,000	
豊田自動織機	13,500	11,515.00	155,452,500	
モリタホールディングス	2,800	1,464.00	4,099,200	
三櫻工業	2,400	768.00	1,843,200	
デンソー	130,300	2,089.50	272,261,850	
東海理化電機製作所	4,400	2,165.00	9,526,000	
川崎重工業	12,900	2,938.00	37,900,200	
名村造船所	3,500	994.00	3,479,000	
日本車輛製造	500	2,094.00	1,047,000	
三菱ロジスネクスト	2,500	1,411.00	3,527,500	
近畿車輛	100	1,736.00	173,600	
日産自動車	224,400	550.50	123,532,200	
いすゞ自動車	45,900	1,823.50	83,698,650	
トヨタ自動車	866,600	2,600.50	2,253,593,300	代用有価証券 45,000株
日野自動車	23,700	462.30	10,956,510	
三菱自動車工業	61,500	436.60	26,850,900	
エフテック	600	634.00	380,400	
レシップホールディングス	300	555.00	166,500	
GMB	100	1,161.00	116,100	
ファルテック	100	535.00	53,500	
武蔵精密工業	3,900	1,413.00	5,510,700	
日産車体	1,800	910.00	1,638,000	
新明和工業	4,600	1,114.00	5,124,400	
極東開発工業	2,600	1,899.00	4,937,400	
トピー工業	1,300	2,471.00	3,212,300	
ティラド	400	2,966.00	1,186,400	
タチエス	2,900	1,663.00	4,822,700	
NOK	6,100	1,873.50	11,428,350	
フタバ産業	4,300	762.00	3,276,600	
カヤバ	1,500	4,730.00	7,095,000	
大同メタル工業	3,000	550.00	1,650,000	

プレス工業	6,400	576.00	3,686,400
ミクニ	1,100	442.00	486,200
太平洋工業	3,700	1,306.00	4,832,200
アイシン	12,200	4,951.00	60,402,200
マツダ	52,200	1,509.00	78,769,800
今仙電機製作所	500	610.00	305,000
本田技研工業	384,900	1,424.00	548,097,600
スズキ	29,000	5,565.00	161,385,000
S U B A R U	50,000	2,560.00	128,000,000
安永	300	658.00	197,400
ヤマハ発動機	22,700	3,764.00	85,442,800
T B K	900	370.00	333,000
エクセディ	2,600	2,418.00	6,286,800
豊田合成	4,600	2,597.00	11,946,200
愛三工業	2,600	1,173.00	3,049,800
盟和産業	100	974.00	97,400
日本プラスト	700	523.00	366,100
ヨロズ	1,500	851.00	1,276,500
エフ・シー・シー	2,800	1,742.00	4,877,600
シマノ	6,400	21,525.00	137,760,000
テイ・エス テック	5,600	1,684.00	9,430,400
ジャムコ	700	1,491.00	1,043,700
テルモ	44,100	4,647.00	204,932,700
クリエートメディック	300	906.00	271,800
日機装	3,700	972.00	3,596,400
日本エム・ディ・エム	1,200	744.00	892,800
島津製作所	21,000	3,867.00	81,207,000
J M S	1,500	503.00	754,500
長野計器	1,100	1,933.00	2,126,300
ブイ・テクノロジー	800	2,716.00	2,172,800
東京計器	1,200	1,671.00	2,005,200
愛知時計電機	700	2,179.00	1,525,300
インターアクション	800	967.00	773,600
オーバル	800	455.00	364,000
東京精密	3,200	8,537.00	27,318,400
マニー	6,300	2,209.50	13,919,850

ニコン	22,800	1,395.00	31,806,000
トプコン	7,700	1,528.00	11,765,600
オリンパス	97,200	2,110.00	205,092,000
理研計器	1,100	6,820.00	7,502,000
タムロン	1,000	5,100.00	5,100,000
HOYA	31,400	16,990.00	533,486,000
シード	400	804.00	321,600
ノーリツ鋼機	1,500	2,833.00	4,249,500
A&Dホロンホールディングス	2,300	1,810.00	4,163,000
朝日インテック	17,600	2,780.00	48,928,000
シチズン時計	14,500	814.00	11,803,000
リズム	200	2,930.00	586,000
大研医器	800	494.00	395,200
メニコン	5,400	2,337.50	12,622,500
シンシア	100	542.00	54,200
松風	700	2,699.00	1,889,300
セイコーグループ	2,200	2,584.00	5,684,800
ニプロ	13,100	1,134.50	14,861,950
KYORITSU	1,300	173.00	224,900
中本パックス	300	1,622.00	486,600
スノーピーク	2,200	906.00	1,993,200
パラマウントベッドホールディングス	3,300	2,739.00	9,038,700
トランザクション	1,000	2,064.00	2,064,000
粧美堂	200	635.00	127,000
ニホンフラッシュ	1,500	897.00	1,345,500
前田工織	1,300	2,985.00	3,880,500
永大産業	1,000	223.00	223,000
アートネイチャー	1,400	771.00	1,079,400
バンダイナムコホールディングス	43,300	2,725.50	118,014,150
アイフィスジャパン	200	632.00	126,400
SHOEI	3,600	1,817.00	6,541,200
フランスベッドホールディングス	2,000	1,288.00	2,576,000
パイロットコーポレーション	2,200	4,138.00	9,103,600
萩原工業	1,000	1,421.00	1,421,000
フジシールインターナショナル	3,200	1,682.00	5,382,400
タカラトミー	7,200	2,130.50	15,339,600

広済堂ホールディングス	3,500	729.00	2,551,500	
エステールホールディングス	200	629.00	125,800	
タカノ	300	887.00	266,100	
プロネクス	1,600	1,272.00	2,035,200	
ホクシン	600	110.00	66,000	
ウッドワン	300	1,012.00	303,600	
TOPPANホールディングス	19,400	3,781.00	73,351,400	
大日本印刷	17,200	4,215.00	72,498,000	
共同印刷	400	3,360.00	1,344,000	
N I S S H A	2,700	1,480.00	3,996,000	
光村印刷	100	1,316.00	131,600	
TAKARA & COMPANY	1,000	2,510.00	2,510,000	
アシックス	13,400	4,528.00	60,675,200	
ツツミ	400	2,172.00	868,800	
ローランド	1,200	4,325.00	5,190,000	
小松ウオール工業	600	2,814.00	1,688,400	
ヤマハ	9,900	3,238.00	32,056,200	
河合楽器製作所	500	3,560.00	1,780,000	
クリナップ	1,500	665.00	997,500	
ビジョン	10,100	1,605.00	16,210,500	
キングジム	1,400	865.00	1,211,000	
リンテック	3,200	2,609.00	8,348,800	
イトーキ	3,200	1,249.00	3,996,800	
任天堂	99,700	6,778.00	675,766,600	代用有価証券 18,000株
三菱鉛筆	2,300	2,026.00	4,659,800	
タカラスタンダード	3,300	1,734.00	5,722,200	
コクヨ	6,500	2,290.50	14,888,250	
ナカバヤシ	1,700	535.00	909,500	
グローブライド	1,400	1,936.00	2,710,400	
オカムラ	4,700	2,053.00	9,649,100	
美津濃	1,600	3,840.00	6,144,000	
東京電力ホールディングス	142,400	751.90	107,070,560	
中部電力	58,200	1,890.00	109,998,000	
関西電力	61,000	1,944.50	118,614,500	
中国電力	27,400	1,023.50	28,043,900	

北陸電力	16,100	731.10	11,770,710
東北電力	41,500	972.60	40,362,900
四国電力	14,700	1,018.50	14,971,950
九州電力	36,300	1,025.00	37,207,500
北海道電力	15,300	645.80	9,880,740
沖縄電力	4,000	1,118.00	4,472,000
電源開発	12,900	2,269.00	29,270,100
エフオン	1,100	459.00	504,900
イーレックス	2,800	637.00	1,783,600
レノバ	4,200	1,110.00	4,662,000
東京瓦斯	33,400	3,533.00	118,002,200
大阪瓦斯	32,000	2,898.50	92,752,000
東邦瓦斯	6,800	2,724.00	18,523,200
北海道瓦斯	900	2,151.00	1,935,900
広島ガス	3,400	368.00	1,251,200
西部ガスホールディングス	1,600	1,912.00	3,059,200
静岡ガス	3,100	1,012.00	3,137,200
メタウォーター	1,900	2,036.00	3,868,400
SBSホールディングス	1,400	2,505.00	3,507,000
東武鉄道	17,300	3,793.00	65,618,900
相鉄ホールディングス	5,700	2,730.50	15,563,850
東急	44,300	1,722.50	76,306,750
京浜急行電鉄	19,500	1,296.50	25,281,750
小田急電鉄	26,100	2,236.00	58,359,600
京王電鉄	7,600	4,395.00	33,402,000
京成電鉄	10,200	6,550.00	66,810,000
富士急行	1,900	4,220.00	8,018,000
東日本旅客鉄道	29,000	8,225.00	238,525,000
西日本旅客鉄道	18,700	5,913.00	110,573,100
東海旅客鉄道	60,800	3,671.00	223,196,800
西武ホールディングス	19,100	1,942.00	37,092,200
鴻池運輸	2,700	1,839.00	4,965,300
西日本鉄道	4,200	2,407.00	10,109,400
ハマキョウレックス	1,400	4,040.00	5,656,000
サカイ引越センター	1,800	2,645.00	4,761,000
近鉄グループホールディングス	15,800	4,395.00	69,441,000

阪急阪神ホールディングス	21,000	4,508.00	94,668,000
南海電気鉄道	7,000	2,887.00	20,209,000
京阪ホールディングス	8,700	3,776.00	32,851,200
神戸電鉄	400	2,850.00	1,140,000
名古屋鉄道	16,200	2,230.50	36,134,100
山陽電気鉄道	1,200	2,123.00	2,547,600
アルプス物流	1,200	1,649.00	1,978,800
ヤマトホールディングス	20,200	2,604.50	52,610,900
山九	4,000	5,091.00	20,364,000
丸運	500	266.00	133,000
丸全昭和運輸	1,000	3,730.00	3,730,000
センコーグループホールディングス	8,400	1,054.00	8,853,600
トナミホールディングス	300	4,675.00	1,402,500
ニッコンホールディングス	5,000	3,023.00	15,115,000
日本石油輸送	100	2,876.00	287,600
福山通運	1,800	3,765.00	6,777,000
セイノーホールディングス	8,900	2,058.00	18,316,200
エスライングループ本社	300	863.00	258,900
神奈川中央交通	400	2,959.00	1,183,600
AZ-COM丸和ホールディングス	4,100	1,448.00	5,936,800
C&Fロジホールディングス	1,500	1,492.00	2,238,000
九州旅客鉄道	11,100	3,161.00	35,087,100
SGホールディングス	26,500	2,050.00	54,325,000
NIPPON EXPRESSホールディングス	5,300	7,939.00	42,076,700
日本郵船	45,200	3,911.00	176,777,200
商船三井	34,300	4,196.00	143,922,800
川崎汽船	13,300	5,138.00	68,335,400
NSユニテッド海運	900	4,775.00	4,297,500
飯野海運	5,900	1,180.00	6,962,000
乾汽船	1,900	1,122.00	2,131,800
日本航空	38,700	2,829.00	109,482,300
ANAホールディングス	42,900	3,093.00	132,689,700
パスコ	100	1,746.00	174,600
トランコム	500	7,420.00	3,710,000
日新	1,200	2,431.00	2,917,200

三菱倉庫	3,900	4,355.00	16,984,500
三井倉庫ホールディングス	1,500	4,660.00	6,990,000
住友倉庫	4,200	2,482.00	10,424,400
澁澤倉庫	700	2,804.00	1,962,800
東陽倉庫	200	1,505.00	301,000
日本トランスシティ	3,200	626.00	2,003,200
ケイヒン	100	1,750.00	175,000
中央倉庫	800	1,096.00	876,800
川西倉庫	100	1,108.00	110,800
安田倉庫	1,100	1,123.00	1,235,300
ファイズホールディングス	100	1,067.00	106,700
東洋埠頭	200	1,380.00	276,000
上組	7,500	3,322.00	24,915,000
サンリツ	200	725.00	145,000
キムラユニティー	400	1,331.00	532,400
キューソー流通システム	600	903.00	541,800
東海運	500	282.00	141,000
エーアイテイー	1,000	1,683.00	1,683,000
内外トランスライン	600	2,510.00	1,506,000
日本コンセプト	600	1,659.00	995,400
NEC ネットエスアイ	6,200	2,250.00	13,950,000
クロスキャット	1,000	1,081.00	1,081,000
システナ	24,000	301.00	7,224,000
デジタルアーツ	1,000	4,935.00	4,935,000
日鉄ソリューションズ	2,700	4,840.00	13,068,000
キューブシステム	800	1,085.00	868,000
コア	700	1,712.00	1,198,400
手間いらず	300	2,732.00	819,600
ラクーンホールディングス	1,300	664.00	863,200
ソリトンシステムズ	800	1,370.00	1,096,000
ソフトクリエイトホールディングス	1,300	1,744.00	2,267,200
T I S	17,300	3,069.00	53,093,700
テクミラホールディングス	400	487.00	194,800
グリー	4,200	555.00	2,331,000
GMOペパボ	200	1,193.00	238,600
コーエーテクモホールディングス	9,900	1,668.50	16,518,150

三菱総合研究所	800	4,620.00	3,696,000
ボルテージ	300	256.00	76,800
電算	100	1,501.00	150,100
AGS	400	779.00	311,600
ファインデックス	1,300	947.00	1,231,100
KL a b	3,000	283.00	849,000
ポールトゥウィンホールディングス	2,700	454.00	1,225,800
ネクソン	35,400	2,960.50	104,801,700
アイスタイル	4,700	432.00	2,030,400
エムアップホールディングス	1,900	1,007.00	1,913,300
エイチーム	1,000	573.00	573,000
エニグモ	2,100	365.00	766,500
テクノスジャパン	800	613.00	490,400
e n i s h	900	178.00	160,200
コロプラ	6,100	597.00	3,641,700
ブロードリーフ	7,600	590.00	4,484,000
クロス・マーケティンググループ	600	537.00	322,200
デジタルハーツホールディングス	1,000	942.00	942,000
メディアドゥ	700	1,407.00	984,900
じげん	4,600	523.00	2,405,800
ブイキューブ	2,000	305.00	610,000
エンカレッジ・テクノロジー	200	509.00	101,800
サイバーリンクス	300	716.00	214,800
フィックスターズ	1,800	1,229.00	2,212,200
CARTA HOLDINGS	700	1,315.00	920,500
オブティム	1,600	800.00	1,280,000
セレス	700	1,115.00	780,500
SHIFT	1,100	34,290.00	37,719,000
ティーガイア	1,700	1,866.00	3,172,200
セック	200	4,295.00	859,000
テクマトリックス	2,900	1,673.00	4,851,700
プロシップ	800	1,335.00	1,068,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,100	2,269.50	9,304,950
GMOペイメントゲートウェイ	3,200	8,852.00	28,326,400
ザッパラス	200	475.00	95,000
システムリサーチ	500	3,095.00	1,547,500

インターネットイニシアティブ	7,600	2,784.00	21,158,400
さくらインターネット	1,800	1,874.00	3,373,200
ヴィンクス	200	2,017.00	403,400
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	2,621.00	1,310,500
SRAホールディングス	800	3,480.00	2,784,000
システムインテグレータ	300	395.00	118,500
朝日ネット	1,700	608.00	1,033,600
eBASE	2,200	759.00	1,669,800
アバントグループ	2,000	1,372.00	2,744,000
アドソル日進	700	1,540.00	1,078,000
ODKソリューションズ	200	585.00	117,000
フリービット	800	1,345.00	1,076,000
コムチュア	2,300	1,797.00	4,133,100
サイバーコム	200	1,902.00	380,400
アステリア	1,300	667.00	867,100
アイル	700	3,045.00	2,131,500
マークライنز	800	2,619.00	2,095,200
メディカル・データ・ビジョン	1,900	612.00	1,162,800
gumi	2,300	384.00	883,200
ショーケース	200	298.00	59,600
モバイルファクトリー	200	689.00	137,800
テラスカイ	700	1,544.00	1,080,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	900	1,580.00	1,422,000
PCIホールディングス	400	1,044.00	417,600
アイビーシー	100	468.00	46,800
ネオジャパン	600	1,014.00	608,400
PR TIMES	300	1,706.00	511,800
ラクス	7,500	2,626.00	19,695,000
ランドコンピュータ	500	881.00	440,500
ダブルスタンダード	500	1,438.00	719,000
オープンドア	1,000	790.00	790,000
マイネット	300	281.00	84,300
アカツキ	800	2,098.00	1,678,400
ベネフィットジャパン	100	1,206.00	120,600
Ubicomホールディングス	500	1,646.00	823,000
カナミックネットワーク	1,800	381.00	685,800

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	3,500	1,394.00	4,879,000
シンクロ・フード	600	724.00	434,400
オークネット	600	1,815.00	1,089,000
キャピタル・アセット・プランニング	200	702.00	140,400
エイトレッド	100	1,381.00	138,100
マクロミル	3,100	784.00	2,430,400
ビーグリー	200	1,202.00	240,400
オロ	600	2,749.00	1,649,400
ユーザーローカル	600	1,738.00	1,042,800
テモナ	200	223.00	44,600
マネーフォワード	3,500	4,266.00	14,931,000
サインポスト	400	371.00	148,400
Sun Asterisk	1,100	913.00	1,004,300
プラスアルファ・コンサルティング	900	2,445.00	2,200,500
電算システムホールディングス	700	2,679.00	1,875,300
Appier Group	5,400	1,627.00	8,785,800
ソルクシーズ	700	409.00	286,300
フェイス	300	478.00	143,400
プロトコーポレーション	1,700	1,317.00	2,238,900
ハイマックス	500	1,385.00	692,500
野村総合研究所	35,100	4,083.00	143,313,300
サイバネットシステム	1,100	1,092.00	1,201,200
CEホールディングス	500	619.00	309,500
日本システム技術	500	2,675.00	1,337,500
インテージホールディングス	1,800	1,488.00	2,678,400
東邦システムサイエンス	500	1,144.00	572,000
ソースネクスト	7,300	170.00	1,241,000
インフォコム	2,100	2,397.00	5,033,700
シンプレクス・ホールディングス	2,400	2,534.00	6,081,600
HEROZ	600	1,696.00	1,017,600
ラクスル	3,800	1,254.00	4,765,200
メルカリ	9,600	2,670.00	25,632,000
I P S	400	2,039.00	815,600
F I G	1,100	331.00	364,100
システムサポート	600	1,791.00	1,074,600

イーソル	1,200	558.00	669,600
東海ソフト	100	1,112.00	111,200
ウイングアーク1st	1,600	2,921.00	4,673,600
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	500	1,242.00	621,000
サーバーワークス	300	3,200.00	960,000
東名	100	1,705.00	170,500
ヴィッツ	100	910.00	91,000
トビラシステムズ	300	869.00	260,700
Sansan	5,200	1,611.00	8,377,200
Link-U	200	643.00	128,600
ギフトイ	1,400	1,767.00	2,473,800
メドレー	2,100	4,445.00	9,334,500
ベース	500	3,355.00	1,677,500
JMDC	2,700	4,219.00	11,391,300
フォーカシステムズ	1,100	970.00	1,067,000
クレスコ	1,300	1,829.00	2,377,700
フジ・メディア・ホールディングス	15,200	1,663.00	25,277,600
オービック	5,300	23,335.00	123,675,500
ジャストシステム	2,300	3,110.00	7,153,000
TDCソフト	1,500	2,020.00	3,030,000
LINEヤフー	225,200	482.40	108,636,480
トレンドマイクロ	7,500	7,868.00	59,010,000
IDホールディングス	1,100	1,615.00	1,776,500
日本オラクル	3,000	11,200.00	33,600,000
アルファシステムズ	400	2,923.00	1,169,200
フューチャー	3,400	1,739.00	5,912,600
CAC Holdings	800	1,739.00	1,391,200
SBテクノロジー	700	2,484.00	1,738,800
トーセ	300	693.00	207,900
オービックビジネスコンサルタント	2,200	6,665.00	14,663,000
アイティフォー	2,000	1,163.00	2,326,000
東計電算	200	7,110.00	1,422,000
エクスネット	100	1,065.00	106,500
大塚商会	7,800	6,119.00	47,728,200
サイボウズ	2,200	2,127.00	4,679,400

電通国際情報サービス	1,900	5,800.00	11,020,000	
ACCESS	1,700	820.00	1,394,000	
デジタルガレージ	2,500	3,725.00	9,312,500	
EMシステムズ	2,600	703.00	1,827,800	
ウェザーニューズ	500	5,460.00	2,730,000	
C I J	2,600	618.00	1,606,800	
ビジネスエンジニアリング	300	4,100.00	1,230,000	
日本エンタープライズ	900	117.00	105,300	
WOWOW	1,200	1,054.00	1,264,800	
スカラ	1,500	758.00	1,137,000	
インテリジェント ウェイブ	500	1,062.00	531,000	
ANYCOLOR	600	3,170.00	1,902,000	
IMAGICA GROUP	1,600	623.00	996,800	
ネットワンシステムズ	6,400	2,349.00	15,033,600	
システムソフト	5,800	61.00	353,800	
アルゴグラフィックス	1,500	3,535.00	5,302,500	
マーベラス	2,500	688.00	1,720,000	
エイベックス	2,700	1,342.00	3,623,400	
B I P R O G Y	5,200	4,162.00	21,642,400	
都築電気	800	2,255.00	1,804,000	
TBSホールディングス	8,100	3,040.00	24,624,000	
日本テレビホールディングス	14,000	1,506.00	21,084,000	
朝日放送グループホールディングス	1,500	648.00	972,000	
テレビ朝日ホールディングス	3,900	1,642.00	6,403,800	
スカパーJ SATホールディングス	12,300	638.00	7,847,400	
テレビ東京ホールディングス	1,100	3,040.00	3,344,000	
日本BS放送	300	894.00	268,200	
ビジョン	2,400	1,183.00	2,839,200	
スマートバリュー	200	419.00	83,800	
USEN-NEXT HOLDINGS	1,800	3,755.00	6,759,000	
日本通信	15,600	233.00	3,634,800	
クロップス	100	1,010.00	101,000	
日本電信電話	4,708,500	169.80	799,503,300	代用有価証券 700,000株
KDDI	122,300	4,448.00	543,990,400	
ソフトバンク	254,700	1,748.00	445,215,600	

光通信	1,600	23,190.00	37,104,000	
エムティーアイ	1,100	586.00	644,600	
GMOインターネットグループ	5,800	2,521.00	14,621,800	
ファイバーゲート	700	908.00	635,600	
アイドママーケティングコミュニケーション	300	222.00	66,600	
KADOKAWA	8,400	2,576.50	21,642,600	
学研ホールディングス	2,600	977.00	2,540,200	
ゼンリン	2,700	858.00	2,316,600	
昭文社ホールディングス	400	357.00	142,800	
インプレスホールディングス	900	176.00	158,400	
アイネット	1,000	1,699.00	1,699,000	
松竹	800	9,324.00	7,459,200	
東宝	8,800	4,757.00	41,861,600	
東映	500	20,280.00	10,140,000	
NTTデータグループ	41,400	1,869.50	77,397,300	
ピー・シー・エー	900	1,111.00	999,900	
ビジネスブレイン太田昭和	600	2,118.00	1,270,800	
D T S	3,400	3,565.00	12,121,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,200	4,833.00	34,797,600	
シーイーシー	2,000	1,585.00	3,170,000	
カプコン	14,100	4,618.00	65,113,800	
アイ・エス・ビー	800	1,530.00	1,224,000	
ジャステック	1,000	1,425.00	1,425,000	
S C S K	11,100	2,739.50	30,408,450	
NSW	700	2,767.00	1,936,900	
アイネス	1,200	1,584.00	1,900,800	
T K C	2,500	3,495.00	8,737,500	
富士ソフト	3,200	5,700.00	18,240,000	
NSD	5,600	2,775.00	15,540,000	
コナミグループ	5,900	7,258.00	42,822,200	
福井コンピュータホールディングス	1,000	2,569.00	2,569,000	
J B C Cホールディングス	1,000	3,365.00	3,365,000	
ミロク情報サービス	1,400	1,654.00	2,315,600	
ソフトバンクグループ	78,100	6,088.00	475,472,800	
高千穂交易	500	3,385.00	1,692,500	
オルパヘルスケアホールディングス	200	1,719.00	343,800	

伊藤忠食品	400	7,930.00	3,172,000
エレマテック	1,500	1,719.00	2,578,500
あらた	1,300	6,210.00	8,073,000
トーメンデバイス	300	5,170.00	1,551,000
東京エレクトロン デバイス	1,700	5,040.00	8,568,000
円谷フィールズホールディングス	2,900	1,174.00	3,404,600
双日	18,600	3,221.00	59,910,600
アルフレッサ ホールディングス	16,800	2,378.00	39,950,400
横浜冷凍	4,700	1,051.00	4,939,700
神栄	200	1,938.00	387,600
ラサ商事	600	1,484.00	890,400
アルコニックス	2,200	1,308.00	2,877,600
神戸物産	12,900	4,133.00	53,315,700
ハイパー	300	321.00	96,300
あい ホールディングス	2,700	2,301.00	6,212,700
ディーブイエックス	300	1,024.00	307,200
ダイワボウホールディングス	7,400	2,913.00	21,556,200
マクニカホールディングス	4,000	7,711.00	30,844,000
ラクト・ジャパン	700	1,901.00	1,330,700
グリムス	700	1,910.00	1,337,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,500	1,020.00	2,550,000
八洲電機	1,400	1,238.00	1,733,200
メディアスホールディングス	1,200	753.00	903,600
レスターホールディングス	1,400	2,771.00	3,879,400
ジオリーブグループ	200	1,237.00	247,400
大光	400	640.00	256,000
OCHIホールディングス	200	1,407.00	281,400
TOKAIホールディングス	9,200	946.00	8,703,200
黒谷	300	580.00	174,000
Cominix	200	779.00	155,800
三洋貿易	1,900	1,231.00	2,338,900
ビューティガレージ	600	2,021.00	1,212,600
ウイン・パートナーズ	1,200	1,119.00	1,342,800
ミタチ産業	300	1,117.00	335,100
シップヘルスケアホールディングス	6,000	2,149.00	12,894,000
明治電機工業	700	1,366.00	956,200

デリカフーズホールディングス	500	567.00	283,500
スターティアホールディングス	300	1,286.00	385,800
コメダホールディングス	4,100	2,688.00	11,020,800
ピーバンドットコム	200	364.00	72,800
アセンテック	700	501.00	350,700
富士興産	300	1,800.00	540,000
協栄産業	100	2,491.00	249,100
フルサト・マルカホールディングス	1,500	2,577.00	3,865,500
ヤマエグループホールディングス	1,000	3,745.00	3,745,000
小野建	1,700	1,660.00	2,822,000
南陽	200	2,042.00	408,400
佐鳥電機	800	1,929.00	1,543,200
エコートレーディング	200	1,455.00	291,000
伯東	1,000	5,280.00	5,280,000
コンドーテック	1,300	1,150.00	1,495,000
中山福	600	359.00	215,400
ナガイレーベン	2,200	2,276.00	5,007,200
三菱食品	1,600	4,790.00	7,664,000
松田産業	1,300	2,392.00	3,109,600
第一興商	6,500	2,063.50	13,412,750
メディパルホールディングス	17,300	2,266.00	39,201,800
S P K	800	1,807.00	1,445,600
萩原電気ホールディングス	700	4,500.00	3,150,000
アズワン	2,600	5,380.00	13,988,000
スズデン	600	2,297.00	1,378,200
シモジマ	1,200	1,191.00	1,429,200
ドウシシャ	1,500	2,055.00	3,082,500
小津産業	200	1,572.00	314,400
高速	1,000	2,003.00	2,003,000
たけびし	700	1,808.00	1,265,600
リックス	300	3,215.00	964,500
丸文	1,500	1,504.00	2,256,000
ハピネット	1,500	2,657.00	3,985,500
橋本総業ホールディングス	700	1,291.00	903,700
日本ライフライン	5,000	1,200.00	6,000,000
タカショー	1,500	510.00	765,000

I D O M	4,500	917.00	4,126,500	
進和	1,000	2,314.00	2,314,000	
エスケイジャパン	300	811.00	243,300	
ダイترون	700	2,797.00	1,957,900	
シークス	2,400	1,434.00	3,441,600	
田中商事	300	699.00	209,700	
オーハシテクニカ	900	1,762.00	1,585,800	
白銅	500	2,158.00	1,079,000	
ダイコー通産	100	1,137.00	113,700	
伊藤忠商事	110,100	5,784.00	636,818,400	
丸紅	139,300	2,222.50	309,594,250	
高島	700	1,089.00	762,300	
長瀬産業	7,700	2,266.00	17,448,200	
蝶理	1,100	2,683.00	2,951,300	
豊田通商	14,600	8,181.00	119,442,600	
三共生興	2,300	719.00	1,653,700	
兼松	7,000	2,044.00	14,308,000	
ツカモトコーポレーション	200	1,168.00	233,600	
三井物産	125,800	5,123.00	644,473,400	
日本紙パルプ商事	800	4,870.00	3,896,000	
カメイ	1,800	1,681.00	3,025,800	
東都水産	100	7,130.00	713,000	
O U Gホールディングス	200	2,383.00	476,600	
スターゼン	1,200	2,413.00	2,895,600	
山善	5,200	1,165.00	6,058,000	
椿本興業	400	6,390.00	2,556,000	
住友商事	101,100	3,011.00	304,412,100	
内田洋行	700	6,940.00	4,858,000	
三菱商事	110,300	6,704.00	739,451,200	代用有価証券 18,000株
第一実業	1,600	1,887.00	3,019,200	
キヤノンマーケティングジャパン	3,900	3,976.00	15,506,400	
西華産業	700	2,728.00	1,909,600	
佐藤商事	1,200	1,419.00	1,702,800	
菱洋エレクトロ	1,600	3,570.00	5,712,000	
東京産業	1,600	824.00	1,318,400	

ユアサ商事	1,300	4,750.00	6,175,000
神鋼商事	400	5,790.00	2,316,000
トルク	700	275.00	192,500
阪和興業	3,000	4,790.00	14,370,000
正栄食品工業	1,100	4,695.00	5,164,500
カナデン	1,300	1,543.00	2,005,900
RYODEN	1,400	2,512.00	3,516,800
岩谷産業	3,800	6,196.00	23,544,800
ナイス	300	1,566.00	469,800
ニチモウ	200	3,945.00	789,000
極東貿易	1,000	1,892.00	1,892,000
アステナホールディングス	3,200	470.00	1,504,000
三愛オブリ	4,100	1,661.00	6,810,100
稲畑産業	3,300	3,100.00	10,230,000
G S I クレオス	900	2,140.00	1,926,000
明和産業	2,100	637.00	1,337,700
クワザワホールディングス	400	671.00	268,400
ワキタ	2,800	1,565.00	4,382,000
東邦ホールディングス	4,600	3,302.00	15,189,200
サンゲツ	3,900	2,976.00	11,606,400
ミツウロコグループホールディングス	2,200	1,468.00	3,229,600
シナネンホールディングス	500	4,105.00	2,052,500
伊藤忠エネクス	4,200	1,560.00	6,552,000
サンリオ	4,700	5,254.00	24,693,800
サンワテクノス	900	2,220.00	1,998,000
リョーサン	1,200	4,825.00	5,790,000
新光商事	2,300	1,163.00	2,674,900
トーヨー	700	2,544.00	1,780,800
三信電気	700	2,149.00	1,504,300
東陽テクニカ	1,700	1,343.00	2,283,100
モスフードサービス	2,500	3,210.00	8,025,000
加賀電子	1,500	6,330.00	9,495,000
ソーダニッカ	1,300	1,033.00	1,342,900
立花エレテック	1,100	2,753.00	3,028,300
フォーバル	700	1,410.00	987,000
PAL TAC	2,300	4,677.00	10,757,100

三谷産業	3,100	327.00	1,013,700
太平洋興発	400	773.00	309,200
西本Wismettacホールディングス	400	5,470.00	2,188,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	2,130.00	213,000
コア商事ホールディングス	1,000	713.00	713,000
KPPグループホールディングス	4,400	688.00	3,027,200
ヤマタネ	800	2,293.00	1,834,400
丸紅建材リース	100	2,508.00	250,800
泉州電業	900	3,425.00	3,082,500
トラスコ中山	3,600	2,410.00	8,676,000
オートバックスセブン	5,900	1,561.00	9,209,900
モリト	1,200	1,241.00	1,489,200
加藤産業	2,100	4,435.00	9,313,500
北恵	300	819.00	245,700
イエローハット	2,700	1,739.00	4,695,300
JKホールディングス	1,400	1,006.00	1,408,400
日伝	1,200	2,791.00	3,349,200
北沢産業	700	274.00	191,800
杉本商事	800	2,154.00	1,723,200
因幡電機産業	4,300	3,360.00	14,448,000
東テク	600	4,745.00	2,847,000
ミスミグループ本社	25,200	2,130.00	53,676,000
アルテック	600	228.00	136,800
タキヒヨー	300	989.00	296,700
蔵王産業	200	2,404.00	480,800
スズケン	6,400	4,786.00	30,630,400
ジェコス	1,100	1,034.00	1,137,400
グローセル	1,900	687.00	1,305,300
ローソン	3,500	7,039.00	24,636,500
サンエー	1,300	4,530.00	5,889,000
カワチ薬品	1,300	2,470.00	3,211,000
エービーシー・マート	7,300	2,565.00	18,724,500
ハードオフコーポレーション	600	1,536.00	921,600
アスクル	3,500	2,157.00	7,549,500
ゲオホールディングス	1,900	2,227.00	4,231,300
アダストリア	2,000	3,690.00	7,380,000

ジーフット	900	286.00	257,400
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	665.00	133,000
くら寿司	2,000	3,260.00	6,520,000
キャンドウ	600	2,616.00	1,569,600
I Kホールディングス	400	327.00	130,800
パルグループホールディングス	3,300	2,611.00	8,616,300
エディオン	6,600	1,480.00	9,768,000
サーラコーポレーション	3,500	706.00	2,471,000
ワッツ	500	592.00	296,000
ハローズ	800	4,005.00	3,204,000
フジオフードグループ本社	1,900	1,408.00	2,675,200
あみやき亭	400	3,620.00	1,448,000
ひらまつ	2,400	244.00	585,600
大黒天物産	500	6,840.00	3,420,000
ハニーズホールディングス	1,300	1,778.00	2,311,400
ファーマライズホールディングス	200	638.00	127,600
アルペン	1,400	1,963.00	2,748,200
ハブ	300	705.00	211,500
クオールホールディングス	2,300	1,669.00	3,838,700
ジーンズホールディングス	1,000	4,475.00	4,475,000
ビックカメラ	8,900	1,262.00	11,231,800
DCMホールディングス	8,800	1,310.00	11,528,000
ペッパーフードサービス	4,100	97.00	397,700
Monotaro	23,600	1,556.50	36,733,400
東京一番フーズ	300	499.00	149,700
J. フロント リテイリング	19,100	1,294.00	24,715,400
ドトール・日レスホールディングス	3,000	2,134.00	6,402,000
マツキヨココカラ&カンパニー	30,400	2,541.50	77,261,600
ブロンコビリー	1,000	3,080.00	3,080,000
ZOZO	11,000	3,109.00	34,199,000
トレジャー・ファクトリー	800	1,323.00	1,058,400
物語コーポレーション	2,800	4,160.00	11,648,000
三越伊勢丹ホールディングス	28,100	1,533.00	43,077,300
Hamee	600	902.00	541,200
マーケットエンタープライズ	100	1,043.00	104,300
ウエルシアホールディングス	8,700	2,372.50	20,640,750

クリエイトSDホールディングス	2,800	3,010.00	8,428,000
丸善CHIホールディングス	1,200	328.00	393,600
ミサワ	200	635.00	127,000
ティーライフ	100	1,359.00	135,900
チムニー	300	1,402.00	420,600
シュッピン	1,500	1,135.00	1,702,500
オイシックス・ラ・大地	2,300	1,343.00	3,088,900
ネクステージ	3,800	2,427.00	9,222,600
ジョイフル本田	4,900	1,825.00	8,942,500
鳥貴族ホールディングス	600	3,200.00	1,920,000
ホットランド	1,300	1,894.00	2,462,200
すかいらーくホールディングス	22,800	2,104.50	47,982,600
SFPホールディングス	900	2,073.00	1,865,700
綿半ホールディングス	1,300	1,367.00	1,777,100
ヨシックスホールディングス	300	2,710.00	813,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,700	994.00	4,671,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	690.00	552,000
B E E N O S	700	1,396.00	977,200
あさひ	1,500	1,289.00	1,933,500
日本調剤	1,100	1,313.00	1,444,300
コスモス薬品	1,700	15,445.00	26,256,500
トーエル	400	727.00	290,800
セブン&アイ・ホールディングス	57,600	5,487.00	316,051,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	11,300	1,045.00	11,808,500
ツルハホールディングス	3,500	12,115.00	42,402,500
サンマルクホールディングス	1,300	1,977.00	2,570,100
フェリシモ	200	906.00	181,200
トリドールホールディングス	4,700	4,048.00	19,025,600
TOKYO BASE	2,200	250.00	550,000
ウイルプラスホールディングス	200	979.00	195,800
JMホールディングス	1,300	2,183.00	2,837,900
サツドラホールディングス	500	787.00	393,500
アレンザホールディングス	1,300	1,031.00	1,340,300
串カツ田中ホールディングス	500	1,564.00	782,000
パロックジャパンリミテッド	1,300	823.00	1,069,900

クスリのアオキホールディングス	4,500	3,361.00	15,124,500
力の源ホールディングス	800	1,421.00	1,136,800
FOOD & LIFE COMPANIE	8,900	2,933.00	26,103,700
メディカルシステムネットワーク	1,900	632.00	1,200,800
一家ホールディングス	300	661.00	198,300
ジャパクラフトホールディングス	600	167.00	100,200
はるやまホールディングス	500	548.00	274,000
ノジマ	4,900	1,614.00	7,908,600
カップ・クリエイト	2,600	1,599.00	4,157,400
ライトオン	700	452.00	316,400
良品計画	18,200	2,361.00	42,970,200
パリミキホールディングス	1,300	472.00	613,600
アドヴァングループ	1,600	1,049.00	1,678,400
アルビス	600	2,555.00	1,533,000
コナカ	1,100	391.00	430,100
ハウス オブ ローゼ	100	1,603.00	160,300
G-7ホールディングス	1,800	1,162.00	2,091,600
イオン北海道	5,000	901.00	4,505,000
コジマ	2,800	752.00	2,105,600
ヒマラヤ	300	916.00	274,800
コーナン商事	2,100	3,825.00	8,032,500
エコス	600	2,160.00	1,296,000
ワタミ	1,800	1,017.00	1,830,600
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	33,700	3,363.00	113,333,100
西松屋チェーン	3,300	2,208.00	7,286,400
ゼンショーホールディングス	8,500	6,893.00	58,590,500
ハークスレイ	300	851.00	255,300
サイゼリヤ	2,500	4,745.00	11,862,500
VTホールディングス	6,400	510.00	3,264,000
魚力	600	2,230.00	1,338,000
フジ・コーポレーション	800	1,608.00	1,286,400
ユナイテッドアローズ	2,000	1,972.00	3,944,000
ハイデイ日高	2,500	2,672.00	6,680,000
YU-WA Creation Holdings	600	153.00	91,800
コロワイド	7,200	2,121.00	15,271,200

壱番屋	1,300	5,160.00	6,708,000
P L A N T	200	1,428.00	285,600
スギホールディングス	3,400	6,105.00	20,757,000
薬王堂ホールディングス	800	2,622.00	2,097,600
スクロール	2,500	961.00	2,402,500
ヨンドシーホールディングス	1,600	1,969.00	3,150,400
木曾路	2,500	2,482.00	6,205,000
S R S ホールディングス	2,800	1,045.00	2,926,000
千趣会	3,100	390.00	1,209,000
リテールパートナーズ	2,500	1,553.00	3,882,500
上新電機	1,700	2,386.00	4,056,200
日本瓦斯	8,800	2,298.50	20,226,800
ロイヤルホールディングス	3,000	2,476.00	7,428,000
東天紅	100	820.00	82,000
いなげや	1,600	1,265.00	2,024,000
チヨダ	1,600	851.00	1,361,600
ライフコーポレーション	1,800	3,340.00	6,012,000
リンガーハット	2,200	2,331.00	5,128,200
M r M a x H D	2,100	610.00	1,281,000
A O K I ホールディングス	3,600	1,125.00	4,050,000
オークワ	2,400	806.00	1,934,400
コメリ	2,600	3,165.00	8,229,000
青山商事	3,600	1,536.00	5,529,600
しまむら	2,000	16,115.00	32,230,000
はせがわ	500	355.00	177,500
高島屋	11,500	1,916.00	22,034,000
松屋	2,800	933.00	2,612,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,400	1,519.00	11,240,600
近鉄百貨店	700	2,603.00	1,822,100
丸井グループ	11,100	2,294.00	25,463,400
アクシアル リテイリング	1,100	4,015.00	4,416,500
イオン	56,600	3,059.00	173,139,400
イズミ	3,000	3,606.00	10,818,000
平和堂	2,800	2,179.00	6,101,200
フジ	2,600	1,862.00	4,841,200
ヤオコー	1,900	8,104.00	15,397,600

ゼビオホールディングス	2,300	947.00	2,178,100
ケーズホールディングス	11,800	1,307.00	15,422,600
O l y m p i c グループ	500	525.00	262,500
日産東京販売ホールディングス	1,500	435.00	652,500
シルバーライフ	400	1,049.00	419,600
Genky Drug Stores	700	5,180.00	3,626,000
ナルミヤ・インターナショナル	200	1,111.00	222,200
ブックオフグループホールディングス	900	1,147.00	1,032,300
ギフトホールディングス	700	2,053.00	1,437,100
アインホールディングス	2,300	4,486.00	10,317,800
元気寿司	1,000	3,185.00	3,185,000
ヤマダホールディングス	51,400	426.00	21,896,400
アークランズ	5,000	1,690.00	8,450,000
ニトリホールディングス	6,100	18,670.00	113,887,000
愛眼	800	177.00	141,600
ケーユーホールディングス	800	1,071.00	856,800
吉野家ホールディングス	6,100	3,083.00	18,806,300
松屋フーズホールディングス	800	4,870.00	3,896,000
サガミホールディングス	2,500	1,354.00	3,385,000
関西フードマーケット	1,100	1,422.00	1,564,200
王将フードサービス	1,200	7,800.00	9,360,000
ミニストップ	1,200	1,497.00	1,796,400
アークス	3,100	2,720.00	8,432,000
バローホールディングス	3,200	2,324.00	7,436,800
ベルク	800	6,180.00	4,944,000
大庄	700	1,189.00	832,300
ファーストリテイリング	7,500	35,580.00	266,850,000
サンドラッグ	5,600	4,386.00	24,561,600
サックスパー ホールディングス	1,400	828.00	1,159,200
ヤマザワ	200	1,252.00	250,400
やまや	200	3,015.00	603,000
ベルーナ	4,000	597.00	2,388,000
いよぎんホールディングス	18,500	929.00	17,186,500
しずおかフィナンシャルグループ	34,600	1,166.50	40,360,900
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	13,100	1,029.00	13,479,900
楽天銀行	5,400	2,232.00	12,052,800

京都フィナンシャルグループ	4,900	8,600.00	42,140,000
島根銀行	200	504.00	100,800
じもとホールディングス	700	548.00	383,600
めぶきフィナンシャルグループ	77,100	446.70	34,440,570
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	3,990.00	7,980,000
九州フィナンシャルグループ	30,100	793.30	23,878,330
ゆうちょ銀行	170,900	1,443.00	246,608,700
富山第一銀行	5,000	760.00	3,800,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	83,400	671.50	56,003,100
西日本フィナンシャルホールディングス	8,800	1,615.00	14,212,000
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,844.00	2,581,600
第四北越フィナンシャルグループ	2,500	3,990.00	9,975,000
ひろぎんホールディングス	22,200	910.00	20,202,000
おきなわフィナンシャルグループ	1,300	2,321.00	3,017,300
十六フィナンシャルグループ	2,000	3,745.00	7,490,000
北國フィナンシャルホールディングス	1,600	4,645.00	7,432,000
プロクレアホールディングス	1,800	1,852.00	3,333,600
あいちフィナンシャルグループ	2,400	2,318.00	5,563,200
あおぞら銀行	11,200	3,079.00	34,484,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	973,500	1,204.50	1,172,580,750
りそなホールディングス	181,400	721.00	130,789,400
三井住友トラスト・ホールディングス	27,700	5,351.00	148,222,700
三井住友フィナンシャルグループ	110,500	6,760.00	746,980,000
千葉銀行	43,300	1,058.00	45,811,400
群馬銀行	30,200	713.50	21,547,700
武蔵野銀行	2,200	2,736.00	6,019,200
千葉興業銀行	2,600	796.00	2,069,600
筑波銀行	6,800	248.00	1,686,400
七十七銀行	4,500	3,505.00	15,772,500
秋田銀行	1,000	1,939.00	1,939,000
山形銀行	1,700	1,089.00	1,851,300
岩手銀行	1,000	2,385.00	2,385,000
東邦銀行	12,400	298.00	3,695,200
東北銀行	400	1,150.00	460,000
ふくおかフィナンシャルグループ	13,500	3,286.00	44,361,000
スルガ銀行	13,700	770.00	10,549,000

八十二銀行	33,400	798.60	26,673,240
山梨中央銀行	1,700	1,725.00	2,932,500
大垣共立銀行	3,000	1,852.00	5,556,000
福井銀行	1,400	1,580.00	2,212,000
清水銀行	600	1,489.00	893,400
富山銀行	100	1,671.00	167,100
滋賀銀行	2,600	3,495.00	9,087,000
南都銀行	2,400	2,443.00	5,863,200
百五銀行	14,700	545.00	8,011,500
紀陽銀行	5,600	1,529.00	8,562,400
ほくほくフィナンシャルグループ	9,600	1,552.00	14,899,200
山陰合同銀行	9,800	985.00	9,653,000
鳥取銀行	300	1,350.00	405,000
百十四銀行	1,500	2,388.00	3,582,000
四国銀行	2,300	972.00	2,235,600
阿波銀行	2,200	2,377.00	5,229,400
大分銀行	900	2,477.00	2,229,300
宮崎銀行	900	2,523.00	2,270,700
佐賀銀行	900	1,828.00	1,645,200
琉球銀行	3,300	1,110.00	3,663,000
セブン銀行	48,800	297.20	14,503,360
みずほフィナンシャルグループ	209,900	2,390.50	501,765,950
高知銀行	300	933.00	279,900
山口フィナンシャルグループ	15,300	1,299.00	19,874,700
名古屋銀行	1,000	5,480.00	5,480,000
北洋銀行	23,700	361.00	8,555,700
大光銀行	300	1,293.00	387,900
愛媛銀行	2,100	958.00	2,011,800
トマト銀行	300	1,130.00	339,000
京葉銀行	6,600	687.00	4,534,200
栃木銀行	7,800	304.00	2,371,200
北日本銀行	500	2,075.00	1,037,500
東和銀行	2,900	601.00	1,742,900
福島銀行	900	233.00	209,700
大東銀行	400	770.00	308,000
トモニホールディングス	12,800	366.00	4,684,800

フィデアホールディングス	1,600	1,479.00	2,366,400
池田泉州ホールディングス	21,700	324.00	7,030,800
F P G	5,300	1,650.00	8,745,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,300	1,502.00	1,952,600
マーキュリアホールディングス	400	692.00	276,800
S B I ホールディングス	22,700	3,050.00	69,235,000
ジャフコ グループ	4,600	1,697.00	7,806,200
大和証券グループ本社	120,500	962.20	115,945,100
野村ホールディングス	261,600	620.00	162,192,000
岡三証券グループ	13,700	701.00	9,603,700
丸三証券	5,200	828.00	4,305,600
東洋証券	4,100	296.00	1,213,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,400	513.00	9,439,200
光世証券	200	502.00	100,400
水戸証券	4,500	417.00	1,876,500
いちよし証券	2,900	702.00	2,035,800
松井証券	7,700	731.00	5,628,700
マネックスグループ	15,200	696.00	10,579,200
極東証券	2,100	967.00	2,030,700
岩井コスモホールディングス	1,800	1,734.00	3,121,200
アイザワ証券グループ	2,300	1,142.00	2,626,600
マネーパートナーズグループ	900	283.00	254,700
スパークス・グループ	1,700	1,552.00	2,638,400
かんぽ生命保険	15,800	2,516.50	39,760,700
F P パートナー	300	4,965.00	1,489,500
S O M P O ホールディングス	24,600	6,830.00	168,018,000
アニコム ホールディングス	5,200	532.00	2,766,400
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	34,800	5,381.00	187,258,800
第一生命ホールディングス	76,000	2,962.50	225,150,000
東京海上ホールディングス	153,700	3,492.00	536,720,400
T & D ホールディングス	45,200	2,211.00	99,937,200
アドバンスクリエイト	900	989.00	890,100
全国保証	4,100	5,217.00	21,389,700
あんしん保証	300	238.00	71,400
ジェイリース	400	2,103.00	841,200

イントラスト	300	813.00	243,900
日本モーゲージサービス	500	508.00	254,000
C a s a	300	866.00	259,800
アルヒ	1,500	819.00	1,228,500
プレミアグループ	2,600	1,686.00	4,383,600
ネットプロテクションズホールディングス	5,200	196.00	1,019,200
クレディセゾン	9,800	2,461.50	24,122,700
芙蓉総合リース	1,400	11,790.00	16,506,000
みずほリース	2,600	4,785.00	12,441,000
東京センチュリー	2,900	6,047.00	17,536,300
日本証券金融	5,700	1,440.00	8,208,000
アイフル	23,000	377.00	8,671,000
リコーリース	1,500	4,650.00	6,975,000
イオンフィナンシャルサービス	8,900	1,231.50	10,960,350
アコム	27,900	345.70	9,645,030
ジャックス	1,700	5,050.00	8,585,000
オリエントコーポレーション	5,100	1,069.00	5,451,900
オリックス	94,800	2,653.50	251,551,800
三菱HCキャピタル	69,200	942.10	65,193,320
九州リースサービス	300	1,082.00	324,600
日本取引所グループ	40,600	2,836.00	115,141,600
イー・ギャランティ	2,500	1,892.00	4,730,000
アサックス	400	682.00	272,800
NECキャピタルソリューション	700	3,275.00	2,292,500
大東建託	5,700	16,195.00	92,311,500
いちご	18,500	337.00	6,234,500
日本駐車場開発	17,200	195.00	3,354,000
スター・マイカ・ホールディングス	2,000	598.00	1,196,000
SREホールディングス	700	2,738.00	1,916,600
ADワークスグループ	2,700	236.00	637,200
ヒューリック	36,400	1,493.00	54,345,200
野村不動産ホールディングス	8,700	3,679.00	32,007,300
三重交通グループホールディングス	3,600	570.00	2,052,000
サムティ	2,600	2,327.00	6,050,200
ディア・ライフ	2,800	848.00	2,374,400
コーセーアールイー	400	953.00	381,200

地主	1,200	2,250.00	2,700,000
プレサンスコーポレーション	2,600	1,571.00	4,084,600
THEグローバル社	800	374.00	299,200
ハウスコム	200	887.00	177,400
JPMC	1,000	1,133.00	1,133,000
サンセイランディック	300	1,024.00	307,200
エストラスト	200	639.00	127,800
フージャースホールディングス	2,500	1,029.00	2,572,500
オープンハウスグループ	5,700	4,120.00	23,484,000
東急不動産ホールディングス	46,900	923.60	43,316,840
飯田グループホールディングス	14,900	2,178.00	32,452,200
イーランド	200	1,472.00	294,400
ムゲンエステート	700	1,177.00	823,900
ビーロット	700	987.00	690,900
ファーストブラザーズ	300	958.00	287,400
And Doホールディングス	1,100	1,025.00	1,127,500
シーアールイー	1,000	1,328.00	1,328,000
ケイアイスター不動産	800	3,140.00	2,512,000
アグレ都市デザイン	200	1,498.00	299,600
グッドコムアセット	1,500	667.00	1,000,500
ジェイ・エス・ビー	800	2,412.00	1,929,600
ロードスターキャピタル	1,100	2,032.00	2,235,200
テンポイノベーション	300	1,048.00	314,400
グローバル・リンク・マネジメント	200	2,309.00	461,800
フェイスネットワーク	300	1,329.00	398,700
霞ヶ関キャピタル	400	8,090.00	3,236,000
パーク24	10,200	1,836.50	18,732,300
パラカ	600	1,881.00	1,128,600
ミガロホールディングス	200	1,610.00	322,000
三井不動産	72,000	3,500.00	252,000,000
三菱地所	101,700	2,000.00	203,400,000
平和不動産	2,600	3,790.00	9,854,000
東京建物	13,600	2,096.00	28,505,600
京阪神ビルディング	3,000	1,400.00	4,200,000
住友不動産	22,500	4,357.00	98,032,500
テーオーシー	2,900	711.00	2,061,900

東京楽天地	300	6,780.00	2,034,000
スターツコーポレーション	2,300	2,810.00	6,463,000
フジ住宅	2,200	692.00	1,522,400
空港施設	2,500	579.00	1,447,500
明和地所	900	1,219.00	1,097,100
ゴールドクレスト	1,300	2,140.00	2,782,000
エスリード	800	3,210.00	2,568,000
日神グループホールディングス	2,800	490.00	1,372,000
日本エスコン	3,000	926.00	2,778,000
MIRARTHホールディングス	7,300	447.00	3,263,100
AVANTIA	600	857.00	514,200
イオンモール	8,100	1,735.50	14,057,550
毎日コムネット	400	739.00	295,600
ファースト住建	400	1,066.00	426,400
カチタス	4,300	2,141.00	9,206,300
トーセイ	2,700	1,803.00	4,868,100
サンフロンティア不動産	2,400	1,545.00	3,708,000
FJネクストホールディングス	1,800	1,093.00	1,967,400
インテリックス	400	472.00	188,800
ランドビジネス	600	270.00	162,000
グランディハウス	1,200	593.00	711,600
日本空港ビルデング	5,500	6,251.00	34,380,500
明豊ファシリティワークス	500	801.00	400,500
LIFULL	5,600	180.00	1,008,000
MIXI	3,500	2,343.00	8,200,500
ジェイエイシーリクルートメント	1,500	2,668.00	4,002,000
日本M&Aセンターホールディングス	25,900	748.10	19,375,790
メンバーズ	600	936.00	561,600
中広	100	406.00	40,600
UTグループ	2,100	2,176.00	4,569,600
アイティメディア	600	912.00	547,200
E・Jホールディングス	900	1,562.00	1,405,800
オープンアップグループ	4,900	2,179.00	10,677,100
コシダカホールディングス	4,900	1,040.00	5,096,000
アルトナー	400	1,970.00	788,000
パソナグループ	2,000	2,715.00	5,430,000

CDS	200	1,712.00	342,400
リンクアンドモチベーション	4,600	585.00	2,691,000
エス・エム・エス	5,700	2,785.00	15,874,500
サニーサイドアップグループ	300	581.00	174,300
パーソルホールディングス	165,000	229.70	37,900,500
リニカル	600	503.00	301,800
クックパッド	4,500	114.00	513,000
エスクリ	300	278.00	83,400
アイ・ケイ・ケイホールディングス	400	638.00	255,200
学情	800	1,706.00	1,364,800
スタジオアリス	800	2,076.00	1,660,800
シミックホールディングス	800	2,646.00	2,116,800
エプコ	300	878.00	263,400
N J S	400	2,730.00	1,092,000
総合警備保障	27,100	804.80	21,810,080
カカコム	10,700	1,713.00	18,329,100
アイロムグループ	700	1,911.00	1,337,700
セントケア・ホールディング	1,200	904.00	1,084,800
サイネックス	200	755.00	151,000
ルネサンス	1,300	860.00	1,118,000
ディップ	2,500	3,180.00	7,950,000
デジタルホールディングス	800	1,236.00	988,800
新日本科学	1,500	1,675.00	2,512,500
キャリアデザインセンター	200	2,044.00	408,800
ベネフィット・ワン	5,700	1,980.00	11,286,000
エムスリー	32,100	2,233.50	71,695,350
ツカダ・グローバルホールディング	600	367.00	220,200
プラス	100	646.00	64,600
アウトソーシング	10,400	1,755.00	18,252,000
ウェルネット	700	550.00	385,000
ワールドホールディングス	700	2,817.00	1,971,900
ディー・エヌ・エー	5,800	1,347.00	7,812,600
博報堂DYホールディングス	20,700	1,060.50	21,952,350
ぐるなび	3,100	279.00	864,900
タカミヤ	2,200	459.00	1,009,800
ジャパンベストレスキューシステム	800	998.00	798,400

ファンコミュニケーションズ	2,200	412.00	906,400
ライク	600	1,384.00	830,400
A o b a - B B T	300	409.00	122,700
エスプール	4,600	419.00	1,927,400
W D B ホールディングス	800	2,240.00	1,792,000
ティア	500	454.00	227,000
C D G	100	1,215.00	121,500
アドウェイズ	2,200	531.00	1,168,200
バリューコマース	1,400	1,432.00	2,004,800
インフォマート	16,900	466.00	7,875,400
J P ホールディングス	4,100	417.00	1,709,700
エコナックホールディングス	700	133.00	93,100
C L ホールディングス	400	855.00	342,000
プレステージ・インターナショナル	7,700	583.00	4,489,100
アミューズ	1,000	1,475.00	1,475,000
ドリームインキュベータ	600	2,790.00	1,674,000
クイック	1,100	2,400.00	2,640,000
T A C	400	198.00	79,200
電通グループ	15,900	3,630.00	57,717,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	1,128.00	676,800
ぴあ	600	3,315.00	1,989,000
イオンファンタジー	600	2,451.00	1,470,600
シーティーエス	2,100	627.00	1,316,700
ネクシィーズグループ	300	719.00	215,700
H. U. グループホールディングス	4,700	2,586.00	12,154,200
アルプス技研	1,600	2,712.00	4,339,200
日本空調サービス	1,800	787.00	1,416,600
オリエンタルランド	85,900	5,270.00	452,693,000
ダスキン	3,600	3,367.00	12,121,200
明光ネットワークジャパン	2,000	725.00	1,450,000
ファルコホールディングス	700	2,062.00	1,443,400
秀英予備校	200	310.00	62,000
ラウンドワン	15,300	558.00	8,537,400
リゾートトラスト	7,000	2,415.50	16,908,500
ビー・エム・エル	2,000	2,969.00	5,938,000
リソー教育	8,300	216.00	1,792,800

早稲田アカデミー	900	1,772.00	1,594,800
ユー・エス・エス	18,200	2,792.00	50,814,400
東京個別指導学院	1,900	456.00	866,400
サイバーエージェント	35,800	802.10	28,715,180
楽天グループ	139,000	590.80	82,121,200
クリーク・アンド・リバー社	800	2,035.00	1,628,000
SBIグローバルアセットマネジメント	3,100	581.00	1,801,100
テー・オー・ダブリュー	3,200	315.00	1,008,000
山田コンサルティンググループ	700	1,741.00	1,218,700
セントラルスポーツ	600	2,410.00	1,446,000
フルキャストホールディングス	1,600	1,787.00	2,859,200
エン・ジャパン	2,700	2,615.00	7,060,500
リソルホールディングス	100	5,310.00	531,000
テクノプロ・ホールディングス	9,500	3,527.00	33,506,500
アトラグループ	200	194.00	38,800
アイ・アールジャパンホールディングス	800	1,495.00	1,196,000
Keep 技研	1,000	6,870.00	6,870,000
ファーストロジック	200	486.00	97,200
三機サービス	100	1,144.00	114,400
Gunosy	1,300	677.00	880,100
デザインワン・ジャパン	200	135.00	27,000
イー・ガーディアン	600	1,541.00	924,600
リブセンス	400	259.00	103,600
ジャパンマテリアル	5,000	2,428.00	12,140,000
ベクトル	2,000	1,077.00	2,154,000
ウチヤマホールディングス	400	355.00	142,000
チャーム・ケア・コーポレーション	1,300	1,152.00	1,497,600
キャリアリンク	600	2,290.00	1,374,000
IBJ	1,300	683.00	887,900
アサンテ	800	1,637.00	1,309,600
バリューHR	1,400	1,576.00	2,206,400
M&Aキャピタルパートナーズ	1,300	2,385.00	3,100,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,008.00	705,600
ERIホールディングス	200	1,620.00	324,000
アビスト	100	2,975.00	297,500
シグマクシス・ホールディングス	2,200	1,326.00	2,917,200

ウィルグループ	1,300	1,109.00	1,441,700
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,100	137.00	150,700
メドピア	1,400	723.00	1,012,200
レアジョブ	200	899.00	179,800
リクルートホールディングス	120,100	5,915.00	710,391,500
エラン	2,100	1,090.00	2,289,000
土木管理総合試験所	400	323.00	129,200
日本郵政	190,700	1,243.00	237,040,100
ベルシステム24ホールディングス	1,800	1,760.00	3,168,000
鎌倉新書	1,400	530.00	742,000
SMN	200	280.00	56,000
一蔵	100	574.00	57,400
グローバルキッズCOMPANY	200	629.00	125,800
エアトリ	1,200	1,774.00	2,128,800
アトラエ	900	604.00	543,600
ストライク	700	4,240.00	2,968,000
ソラスト	4,400	576.00	2,534,400
セラク	500	1,252.00	626,000
インソース	3,400	828.00	2,815,200
ベイカレント・コンサルティング	11,900	4,881.00	58,083,900
Orchestra Holdings	400	1,023.00	409,200
アイモバイル	2,100	448.00	940,800
キャリアインデックス	300	209.00	62,700
MS-Japan	500	1,110.00	555,000
船場	200	909.00	181,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,300	2,307.00	12,227,100
フルテック	100	1,254.00	125,400
グリーンズ	300	1,753.00	525,900
ツナググループ・ホールディングス	300	905.00	271,500
GameWith	300	287.00	86,100
MS&Consulting	100	672.00	67,200
ウェルビー	900	804.00	723,600
エル・ティー・エス	200	2,734.00	546,800
ミダックホールディングス	1,000	1,858.00	1,858,000
キュービーネットホールディングス	800	1,448.00	1,158,400

R P Aホールディングス	2,300	268.00	616,400
スプリックス	300	773.00	231,900
マネジメントソリューションズ	700	3,090.00	2,163,000
プロレド・パートナーズ	400	398.00	159,200
a n d f a c t o r y	300	332.00	99,600
テノ.ホールディングス	100	431.00	43,100
フロンティア・マネジメント	400	1,470.00	588,000
ピアラ	200	300.00	60,000
コプロ・ホールディングス	300	1,498.00	449,400
ギークス	100	482.00	48,200
アンビスホールディングス	1,700	3,195.00	5,431,500
カーブスホールディングス	4,500	637.00	2,866,500
フォーラムエンジニアリング	2,200	791.00	1,740,200
F a s t F i t n e s s J a p a n	600	1,042.00	625,200
ダイレクトマーケティングミックス	1,700	445.00	756,500
ポピンズ	200	1,056.00	211,200
L I T A L I C O	1,200	2,063.00	2,475,600
アドバンテッジリスクマネジメント	500	481.00	240,500
リログループ	8,100	1,573.50	12,745,350
東祥	1,100	769.00	845,900
I D & Eホールディングス	1,000	3,280.00	3,280,000
ビーウィズ	400	2,091.00	836,400
T R Eホールディングス	3,100	1,034.00	3,205,400
人・夢・技術グループ	600	1,691.00	1,014,600
N I S S Oホールディングス	1,400	745.00	1,043,000
大栄環境	3,000	2,213.00	6,639,000
日本管財ホールディングス	1,700	2,520.00	4,284,000
M & A総研ホールディングス	800	4,350.00	3,480,000
エイチ・アイ・エス	4,700	1,810.00	8,507,000
ラックランド	700	2,625.00	1,837,500
共立メンテナンス	2,500	5,599.00	13,997,500
イチネンホールディングス	1,700	1,527.00	2,595,900
建設技術研究所	800	5,080.00	4,064,000
スペース	1,100	923.00	1,015,300
燦ホールディングス	1,500	1,086.00	1,629,000
スバル興業	100	13,330.00	1,333,000

東京テアトル	300	1,090.00	327,000	
タナベコンサルティンググループ	500	993.00	496,500	
ナガワ	500	6,960.00	3,480,000	
東京都競馬	1,400	4,350.00	6,090,000	
常磐興産	300	1,227.00	368,100	
カナモト	2,500	2,706.00	6,765,000	
ニシオホールディングス	1,500	3,815.00	5,722,500	
トランス・コスモス	2,000	2,930.00	5,860,000	
乃村工藝社	7,100	859.00	6,098,900	
藤田観光	700	4,520.00	3,164,000	
KNT-CTホールディングス	1,000	1,266.00	1,266,000	
トーカイ	1,400	1,964.00	2,749,600	
白洋舎	100	2,635.00	263,500	
セコム	16,500	10,125.00	167,062,500	
セントラル警備保障	900	2,461.00	2,214,900	
丹青社	3,200	858.00	2,745,600	
メイテックグループホールディングス	5,800	2,738.00	15,880,400	
応用地質	1,500	1,987.00	2,980,500	
船井総研ホールディングス	3,400	2,488.00	8,459,200	
進学会ホールディングス	200	264.00	52,800	
オオバ	600	888.00	532,800	
いであ	200	1,739.00	347,800	
学究社	700	1,947.00	1,362,900	
ベネッセホールディングス	5,400	2,608.50	14,085,900	
イオンディライト	1,800	3,560.00	6,408,000	
ナック	700	980.00	686,000	
ダイセキ	3,300	3,820.00	12,606,000	
ステップ	600	1,878.00	1,126,800	
合 計	23,761,000		52,293,397,800	

(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6月15日現在	2023年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	392,582,669	349,821,192
コール・ローン	2,404,087,335	3,573,095,627
株式	286,332,550,594	317,161,514,512
投資証券	6,058,893,330	6,842,571,441
派生商品評価勘定	150,652,465	71,076,298
未収入金	9,854,554	2,775,016
未収配当金	364,951,463	354,905,771
差入委託証拠金	725,937,219	571,985,363
流動資産合計	296,439,509,629	328,927,745,220
資産合計	296,439,509,629	328,927,745,220
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	168,335	117,681,005
未払金	-	10,744,272
未払解約金	69,512,256	128,736,772
未払利息	4,434	455
流動負債合計	69,685,025	257,162,504
負債合計	69,685,025	257,162,504
純資産の部		
元本等		
元本	60,758,637,464	61,539,821,052
剰余金		
剰余金又は欠損金(△)	235,611,187,140	267,130,761,664
元本等合計	296,369,824,604	328,670,582,716
純資産合計	296,369,824,604	328,670,582,716
負債純資産合計	296,439,509,629	328,927,745,220

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2023 年 6 月 15 日現在	2023 年 12 月 15 日現在
1.	期首	2022 年 12 月 16 日	2023 年 6 月 16 日
	期首元本額	60,264,747,727 円	60,758,637,464 円
	期首からの追加設定元本額	4,884,841,617 円	4,363,430,678 円
	期首からの一部解約元本額	4,390,951,880 円	3,582,247,090 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）	31,688,666,926 円	33,478,093,158 円
	DCインデックスバランス（株式20）	119,933,154 円	111,942,285 円
	DCインデックスバランス（株式40）	326,215,035 円	314,447,783 円
	DCインデックスバランス（株式60）	679,837,435 円	674,680,951 円
	DCインデックスバランス（株式80）	776,578,315 円	813,952,034 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	1,348,115,199 円	1,204,160,715 円
	日興五大陸株式ファンド	3,541,615,542 円	3,382,512,685 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）	12,785,673 円	13,022,622 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）	83,401,210 円	73,757,018 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）	5,827,084,962 円	5,867,931,474 円
グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	10,393,797,327 円	9,249,628,413 円	
Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	3,460,606 円	8,994,188 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）	1,898,165 円	375,283,492 円	
Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）	118,798,873 円	333,240,519 円	
Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	— 円	314,126 円	
Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	— 円	140,694 円	

国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,560,582,133 円	1,291,678,420 円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	17,639,406 円	15,330,884 円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	48,807,373 円	45,633,895 円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	76,872,757 円	72,579,204 円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	77,183,846 円	72,828,119 円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,055,363,527 円	4,139,668,373 円
計	60,758,637,464 円	61,539,821,052 円
2. 受益権の総数	60,758,637,464 口	61,539,821,052 口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

	自 2022 年 12 月 16 日 至 2023 年 6 月 15 日	自 2023 年 6 月 16 日 至 2023 年 12 月 15 日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	2023 年 6 月 15 日現在	2023 年 12 月 15 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6月15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	32,480,064,809
投資証券	202,797,894
合計	32,682,862,703

(2023年12月15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	33,018,272,506
投資証券	1,311,911,769
合計	34,330,184,275

(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6月15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	3,656,855,426	—	3,710,757,191	53,901,765
合計		3,656,855,426	—	3,710,757,191	53,901,765

(2023年12月15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	4,579,056,186	—	4,648,059,834	69,003,648
合計		4,579,056,186	—	4,648,059,834	69,003,648

(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6月15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	2,441,648,990	—	2,538,231,355	96,582,365
	米ドル	2,054,784,600	—	2,136,243,960	81,459,360
	ユーロ	386,864,390	—	401,987,395	15,123,005
合計		2,441,648,990	—	2,538,231,355	96,582,365

(2023年12月15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	3,836,719,910	—	3,721,111,555	△115,608,355
	米ドル	3,218,301,700	—	3,114,078,060	△104,223,640
	ユーロ	618,418,210	—	607,033,495	△11,384,715
合計		3,836,719,910	—	3,721,111,555	△115,608,355

(注) 1. 時価の算定方法

- (1) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
- ① 同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
- ② 同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
- ・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
- (2) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
- (3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年6月15日現在		2023年12月15日現在	
1口当たり純資産額	4.8778円	1口当たり純資産額	5.3408円
(1万口当たり純資産額)	(48,778円)	(1万口当たり純資産額)	(53,408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	12,750	35.74	455,685.00	
	BAKER HUGHES CO	40,615	33.54	1,362,227.10	
	CHENIERE ENERGY INC	9,500	171.54	1,629,630.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	3,750	75.77	284,137.50	
	CHEVRON CORP	73,691	149.93	11,048,491.63	
	CONOCOPHILLIPS	49,036	114.95	5,636,688.20	
	COTERRA ENERGY INC	32,460	25.57	830,002.20	
	DEVON ENERGY CORPORATION	25,260	44.99	1,136,447.40	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	6,540	153.44	1,003,497.60	
	EOG RESOURCES INC	23,472	120.60	2,830,723.20	
	EQT CORP	17,050	38.82	661,881.00	
	EXXON MOBIL CORP	162,971	101.58	16,554,594.18	
	HALLIBURTON CO	37,607	35.89	1,349,715.23	
	HESS CORP	10,870	143.10	1,555,497.00	
	HF SINCLAIR CORP	5,940	55.53	329,848.20	
	KINDER MORGAN INC	81,490	17.69	1,441,558.10	
	MARATHON OIL CORP	28,380	24.44	693,607.20	
	MARATHON PETROLEUM CORP	16,742	150.89	2,526,200.38	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	28,351	58.76	1,665,904.76	
	ONEOK INC	24,500	68.61	1,680,945.00	
	OVINTIV INC	9,400	43.58	409,652.00	
	PHILLIPS 66	18,855	130.11	2,453,224.05	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,130	228.45	2,085,748.50	
	SCHLUMBERGER LTD	57,921	52.42	3,036,218.82	
	TARGA RESOURCES CORP	8,180	86.28	705,770.40	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	245	1,603.95	392,967.75	
	VALERO ENERGY CORP	14,682	129.18	1,896,620.76	
WILLIAMS COS INC	47,324	34.66	1,640,249.84		
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,115	270.81	2,468,433.15		
ALBEMARLE CORP	4,750	145.89	692,977.50		
AMCOR PLC	65,600	9.71	636,976.00		

AVERY DENNISON CORP	3,040	198.95	604,808.00
BALL CORP	12,500	59.14	739,250.00
CELANESE CORP	4,090	151.87	621,148.30
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,820	76.88	601,201.60
CLEVELAND-CLIFFS INC	21,150	18.87	399,100.50
CORTEVA INC	28,172	46.54	1,311,124.88
CROWN HOLDINGS INC	4,565	90.83	414,638.95
DOW INC	28,025	54.23	1,519,795.75
DUPONT DE NEMOURS INC	19,162	73.42	1,406,874.04
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,815	89.68	431,809.20
ECOLAB INC	10,200	196.70	2,006,340.00
FMC CORP	4,840	60.23	291,513.20
FREEPORT-MCMORAN INC	56,338	41.97	2,364,505.86
INTERNATIONAL PAPER CO	13,670	37.67	514,948.90
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,675	80.19	856,028.25
LINDE PLC	19,820	409.72	8,120,650.40
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,570	94.60	999,922.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,720	493.05	1,341,096.00
MOSAIC CO/THE	13,580	37.10	503,818.00
NEWMONT CORP	49,002	41.15	2,016,432.30
NUCOR CORP	9,959	170.85	1,701,495.15
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	167.35	599,113.00
PPG INDUSTRIES INC	9,394	149.15	1,401,115.10
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	2,770	269.87	747,539.90
RPM INTERNATIONAL INC	4,960	112.22	556,611.20
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,626	306.77	2,952,968.02
STEEL DYNAMICS INC	6,010	119.13	715,971.30
VULCAN MATERIALS CO	5,563	224.76	1,250,339.88
WESTLAKE CORP	1,360	139.77	190,087.20
WESTROCK CO	9,989	43.15	431,025.35
3M CO	23,576	107.04	2,523,575.04
AECOM	4,930	93.29	459,919.70
AERCAP HOLDINGS NV	9,760	74.94	731,414.40
ALLEGION PLC	3,340	118.58	396,057.20
AMETEK INC	9,033	164.07	1,482,044.31
AXON ENTERPRISE INC	3,320	253.12	840,358.40

BOEING CO/THE	23,182	256.24	5,940,155.68
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	5,240	168.37	882,258.80
CARLISLE COS INC	2,250	309.09	695,452.50
CARRIER GLOBAL CORP	33,088	58.81	1,945,905.28
CATERPILLAR INC	20,896	285.17	5,958,912.32
CNH INDUSTRIAL NV	40,400	11.75	474,700.00
CUMMINS INC	5,535	248.27	1,374,174.45
DEERE & CO	11,305	388.42	4,391,088.10
DOVER CORP	5,350	155.29	830,801.50
EATON CORP PLC	16,196	237.70	3,849,789.20
EMERSON ELECTRIC CO	22,490	96.54	2,171,184.60
FASTENAL CO	22,796	64.23	1,464,187.08
FERGUSON PLC	8,440	189.06	1,595,666.40
FORTIVE CORP	14,854	73.07	1,085,381.78
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	5,050	79.75	402,737.50
GENERAL DYNAMICS CORP	9,397	251.15	2,360,056.55
GENERAL ELECTRIC CO	44,157	121.35	5,358,451.95
GRACO INC	6,310	85.74	541,019.40
HEICO CORP	1,800	183.01	329,418.00
HEICO CORP-CLASS A	3,120	146.62	457,454.40
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	27,006	203.41	5,493,290.46
HOWMET AEROSPACE INC	17,943	52.78	947,031.54
HUBBELL INC	2,320	326.79	758,152.80
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,530	255.83	391,419.90
IDEX CORP	2,880	214.93	618,998.40
ILLINOIS TOOL WORKS	12,365	259.30	3,206,244.50
INGERSOLL-RAND INC	16,398	75.31	1,234,933.38
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,570	39.87	261,945.90
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	27,484	54.10	1,486,884.40
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,750	206.60	1,601,150.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,385	444.07	615,036.95
LOCKHEED MARTIN CORP	9,246	445.27	4,116,966.42
MASCO CORP	9,849	69.32	682,732.68
NORDSON CORP	2,345	250.00	586,250.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,784	463.66	2,681,809.44
OTIS WORLDWIDE CORP	17,124	90.67	1,552,633.08

OWENS CORNING	3,550	152.78	542,369.00
PACCAR INC	20,706	95.81	1,983,841.86
PARKER HANNIFIN CORP	5,265	455.41	2,397,733.65
PENTAIR PLC	6,918	72.32	500,309.76
QUANTA SERVICES INC	5,710	215.80	1,232,218.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,618	306.85	1,417,033.30
RTX CORP	58,756	81.86	4,809,766.16
SMITH (A.O.) CORP	5,020	80.59	404,561.80
SNAP-ON INC	2,525	289.20	730,230.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,806	101.49	589,250.94
TEXTRON INC	7,956	79.62	633,456.72
TORO CO	3,890	88.24	343,253.60
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,066	238.90	2,165,867.40
TRANSDIGM GROUP INC	2,180	987.00	2,151,660.00
UNITED RENTALS INC	2,805	569.43	1,597,251.15
VERTIV HOLDINGS CO	13,800	47.24	651,912.00
WABTEC CORP	7,130	121.80	868,434.00
WATSCO INC	1,240	417.00	517,080.00
WW GRAINGER INC	1,847	828.81	1,530,812.07
XYLEM INC	9,468	110.93	1,050,285.24
AUTOMATIC DATA PROCESSING	16,771	235.97	3,957,452.87
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,070	125.22	634,865.40
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	4,400	193.64	852,016.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,280	69.42	366,537.60
CINTAS CORP	3,592	563.42	2,023,804.64
COPART INC	35,140	49.16	1,727,482.40
EQUIFAX INC	5,024	246.69	1,239,370.56
JACOBS SOLUTIONS INC	4,880	128.90	629,032.00
LEIDOS HOLDINGS INC	4,960	108.69	539,102.40
PAYCHEX INC	13,072	126.83	1,657,921.76
PAYCOM SOFTWARE INC	2,765	203.71	563,258.15
PAYLOCITY HOLDING CORP	1,730	165.36	286,072.80
REPUBLIC SERVICES INC	8,920	162.69	1,451,194.80
ROBERT HALF INC	4,415	86.62	382,427.30
ROLLINS INC	14,385	42.74	614,814.90
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	60.62	513,451.40

TRANSUNION	7,940	69.38	550,877.20
VERALTO CORP	9,343	79.33	741,180.19
VERISK ANALYTICS INC	5,810	235.43	1,367,848.30
WASTE CONNECTIONS INC	10,606	147.28	1,562,051.68
WASTE MANAGEMENT INC	16,514	176.67	2,917,528.38
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,930	85.04	419,247.20
CSX CORP	81,669	33.84	2,763,678.96
DELTA AIR LINES INC	5,705	42.44	242,120.20
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,467	123.52	798,803.84
FEDEX CORP	9,448	279.46	2,640,338.08
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	77,000	3.14	241,780.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,140	201.73	633,432.20
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,140	57.85	355,199.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,745	233.77	2,278,088.65
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,955	382.52	1,512,866.60
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	29.76	162,787.20
U-HAUL HOLDING CO	3,375	63.41	214,008.75
UBER TECHNOLOGIES INC	75,200	62.50	4,700,000.00
UNION PACIFIC CORP	24,716	242.86	6,002,527.76
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	29,587	162.36	4,803,745.32
APTIV PLC	11,080	88.85	984,458.00
BORGWARNER INC	9,120	35.83	326,769.60
FORD MOTOR COMPANY	159,205	12.08	1,923,196.40
GENERAL MOTORS CORP	52,765	36.25	1,912,731.25
LEAR CORP	2,290	138.49	317,142.10
LUCID GROUP INC	36,360	5.14	186,890.40
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	27,210	22.43	610,320.30
TESLA INC	116,365	251.05	29,213,433.25
DECKERS OUTDOOR CORP	1,220	697.84	851,364.80
DR HORTON INC	12,896	153.13	1,974,764.48
GARMIN LTD	5,865	125.60	736,644.00
HASBRO INC	5,188	51.29	266,092.52
LENNAR CORP-CL A	10,040	154.81	1,554,292.40
LULULEMON ATHLETICA INC	4,710	489.30	2,304,603.00
NIKE INC -CL B	49,948	121.02	6,044,706.96
NVR INC	148	6,934.40	1,026,291.20

PULTE GROUP INC	8,850	104.88	928,188.00
VF CORP	12,170	20.39	248,146.30
AIRBNB INC-CLASS A	17,500	147.26	2,577,050.00
BOOKING HOLDINGS INC	1,498	3,440.30	5,153,569.40
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,970	48.63	387,581.10
CARNIVAL CORP	38,787	18.78	728,419.86
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,120	2,275.70	2,548,784.00
DARDEN RESTAURANTS INC	4,853	163.09	791,475.77
DOMINO'S PIZZA INC	1,375	402.85	553,918.75
DOORDASH INC - A	10,020	101.76	1,019,635.20
DRAFTKINGS INC-CL A	15,800	36.17	571,486.00
EXPEDIA GROUP INC	6,032	146.83	885,678.56
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,650	176.76	1,882,494.00
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,680	130.37	219,021.60
LAS VEGAS SANDS CORP	14,390	48.61	699,497.90
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,673	220.09	2,349,020.57
MCDONALD'S CORP	29,561	290.02	8,573,281.22
MGM RESORTS INTERNATIONAL	12,900	44.66	576,114.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,358	121.39	1,135,967.62
STARBUCKS CORP	46,124	97.84	4,512,772.16
VAIL RESORTS INC	1,520	230.16	349,843.20
WYNN RESORTS LTD	4,180	89.80	375,364.00
YUM! BRANDS INC	11,394	131.11	1,493,867.34
ALPHABET INC-CL A	241,600	131.94	31,876,704.00
ALPHABET INC-CL C	212,340	133.20	28,283,688.00
CHARTER COMMUNICATION-A	3,926	383.91	1,507,230.66
COMCAST CORP-CLASS A	168,444	44.64	7,519,340.16
ELECTRONIC ARTS INC	10,834	140.85	1,525,968.90
FOX CORP - CLASS A	13,084	30.07	393,435.88
FOX CORP- CLASS B	5,466	28.00	153,048.00
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,096	32.74	494,243.04
LIBERTY BROADBAND-C	4,850	78.30	379,755.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	7,780	63.72	495,741.60
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW C	5,726	28.24	161,702.24
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,420	93.07	597,509.40
MATCH GROUP INC	10,912	34.53	376,791.36

META PLATFORMS INC-CLASS A	90,410	333.17	30,121,899.70
NETFLIX INC	18,000	469.83	8,456,940.00
NEWS CORP - CLASS A	14,750	23.30	343,675.00
OMNICOM GROUP	9,397	86.43	812,182.71
PARAMOUNT GLOBAL	22,823	16.71	381,372.33
PINTEREST INC- CLASS A	22,100	37.01	817,921.00
ROBLOX CORP -CLASS A	19,130	44.52	851,667.60
ROKU INC	4,700	102.88	483,536.00
SEA LTD-ADR	14,470	37.65	544,795.50
SIRIUS XM HOLDINGS INC	30,280	5.69	172,293.20
SNAP INC - A	45,300	16.94	767,382.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,240	163.89	1,186,563.60
THE WALT DISNEY CO.	74,672	93.94	7,014,687.68
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	19,370	76.08	1,473,669.60
WARNER BROS DISCOVERY INC	94,890	12.49	1,185,176.10
AMAZON.COM INC	377,970	147.42	55,720,337.40
AUTOZONE INC	722	2,636.69	1,903,690.18
BATH & BODY WORKS INC	9,270	41.71	386,651.70
BEST BUY CO INC	7,814	77.50	605,585.00
BURLINGTON STORES INC	2,585	187.90	485,721.50
CARMAX INC	5,949	75.00	446,175.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,270	145.38	330,012.60
EBAY INC	21,897	42.65	933,907.05
ETSY INC	4,800	83.26	399,648.00
GENUINE PARTS CO	5,751	139.87	804,392.37
GLOBAL-E ONLINE LTD	3,050	38.71	118,065.50
HOME DEPOT INC	40,665	351.81	14,306,353.65
LKQ CORP	10,260	46.64	478,526.40
LOWE'S COS INC	23,772	225.54	5,361,536.88
MERCADOLIBRE INC	1,905	1,603.51	3,054,686.55
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,420	951.12	2,301,710.40
POOL CORP	1,540	396.30	610,302.00
ROSS STORES INC	13,762	134.59	1,852,227.58
TJX COMPANIES INC	46,636	89.95	4,194,908.20
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,530	224.10	1,015,173.00
ULTA BEAUTY INC	2,100	494.63	1,038,723.00

ALBERTSONS COS INC - CLASS A	17,570	22.62	397,433.40
COSTCO WHOLESALE CORP	17,934	630.78	11,312,408.52
DOLLAR GENERAL CORP	8,725	131.02	1,143,149.50
DOLLAR TREE INC	8,986	129.84	1,166,742.24
KROGER CO	26,880	43.59	1,171,699.20
SYSCO CORP	19,996	74.20	1,483,703.20
TARGET CORP	17,980	141.14	2,537,697.20
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	30,782	25.14	773,859.48
WALMART INC	59,932	152.17	9,119,852.44
ALTRIA GROUP INC	72,578	42.11	3,056,259.58
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,143	76.42	1,692,168.06
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,770	58.42	746,023.40
BUNGE GLOBAL SA	5,847	105.31	615,747.57
CAMPBELL SOUP CO	7,885	44.41	350,172.85
CELSIUS HOLDINGS INC	6,050	50.90	307,945.00
COCA-COLA CO/THE	167,032	59.04	9,861,569.28
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	7,710	64.93	500,610.30
CONAGRA BRANDS INC	20,640	29.92	617,548.80
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,560	241.03	1,581,156.80
DARLING INGREDIENTS INC	5,880	49.99	293,941.20
GENERAL MILLS INC	23,059	66.32	1,529,272.88
HERSHEY CO/THE	5,945	186.21	1,107,018.45
HORMEL FOODS CORP	15,290	31.92	488,056.80
JM SMUCKER CO/THE	4,100	125.36	513,976.00
KELLANOVA	11,098	54.83	608,503.34
KEURIG DR PEPPER INC	39,700	32.21	1,278,737.00
KRAFT HEINZ CO/THE	38,121	37.00	1,410,477.00
LAMB WESTON HOLDING INC	6,150	104.37	641,875.50
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,420	68.28	711,477.60
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,570	63.05	477,288.50
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	55,295	70.70	3,909,356.50
MONSTER BEVERAGE CORP	31,880	55.56	1,771,252.80
PEPSICO INC	55,711	168.25	9,373,375.75
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	62,928	94.67	5,957,393.76
TYSON FOODS INC-CL A	10,906	52.33	570,710.98
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,310	91.36	941,921.60

CLOROX COMPANY	5,266	142.18	748,719.88
COLGATE-PALMOLIVE CO	33,160	76.27	2,529,113.20
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,200	146.06	1,343,752.00
KENVUE INC	75,500	21.06	1,590,030.00
KIMBERLY-CLARK CORP	13,663	120.84	1,651,036.92
PROCTER & GAMBLE CO	95,789	144.66	13,856,836.74
ABBOTT LABORATORIES	70,436	108.60	7,649,349.60
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,060	257.02	786,481.20
BAXTER INTERNATIONAL INC	19,439	38.95	757,149.05
BECTON DICKINSON AND CO	11,547	238.51	2,754,074.97
BOSTON SCIENTIFIC CORP	59,988	56.18	3,370,125.84
CARDINAL HEALTH INC	10,305	102.69	1,058,220.45
CENCORA INC	7,014	201.50	1,413,321.00
CENTENE CORP	22,367	75.51	1,688,932.17
CIGNA GROUP/THE	12,010	298.64	3,586,666.40
COOPER COS INC/THE	2,025	367.25	743,681.25
CVS HEALTH CORP	52,598	74.49	3,918,025.02
DAVITA INC	2,108	107.18	225,935.44
DEXCOM INC	15,500	123.10	1,908,050.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	24,120	77.76	1,875,571.20
ELEVANCE HEALTH INC	9,616	479.87	4,614,429.92
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	16,705	75.92	1,268,243.60
HCA HEALTHCARE INC	8,190	275.85	2,259,211.50
HENRY SCHEIN INC	5,280	75.26	397,372.80
HOLOGIC INC	9,858	71.09	700,805.22
HUMANA INC	5,055	469.05	2,371,047.75
IDEXX LABORATORIES INC	3,360	554.18	1,862,044.80
INSULET CORP	2,745	206.81	567,693.45
INTUITIVE SURGICAL INC	14,375	326.18	4,688,837.50
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,415	223.06	761,749.90
MCKESSON CORP	5,439	441.68	2,402,297.52
MEDTRONIC PLC	54,438	83.43	4,541,762.34
MOLINA HEALTHCARE INC	2,655	374.80	995,094.00
QUEST DIAGNOSTICS	4,386	137.26	602,022.36
RESMED INC	5,830	172.64	1,006,491.20
STERIS PLC	4,240	210.45	892,308.00

STRYKER CORP	13,873	297.10	4,121,668.30
TELEFLEX INC	1,820	256.21	466,302.20
UNITEDHEALTH GROUP INC	37,665	534.24	20,122,149.60
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,920	151.47	290,822.40
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	5,790	182.84	1,058,643.60
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,412	118.53	997,074.36
ABBVIE INC	71,796	154.88	11,119,764.48
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,750	137.96	1,758,990.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,040	186.48	939,859.20
AMGEN INC	21,591	276.32	5,966,025.12
AVANTOR INC	27,110	22.42	607,806.20
BIO-RAD LABORATORIES-A	950	311.99	296,390.50
BIO-TECHNE CORP	6,730	75.04	505,019.20
BIOGEN INC	5,643	256.54	1,447,655.22
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,380	97.62	818,055.60
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	85,225	51.47	4,386,530.75
CATALENT INC	6,520	41.36	269,667.20
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,910	229.26	437,886.60
DANAHER CORP	28,649	229.25	6,567,783.25
ELI LILLY & CO	32,779	573.67	18,804,328.93
EXACT SCIENCES CORP	7,370	67.80	499,686.00
GILEAD SCIENCES INC	50,624	81.78	4,140,030.72
ILLUMINA INC	6,275	131.49	825,099.75
INCYTE CORP	7,670	63.84	489,652.80
IQVIA HOLDINGS INC	7,438	230.55	1,714,830.90
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,450	123.02	301,399.00
JOHNSON & JOHNSON	98,151	156.87	15,396,947.37
MERCK & CO. INC.	103,103	105.88	10,916,545.64
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	890	1,224.70	1,089,983.00
MODERNA INC	14,425	85.87	1,238,674.75
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,630	121.35	440,500.50
PFIZER INC	230,520	26.13	6,023,487.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,385	876.00	3,841,260.00
REPLIGEN CORP	2,250	180.41	405,922.50
REVVITY INC	4,910	101.31	497,432.10
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	14,330	28.63	410,267.90

TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43,590	10.23	445,925.70
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	15,754	521.52	8,216,026.08
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,900	254.09	482,771.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10,455	406.60	4,251,003.00
VIATRIS INC	45,819	10.39	476,059.41
WATERS CORP	2,331	321.34	749,043.54
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,960	358.01	1,059,709.60
ZOETIS INC	18,785	200.09	3,758,690.65
BANK OF AMERICA CORP	290,489	33.94	9,859,196.66
CITIGROUP INC	78,467	50.24	3,942,182.08
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,310	33.63	649,395.30
FIFTH THIRD BANCORP	26,459	35.14	929,769.26
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	450	1,437.48	646,866.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	68,620	13.18	904,411.60
JPMORGAN CHASE & CO	118,150	163.99	19,375,418.50
KEYCORP	36,108	14.77	533,315.16
M & T BANK CORP	6,913	145.06	1,002,799.78
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	16,200	153.31	2,483,622.00
REGIONS FINANCIAL CORP	35,844	19.60	702,542.40
TRUIST FINANCIAL CORP	53,220	37.64	2,003,200.80
US BANCORP	59,781	45.33	2,709,872.73
WELLS FARGO & CO	149,410	50.51	7,546,699.10
ALLY FINANCIAL INC	12,240	34.78	425,707.20
AMERICAN EXPRESS CO	25,644	178.86	4,586,685.84
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,225	379.98	1,605,415.50
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,800	93.13	1,471,454.00
ARES MANAGEMENT CORP-A	7,150	114.10	815,815.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	30,612	51.62	1,580,191.44
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	53,075	358.12	19,007,219.00
BLACKROCK INC	6,105	807.13	4,927,528.65
BLACKSTONE INC	29,080	128.47	3,735,907.60
BLOCK INC	23,390	74.76	1,748,636.40
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15,435	129.20	1,994,202.00
CARLYLE GROUP INC/THE	7,650	41.99	321,223.50
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,940	172.28	678,783.20
CME GROUP INC	14,740	210.16	3,097,758.40

COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	6,900	153.63	1,060,047.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,750	107.72	1,157,990.00
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,420	34.46	496,913.20
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,590	454.00	721,860.00
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	24,198	60.36	1,460,591.28
FISERV INC	24,884	135.01	3,359,588.84
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,880	272.10	783,648.00
FRANKLIN RESOURCES INC	11,755	29.37	345,244.35
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	55.00	137,500.00
GLOBAL PAYMENTS INC	10,989	125.69	1,381,207.41
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,378	383.47	5,130,061.66
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	24,020	123.33	2,962,386.60
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,200	166.90	534,080.00
KKR & CO INC -A	24,780	83.01	2,056,987.80
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,185	214.83	684,233.55
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,545	284.16	439,027.20
MASTERCARD INC - A	34,225	418.56	14,325,216.00
MOODY'S CORP	6,502	391.62	2,546,313.24
MORGAN STANLEY	50,403	91.04	4,588,689.12
MSCI INC	3,175	542.11	1,721,199.25
NASDAQ INC	15,895	56.11	891,868.45
NORTHERN TRUST CORP	9,930	85.93	853,284.90
PAYPAL HOLDINGS INC	42,267	61.87	2,615,059.29
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,470	110.88	939,153.60
ROBINHOOD MARKETS INC - A	17,810	12.09	215,322.90
S&P GLOBAL INC	13,305	437.78	5,824,662.90
SCHWAB (CHARLES) CORP	61,603	70.94	4,370,116.82
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,375	62.92	275,275.00
STATE STREET CORP	12,947	78.55	1,016,986.85
SYNCHRONY FINANCIAL	19,010	37.74	717,437.40
T ROWE PRICE GROUP INC	8,675	107.32	931,001.00
TOAST INC-CLASS A	12,760	17.24	219,982.40
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,200	87.94	369,348.00
VISA INC-CLASS A SHARES	65,432	258.73	16,929,221.36
AFLAC INC	23,424	81.28	1,903,902.72
ALLSTATE CORP	10,513	139.24	1,463,830.12

AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,660	121.90	324,254.00
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	30,345	66.49	2,017,639.05
AON PLC	8,567	318.03	2,724,563.01
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,535	74.67	1,085,328.45
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,610	227.04	1,954,814.40
ASSURANT INC	1,960	164.30	322,028.00
BROWN & BROWN INC	9,090	71.96	654,116.40
CHUBB LTD	16,685	220.51	3,679,209.35
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,350	104.94	771,309.00
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	940	321.44	302,153.60
EVEREST GROUP LTD	1,989	360.78	717,591.42
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	11,071	48.23	533,954.33
GLOBE LIFE INC	3,586	122.64	439,787.04
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,382	80.33	994,646.06
LOEWS CORP	7,145	68.69	490,790.05
MARKEL GROUP INC	530	1,385.24	734,177.20
MARSH & MCLENNAN COS	19,918	191.27	3,809,715.86
METLIFE INC	26,335	66.90	1,761,811.50
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,520	79.58	757,601.60
PROGRESSIVE CORP	23,760	153.55	3,648,348.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,962	105.21	1,574,152.02
TRAVELERS COS INC/THE	8,889	182.77	1,624,642.53
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,198	237.93	998,830.14
WR BERKLEY CORP	8,091	71.17	575,836.47
ACCENTURE PLC-CL A	25,538	342.73	8,752,638.74
ADOBE INC	18,489	584.64	10,809,408.96
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,030	118.33	713,529.90
ANSYS INC	3,515	294.90	1,036,573.50
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,300	206.66	268,658.00
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	6,020	221.92	1,335,958.40
AUTODESK INC	8,720	240.81	2,099,863.20
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,530	51.29	386,213.70
BILL HOLDINGS INC	3,910	77.28	302,164.80
CADENCE DESIGN SYS INC	11,430	270.10	3,087,243.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,840	144.80	556,032.00
CLOUDFLARE INC-CLASS A	11,830	84.66	1,001,527.80

COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	20,318	74.68	1,517,348.24
CONFLUENT INC-CLASS A	6,870	25.72	176,696.40
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	8,990	252.68	2,271,593.20
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,650	201.25	332,062.50
DATADOG INC-CLASS A	10,880	120.65	1,312,672.00
DOCUSIGN INC	8,320	56.12	466,918.40
DROPBOX INC-CLASS A	11,660	28.94	337,440.40
DYNATRACE INC	9,850	54.63	538,105.50
EPAM SYSTEMS INC	2,280	291.46	664,528.80
FAIR ISAAC CORP	970	1,129.59	1,095,702.30
FORTINET INC	26,965	57.05	1,538,353.25
GARTNER INC	3,050	454.01	1,384,730.50
GEN DIGITAL INC	24,365	22.95	559,176.75
GODADDY INC-CLASS A	6,020	104.93	631,678.60
HUBSPOT INC	1,885	553.35	1,043,064.75
INTL BUSINESS MACHINES CORP	36,812	162.91	5,997,042.92
INTUIT INC	11,386	601.18	6,845,035.48
MANHATTAN ASSOCIATES INC	2,350	215.95	507,482.50
MICROSOFT CORP	287,224	365.93	105,103,878.32
MONDAY.COM LTD	980	190.77	186,954.60
MONGODB INC	2,820	419.24	1,182,256.80
OKTA INC	6,340	81.06	513,920.40
ORACLE CORP	66,773	100.31	6,697,999.63
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	76,690	18.21	1,396,524.90
PALO ALTO NETWORKS INC	12,635	300.44	3,796,059.40
PTC INC	5,250	171.24	899,010.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,200	538.83	2,263,086.00
SALESFORCE INC	39,656	257.21	10,199,919.76
SERVICENOW INC	8,290	680.39	5,640,433.10
SNOWFLAKE INC-CLASS A	11,660	200.86	2,342,027.60
SPLUNK INC	6,120	151.87	929,444.40
SYNOPSYS INC	6,187	551.45	3,411,821.15
TWILIO INC - A	7,225	75.82	547,799.50
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,830	410.20	750,666.00
UIPATH INC - CLASS A	17,970	25.67	461,289.90
UNITY SOFTWARE INC	9,650	38.28	369,402.00

VERISIGN INC	3,690	210.49	776,708.10
WIX.COM LTD	2,280	112.06	255,496.80
WORKDAY INC-CLASS A	8,580	270.78	2,323,292.40
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	9,630	72.14	694,708.20
ZSCALER INC	3,630	216.40	785,532.00
AMPHENOL CORP-CL A	25,480	98.81	2,517,678.80
APPLE INC	636,654	198.11	126,127,523.94
ARISTA NETWORKS INC	10,420	231.03	2,407,332.60
CDW CORP/DE	5,895	220.44	1,299,493.80
CISCO SYSTEMS INC	164,940	49.44	8,154,633.60
CORNING INC	33,518	30.57	1,024,645.26
DELL TECHNOLOGIES -C	11,022	72.43	798,323.46
F5 INC	2,385	176.92	421,954.20
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	50,105	17.06	854,791.30
HP INC	34,495	30.93	1,066,930.35
JABIL INC	4,990	136.42	680,735.80
JUNIPER NETWORKS INC	13,453	29.59	398,074.27
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,160	158.72	1,136,435.20
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,880	315.82	2,172,841.60
NETAPP INC	8,246	89.21	735,625.66
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,794	85.33	665,062.02
SUPER MICRO COMPUTER INC	1,790	294.40	526,976.00
TE CONNECTIVITY LTD	12,995	143.34	1,862,703.30
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,020	428.17	864,903.40
TRIMBLE INC	9,520	51.78	492,945.60
WESTERN DIGITAL CORP	11,688	51.15	597,841.20
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,075	272.16	564,732.00
AT&T INC	289,987	16.65	4,828,283.55
LIBERTY GLOBAL LTD-C	10,361	17.14	177,587.54
T-MOBILE US INC	21,939	156.87	3,441,570.93
VERIZON COMMUNICATIONS INC	170,337	37.87	6,450,662.19
AES CORP	27,958	19.63	548,815.54
ALLIANT ENERGY CORP	12,150	52.19	634,108.50
AMEREN CORPORATION	10,152	75.02	761,603.04
AMERICAN ELECTRIC POWER	22,348	83.33	1,862,258.84
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,705	134.49	1,036,245.45

ATMOS ENERGY CORP	6,760	115.39	780,036.40
CENTERPOINT ENERGY INC	23,972	29.70	711,968.40
CMS ENERGY CORP	11,090	58.96	653,866.40
CONSOLIDATED EDISON INC	14,236	91.91	1,308,430.76
CONSTELLATION ENERGY	13,168	115.60	1,522,220.80
DOMINION ENERGY INC	33,331	49.16	1,638,551.96
DTE ENERGY COMPANY	8,318	112.43	935,192.74
DUKE ENERGY CORP	31,346	98.31	3,081,625.26
EDISON INTERNATIONAL	16,329	70.32	1,148,255.28
ENTERGY CORP	7,967	103.27	822,752.09
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,210	37.10	415,891.00
EVERGY INC	8,720	53.37	465,386.40
EVERSOURCE ENERGY	14,310	63.53	909,114.30
EXELON CORP	39,706	37.90	1,504,857.40
FIRSTENERGY CORP	23,295	37.87	882,181.65
NEXTERA ENERGY INC	83,860	62.78	5,264,730.80
NISOURCE INC	15,610	26.68	416,474.80
NRG ENERGY INC	8,760	48.21	422,319.60
P G & E CORP	85,070	17.90	1,522,753.00
PPL CORP	30,338	27.04	820,339.52
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	19,888	62.98	1,252,546.24
SEMPRA	24,864	76.48	1,901,598.72
SOUTHERN CO	44,335	71.50	3,169,952.50
VISTRA CORP	14,720	37.49	551,852.80
WEC ENERGY GROUP INC	12,220	84.62	1,034,056.40
XCEL ENERGY INC	22,174	62.57	1,387,427.18
ADVANCED MICRO DEVICES	65,944	138.00	9,100,272.00
ANALOG DEVICES INC	20,377	200.17	4,078,864.09
APPLIED MATERIALS INC	34,063	161.74	5,509,349.62
BROADCOM INC	18,090	1,106.49	20,016,404.10
ENPHASE ENERGY INC	5,440	120.22	653,996.80
ENTEGRIS INC	5,660	119.25	674,955.00
FIRST SOLAR INC	4,260	158.25	674,145.00
INTEL CORP	170,952	45.18	7,723,611.36
KLA CORP	5,589	582.42	3,255,145.38
LAM RESEARCH CORP	5,402	767.21	4,144,468.42

	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	5,150	69.52	358,028.00	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	36,844	59.29	2,184,480.76	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,028	92.96	2,047,722.88	
	MICRON TECHNOLOGY INC	44,977	82.19	3,696,659.63	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,820	637.39	1,160,049.80	
	NVIDIA CORP	100,580	483.50	48,630,430.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	10,447	232.68	2,430,807.96	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	17,340	86.21	1,494,881.40	
	QORVO INC	4,240	112.55	477,212.00	
	QUALCOMM INC	45,592	141.50	6,451,268.00	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,440	113.41	730,360.40	
	TERADYNE INC	6,190	105.39	652,364.10	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	37,102	168.78	6,262,075.56	
	CBRE GROUP INC - A	12,560	91.07	1,143,839.20	
	COSTAR GROUP INC	16,800	88.25	1,482,600.00	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,500	3.32	134,460.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	6,370	55.57	353,980.90	
	米ドル小計	13,828,351		1,659,001,813.67 (236,407,758,447)	
加ドル	ARC RESOURCES LTD	25,510	19.72	503,057.20	
	CAMECO CORP	16,352	61.98	1,013,496.96	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	45,034	86.68	3,903,547.12	
	CENOVUS ENERGY INC	57,213	22.42	1,282,715.46	
	ENBRIDGE INC	86,537	47.67	4,125,218.79	
	IMPERIAL OIL LTD	8,922	75.75	675,841.50	
	KEYERA CORP	8,460	32.70	276,642.00	
	MEG ENERGY CORP	11,500	24.27	279,105.00	
	PARKLAND CORP	6,170	42.89	264,631.30	
	PEMBINA PIPELINE CORP	23,552	44.80	1,055,129.60	
	SUNCOR ENERGY INC	53,489	41.92	2,242,258.88	
	TC ENERGY CORP	41,663	52.43	2,184,391.09	
	TOURMALINE OIL CORP	12,040	60.15	724,206.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	21,496	73.11	1,571,572.56	
	BARRICK GOLD CORP	69,624	23.68	1,648,696.32	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	60.18	346,035.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	10.30	233,295.00	

FRANCO-NEVADA CORP	8,125	150.28	1,221,025.00
IVANHOE MINES LTD-CL A	24,510	12.95	317,404.50
KINROSS GOLD CORP	46,025	8.21	377,865.25
LUNDIN MINING CORP	25,010	10.81	270,358.10
NUTRIEN LTD	20,908	74.36	1,554,718.88
PAN AMERICAN SILVER CORP	12,860	21.12	271,603.20
TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,975	55.24	992,939.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,450	105.96	259,602.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,165	65.81	1,261,248.65
CAE INC	12,305	28.32	348,477.60
STANTEC INC	4,100	101.45	415,945.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,260	113.95	371,477.00
WSP GLOBAL INC	5,800	189.05	1,096,490.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	13,800	22.02	303,876.00
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,410	43.36	321,297.60
RB GLOBAL INC	7,560	87.33	660,214.80
THOMSON REUTERS CORP	6,310	188.20	1,187,542.00
AIR CANADA	7,190	18.59	133,662.10
CANADIAN NATL RAILWAY CO	22,438	162.03	3,635,629.14
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	37,551	103.00	3,867,753.00
TFI INTERNATIONAL INC	3,210	159.02	510,454.20
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,668	78.54	837,864.72
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,570	87.85	137,924.50
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,040	44.35	312,224.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,998	99.36	1,092,761.28
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,250	145.69	327,802.50
DOLLARAMA INC	12,990	92.88	1,206,511.20
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	30,860	74.48	2,298,452.80
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	34.57	240,261.50
LOBLAW COMPANIES LTD	6,339	119.99	760,616.61
METRO INC	9,570	65.70	628,749.00
WESTON (GEORGE) LTD	2,808	159.15	446,893.20
SAPUTO INC	9,620	26.78	257,623.60
BANK OF MONTREAL	30,681	124.37	3,815,795.97
BANK OF NOVA SCOTIA	47,539	63.17	3,003,038.63
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	37,740	60.94	2,299,875.60

	NATIONAL BANK OF CANADA	13,750	98.74	1,357,675.00
	ROYAL BANK OF CANADA	57,029	130.86	7,462,814.94
	TORONTO-DOMINION BANK	73,840	84.35	6,228,404.00
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	13,859	52.23	723,855.57
	BROOKFIELD CORP	57,209	52.50	3,003,472.50
	IGM FINANCIAL INC	3,335	35.49	118,359.15
	ONEX CORPORATION	2,765	90.70	250,785.50
	TMX GROUP LTD	10,850	30.98	336,133.00
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	1,199.25	1,079,325.00
	GREAT-WEST LIFECO INC	11,324	43.89	497,010.36
	IA FINANCIAL CORP INC	4,075	93.14	379,545.50
	INTACT FINANCIAL CORP	7,215	203.50	1,468,252.50
	MANULIFE FINANCIAL CORP	71,921	28.66	2,061,255.86
	POWER CORP OF CANADA	20,479	38.37	785,779.23
	SUN LIFE FINANCIAL INC	24,774	69.67	1,726,004.58
	CGI INC	8,030	142.40	1,143,472.00
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	810	3,324.00	2,692,440.00
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,740	112.36	420,226.40
	OPEN TEXT CORP	11,190	55.74	623,730.60
	SHOPIFY INC - CLASS-A	49,210	103.92	5,113,903.20
	BCE INC	3,000	53.72	161,160.00
	QUEBECOR INC -CL B	6,110	31.30	191,243.00
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	13,875	61.60	854,700.00
	TELUS CORP	12,662	24.64	311,991.68
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	8.76	237,220.80
	ALTAGAS LTD	11,170	27.50	307,175.00
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	39.19	213,389.55
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	32.10	146,376.00
	EMERA INC	10,460	50.23	525,405.80
	FORTIS INC	19,055	55.57	1,058,886.35
	HYDRO ONE LTD	13,230	39.36	520,732.80
	NORTHLAND POWER INC	8,600	23.88	205,368.00
	FIRSTSERVICE CORP	1,500	216.36	324,540.00
加ドル小計		1,634,599		101,906,451.78 (10,826,541,437)
ユーロ	ENI SPA	92,956	14.84	1,380,210.68

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	18,755	13.47	252,723.62
NESTE OYJ	16,380	34.69	568,222.20
OMV AG	5,480	39.90	218,652.00
REPSOL SA	54,849	13.43	736,622.07
TENARIS SA	17,895	15.64	279,877.80
TOTALENERGIES SE	93,287	61.41	5,728,754.67
AIR LIQUIDE SA	21,269	175.10	3,724,201.90
AKZO NOBEL	6,937	74.38	515,974.06
ARCELORMITTAL	20,552	24.72	508,148.20
ARKEMA	2,215	98.90	219,063.50
BASF SE	37,045	48.14	1,783,346.30
COVESTRO AG	7,410	52.14	386,357.40
DSM-FIRMENICH AG	7,552	88.73	670,088.96
EVONIK INDUSTRIES AG	8,230	17.86	147,028.95
HEIDELBERG MATERIALS AG	5,715	81.26	464,400.90
OCI NV	4,810	23.30	112,073.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	13,250	36.38	482,035.00
STORA ENSO OYJ-R SHS	25,365	12.08	306,536.02
SYENSQO SA	2,811	96.66	271,711.26
SYMRISE AG	5,790	106.10	614,319.00
UMICORE	7,960	24.51	195,099.60
UPM-KYMMENE OYJ	21,098	33.05	697,288.90
VOESTALPINE AG	4,249	27.96	118,802.04
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,876	39.58	311,732.08
AIRBUS GROUP SE	24,088	140.06	3,373,765.28
ALSTOM	11,635	11.64	135,489.57
BOUYGUES SA	8,460	35.69	301,937.40
BRENTAG SE	6,865	81.24	557,712.60
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	19,106	66.10	1,262,906.60
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	23,136	33.74	780,608.64
DASSAULT AVIATION SA	900	175.90	158,310.00
EIFFAGE	3,250	97.76	317,720.00
FERROVIAL SE	17,825	32.69	582,699.25
GEA GROUP AG	6,020	35.23	212,084.60
IMCD NV	2,120	153.55	325,526.00
KINGSPAN GROUP PLC	5,900	79.70	470,230.00

KNORR-BREMSE AG	2,970	56.46	167,686.20
KONE OYJ-B	13,614	41.44	564,164.16
LEGRAND SA	11,128	96.50	1,073,852.00
LEONARDO SPA	16,300	14.43	235,290.50
METSO CORPORATION	24,200	8.85	214,218.40
MTU AERO ENGINES AG	2,020	184.70	373,094.00
PRYSMIAN SPA	9,565	39.07	373,704.55
RATIONAL AG	230	680.50	156,515.00
RHEINMETALL AG	1,730	285.80	494,434.00
SAFRAN SA	14,450	160.78	2,323,271.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	22,268	179.00	3,985,972.00
SIEMENS AG-REG	31,066	165.82	5,151,364.12
SIEMENS ENERGY AG	21,343	11.24	240,002.03
THALES SA	4,925	134.55	662,658.75
VINCI SA	20,600	116.02	2,390,012.00
WARTSILA OYJ ABP	18,180	13.09	238,067.10
BUREAU VERITAS SA	10,920	22.54	246,136.80
RANDSTAD NV	4,675	56.56	264,418.00
TELEPERFORMANCE	2,240	121.90	273,056.00
WOLTERS KLUWER	10,027	130.30	1,306,518.10
ADP	1,090	120.00	130,800.00
AENA SA	2,870	165.60	475,272.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	8.17	195,147.36
DEUTSCHE POST AG-REG	39,823	45.60	1,815,928.80
GETLINK	17,310	16.95	293,404.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,355	102.54	1,369,421.70
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,210	92.15	203,651.50
CONTINENTAL AG	4,385	75.70	331,944.50
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	4,380	81.00	354,780.00
FERRARI NV	5,019	331.20	1,662,292.80
MERCEDES-BENZ GROUP AG	34,202	63.50	2,171,827.00
MICHELIN (CGDE)	24,706	32.04	791,580.24
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	48.39	274,371.30
RENAULT SA	8,247	39.04	322,004.11
STELLANTIS NV	90,796	21.26	1,930,322.96
VOLKSWAGEN AG	1,151	124.90	143,759.90

VOLKSWAGEN AG-PFD	8,073	115.74	934,369.02
ADIDAS AG	6,571	197.40	1,297,115.40
HERMES INTERNATIONAL	1,272	2,017.00	2,565,624.00
KERING	3,007	427.05	1,284,139.35
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	11,269	746.80	8,415,689.20
MONCLER SPA	8,080	56.46	456,196.80
PUMA SE	4,200	55.06	231,252.00
SEB SA	987	111.00	109,557.00
ACCOR SA	10,106	34.95	353,204.70
AMADEUS IT GROUP SA	18,350	65.02	1,193,117.00
DELIVERY HERO SE	6,600	30.25	199,683.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,366	154.30	1,136,573.80
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	33.98	132,522.00
SODEXO	3,240	99.36	321,926.40
BOLLORE SE	33,530	5.61	188,103.30
PUBLICIS GROUPE	9,305	82.06	763,568.30
SCOUT24 SE	2,970	63.96	189,961.20
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	31,460	25.74	809,780.40
VIVENDI SE	26,070	9.85	256,789.50
D' IETEREN GROUP	1,050	169.40	177,870.00
INDITEX	43,905	38.61	1,695,172.05
PROSUS NV	62,794	30.11	1,890,727.34
ZALANDO SE	8,260	22.22	183,537.20
CARREFOUR SA	22,633	16.30	369,031.06
HELLOFRESH SE	6,070	15.08	91,565.95
JERONIMO MARTINS	10,585	23.44	248,112.40
KESKO OYJ-B SHS	10,930	17.53	191,657.55
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	40,028	25.98	1,039,927.44
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	36,121	57.52	2,077,679.92
DANONE	25,794	58.20	1,501,210.80
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,850	10.30	204,554.25
HEINEKEN HOLDING NV	4,895	75.95	371,775.25
HEINEKEN NV	11,343	91.10	1,033,347.30
JDE PEET' S NV	6,290	24.76	155,740.40
KERRY GROUP PLC-A	6,460	74.34	480,236.40
LOTUS BAKERIES	20	8,300.00	166,000.00

PERNOD-RICARD SA	8,296	162.65	1,349,344.40
REMY COINTREAU	810	108.95	88,249.50
BEIERSDORF AG	4,375	132.95	581,656.25
HENKEL AG & CO KGAA	4,520	65.04	293,980.80
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,793	73.24	497,519.32
L' OREAL	9,786	443.55	4,340,580.30
AMPLIFON SPA	4,830	31.64	152,821.20
BIOMERIEUX	1,690	100.75	170,267.50
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	97.84	157,522.40
DIASORIN ITALIA SPA	930	97.28	90,470.40
ESSILORLUXOTTICA	11,505	185.08	2,129,345.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	7,613	38.94	296,450.22
FRESENIUS SE & CO KGAA	15,695	28.58	448,563.10
KONINKLIJKE PHILIPS NV	36,772	20.30	746,655.46
SIEMENS HEALTHINEERS AG	13,430	53.18	714,207.40
ARGENX SE	2,315	425.30	984,569.50
BAYER AG-REG	39,064	31.89	1,245,946.28
EUROFINS SCIENTIFIC	5,050	57.70	291,385.00
GRIFOLS SA	12,050	14.22	171,411.25
IPSEN	1,600	106.00	169,600.00
MERCK KGAA	5,150	139.95	720,742.50
ORION OYJ-CLASS B	4,500	38.25	172,125.00
QIAGEN N. V.	10,384	39.44	409,544.96
RECORDATI SPA	3,720	47.33	176,067.60
SANOFI	46,566	88.02	4,098,739.32
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,230	340.60	418,938.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	223.80	241,704.00
UCB SA	4,928	75.70	373,049.60
ABN AMRO BANK NV-CVA	15,170	13.61	206,539.55
AIB GROUP PLC	51,000	3.63	185,130.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	241,763	8.37	2,024,039.83
BANCO BPM SPA	49,000	4.81	236,033.00
BANCO SANTANDER SA	662,389	3.88	2,572,718.87
BANK OF IRELAND GROUP PLC	44,790	8.16	365,575.98
BNP PARIBAS	44,242	62.88	2,781,936.96
CAIXABANK S. A	163,050	3.78	616,655.10

COMMERZBANK AG	40,474	10.55	427,000.70
CREDIT AGRICOLE SA	49,662	12.89	640,441.15
ERSTE GROUP BANK AG	13,018	35.75	465,393.50
FINECOBANK SPA	23,540	13.52	318,260.80
ING GROEP NV-CVA	146,925	13.62	2,001,706.20
INTESA SANPAOLO	658,093	2.62	1,725,190.79
KBC GROEP NV	9,719	58.24	566,034.56
MEDIOBANCA SPA	19,520	11.15	217,648.00
NORDEA BANK ABP	131,132	11.00	1,443,238.79
SOCIETE GENERALE	30,909	24.49	756,961.41
UNICREDIT SPA	68,256	23.85	1,627,905.60
ADYEN NV	865	1,186.40	1,026,236.00
AMUNDI SA	2,140	60.80	130,112.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	80,935	11.97	968,791.95
DEUTSCHE BOERSE AG	7,600	176.65	1,342,540.00
EDENRED	9,626	53.84	518,263.84
EURAZEO SE	1,487	71.55	106,394.85
EURONEXT NV	3,470	78.20	271,354.00
EXOR NV	4,164	93.78	390,499.92
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,452	73.16	252,548.32
NEXI SPA	21,240	7.30	155,221.92
SOFINA	655	222.80	145,934.00
WORLDLINE SA	8,950	15.45	138,277.50
AEGON LTD	69,679	5.26	366,790.25
AGEAS	5,924	39.51	234,057.24
ALLIANZ SE-REG	16,503	239.00	3,944,217.00
ASR NEDERLAND NV	5,880	43.57	256,191.60
ASSICURAZIONI GENERALI	42,248	19.03	804,190.68
AXA SA	75,752	29.25	2,216,124.76
HANNOVER RUECK SE-REG	2,275	215.80	490,945.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,626	376.60	2,118,751.60
NN GROUP NV	10,270	35.67	366,330.90
POSTE ITALIANE SPA	19,560	10.12	197,947.20
SAMPO OYJ-A SHS	19,639	40.09	787,327.51
TALANX AG	2,500	67.35	168,375.00
BECHTLE AG	3,070	44.30	136,001.00

CAP GEMINI SA	6,509	193.15	1,257,213.35
DASSAULT SYSTEMES SE	27,400	43.82	1,200,668.00
NEMETSCHEK SE	2,350	77.98	183,253.00
SAP SE	42,642	142.54	6,078,190.68
NOKIA OYJ	251,336	3.08	775,999.90
CELLNEX TELECOM SA	21,660	36.32	786,691.20
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	128,776	21.74	2,799,590.24
ELISA OYJ	6,005	40.80	245,004.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	11.45	173,772.35
KONINKLIJKE KPN NV	122,956	3.11	383,253.85
ORANGE S. A.	72,804	10.67	776,818.68
TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.26	105,174.71
TELEFONICA SA	195,629	3.68	720,305.97
ACCIONA SA	830	135.65	112,589.50
E. ON SE	90,999	12.63	1,149,772.36
EDP RENOVAVEIS SA	11,156	18.11	202,035.16
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	126,131	4.59	579,445.81
ELIA GROUP SA/NV	1,356	112.60	152,685.60
ENAGAS SA	8,610	16.92	145,681.20
ENDESA SA	12,050	19.50	234,975.00
ENEL SPA	344,237	6.72	2,313,961.11
ENGIE	71,874	16.27	1,169,389.98
FORTUM OYJ	16,755	13.15	220,328.25
IBERDROLA SA	244,512	11.82	2,891,354.40
NATURGY ENERGY GROUP SA	4,522	28.08	126,977.76
REDEIA CORP SA	20,650	15.36	317,184.00
RWE AG	25,835	41.74	1,078,352.90
SNAM SPA	91,120	4.70	428,537.36
TERNA SPA	53,627	7.70	413,142.40
VEOLIA ENVIRONNEMENT	31,150	29.90	931,385.00
VERBUND AG	2,780	84.25	234,215.00
ASM INTERNATIONAL NV	1,935	481.15	931,025.25
ASML HOLDING NV	16,442	682.20	11,216,732.40
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	2,870	137.65	395,055.50
INFINEON TECHNOLOGIES AG	51,775	38.38	1,987,124.50
STMICROELECTRONICS NV	27,283	45.59	1,243,968.38

	LEG IMMOBILIEN SE	3,010	78.48	236,224.80
	VONOVIA SE	33,969	28.51	968,456.19
ユーロ小計		7,415,652		198,500,348.34 (31,061,334,508)
英ポンド	BP PLC	703,648	4.65	3,278,296.03
	SHELL PLC-NEW	270,927	25.20	6,827,360.40
	ANGLO AMERICAN PLC	54,004	17.95	969,587.81
	ANTOFAGASTA PLC	14,330	16.31	233,793.95
	CRH PLC	30,060	52.98	1,592,578.80
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,131	51.32	314,642.92
	ENDEAVOUR MINING PLC	6,490	18.04	117,079.60
	GLENCORE PLC	417,803	4.53	1,895,781.11
	MONDI PLC	18,370	15.12	277,846.25
	RIO TINTO PLC	45,775	56.53	2,587,660.75
	ASSTEAD GROUP PLC	17,770	54.86	974,862.20
	BAE SYSTEMS PLC ORD	124,235	10.46	1,299,498.10
	BUNZL PLC	12,896	31.32	403,902.72
	DCC PLC	3,820	57.34	219,038.80
	MELROSE INDUSTRIES PLC	50,400	5.63	283,852.80
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	353,031	3.00	1,059,093.00
	SMITHS GROUP PLC	13,603	17.29	235,195.87
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,890	100.35	290,011.50
	EXPERIAN PLC	37,408	32.29	1,207,904.32
	INTERTEK GROUP PLC	6,025	41.25	248,531.25
	RELX PLC	76,445	30.63	2,341,510.35
	RENTOKIL INITIAL PLC	115,300	4.22	487,142.50
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	5.61	228,764.96
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,515	48.10	217,171.50
	BURBERRY GROUP PLC	15,504	15.69	243,257.76
	PERSIMMON PLC	12,440	13.58	168,935.20
	TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.42	176,704.16
	COMPASS GROUP PLC	72,268	21.15	1,528,468.20
	ENTAIN PLC	24,860	9.20	228,712.00
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,473	70.76	528,789.48
PEARSON PLC	26,089	9.42	245,914.91	
WHITBREAD PLC	8,110	34.94	283,363.40	

AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	7.30	266,522.88
INFORMA PLC	56,580	7.87	445,284.60
WPP PLC	41,144	7.53	310,143.47
JD SPORTS FASHION PLC	97,350	1.75	170,508.52
KINGFISHER PLC	78,137	2.43	190,263.59
NEXT PLC	5,667	81.70	462,993.90
OCADO GROUP PLC	22,670	7.18	162,906.62
SAINSBURY (J) PLC	70,601	3.00	212,014.80
TESCO PLC	288,058	2.88	829,895.09
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,125	23.90	313,687.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	84,677	23.61	1,999,223.97
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	22.96	176,562.40
DIAGEO PLC	92,122	28.69	2,642,980.18
IMPERIAL BRANDS PLC	38,792	17.97	697,092.24
HALEON PLC	218,251	3.19	697,093.69
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	28,605	54.14	1,548,674.70
UNILEVER PLC	102,232	37.63	3,846,990.16
NMC HEALTH PLC	8,090	—	—
SMITH & NEPHEW PLC	33,906	10.82	366,862.92
ASTRAZENECA PLC	63,252	104.68	6,621,219.36
GSK PLC	166,500	14.61	2,433,897.00
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,740	17.80	102,200.70
BARCLAYS PLC	639,751	1.50	959,626.50
HSBC HOLDINGS PLC	801,061	6.16	4,936,938.94
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,649,936	0.47	1,259,779.57
NATWEST GROUP PLC	204,035	2.22	454,385.94
STANDARD CHARTERED PLC	95,420	6.55	625,001.00
3I GROUP PLC	40,649	23.70	963,381.30
ABRDN PLC	88,515	1.82	161,185.81
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	7.48	97,415.64
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	16,267	93.00	1,512,831.00
M&G PLC	99,522	2.18	217,754.13
SCHRODERS PLC	30,300	4.43	134,319.90
ST JAMES' S PLACE PLC	20,540	7.11	146,039.40
WISE PLC - A	21,400	8.30	177,620.00
ADMIRAL GROUP PLC	12,845	26.72	343,218.40

	AVIVA PLC	94,524	4.31	407,492.96	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	225,651	2.45	554,875.80	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,230	5.19	157,135.54	
	PRUDENTIAL PLC	110,702	8.83	977,720.06	
	SAGE GROUP PLC/THE	38,840	11.72	455,399.00	
	HALMA PLC	14,690	22.66	332,875.40	
	BT GROUP PLC	267,752	1.28	343,927.44	
	VODAFONE GROUP PLC	996,528	0.66	662,192.85	
	CENTRICA PLC	209,200	1.43	301,143.40	
	NATIONAL GRID PLC	158,528	10.79	1,711,309.76	
	SEVERN TRENT PLC	13,573	26.50	359,684.50	
	SSE PLC	43,667	18.96	827,926.32	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	11.12	290,287.60	
英ボンド小計		11,240,350		74,863,739.05 (13,602,741,385)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,990	13.29	106,187.10	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	685.00	184,950.00	
	GIVAUDAN-REG	378	3,442.00	1,301,076.00	
	HOLCIM LTD	22,219	66.58	1,479,341.02	
	SIG GROUP AG	10,900	20.18	219,962.00	
	SIKA AG-REG	6,605	271.10	1,790,615.50	
	ABB LTD-REG	67,595	37.45	2,531,432.75	
	GEBERIT AG-REG	1,490	547.00	815,030.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,070	197.00	210,790.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	207.80	307,544.00	
	VAT GROUP AG	1,015	419.30	425,589.50	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,817	41.67	284,064.39	
	SGS SA-REG	5,950	74.20	441,490.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,160	285.40	616,464.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	20,559	124.25	2,554,455.75	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,125	237.60	267,300.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,950	45.60	88,920.00	
	AVOLTA AG	3,460	33.00	114,180.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	130	1,401.00	182,130.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	40	10,910.00	436,400.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	108,600.00	543,000.00	

	NESTLE SA-REG	108,870	97.72	10,638,776.40	
	ALCON INC	19,554	66.60	1,302,296.40	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,051	273.10	560,128.10	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,370	136.90	598,253.00	
	BACHEM HOLDING AG	1,400	68.95	96,530.00	
	LONZA GROUP AG-REG	2,973	332.00	987,036.00	
	NOVARTIS AG-REG	83,653	85.58	7,159,023.74	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,280	261.60	334,848.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	28,673	245.90	7,050,690.70	
	SANDOZ GROUP AG	16,448	28.24	464,491.52	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,510	102.90	155,379.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,420	46.48	391,361.60	
	PARTNERS GROUP HOLDIING AG	900	1,216.00	1,094,400.00	
	UBS GROUP AG-REG	134,642	25.95	3,493,959.90	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,740	132.30	230,202.00	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	1,320	116.60	153,912.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,285	582.40	748,384.00	
	SWISS RE AG	12,289	95.50	1,173,599.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,116	445.60	2,725,289.60	
	TEMENOS AG	2,280	76.82	175,149.60	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	81.90	545,454.00	
	SWISSCOM AG-REG	1,024	509.60	521,830.40	
	BKW AG	840	158.30	132,972.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,441	91.10	313,475.10	
	スイスフラン小計	614,947		55,948,364.57 (9,185,043,011)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	10,290	309.75	3,187,327.50	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,520	427.20	1,503,744.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	22,680	150.65	3,416,742.00	
	ALFA LAVAL AB	10,710	391.80	4,196,178.00	
	ASSA ABLOY AB-B	42,940	282.00	12,109,080.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	111,390	167.90	18,702,381.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	56,870	143.20	8,143,784.00	
	BEIJER REF AB	15,480	133.80	2,071,224.00	
	EPIROC AB-A	31,565	199.00	6,281,435.00	
	EPIROC AB-B	15,450	171.80	2,654,310.00	

	HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	87.22	1,308,300.00	
	INDUTRADE AB	10,180	261.50	2,662,070.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	260.10	1,768,680.00	
	LIFCO AB-B SHS	8,470	250.10	2,118,347.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	63,000	74.58	4,698,540.00	
	SAAB AB-B	2,780	566.20	1,574,036.00	
	SANDVIK AB	40,890	218.90	8,950,821.00	
	SKANSKA AB-B SHS	14,390	181.35	2,609,626.50	
	SKF AB-B SHARES-B	14,079	204.60	2,880,563.40	
	VOLVO AB-A SHS	9,530	262.60	2,502,578.00	
	VOLVO AB-B SHS-B	58,430	258.15	15,083,704.50	
	SECURITAS AB-B SHS	17,788	96.52	1,716,897.76	
	VOLVO CAR AB-B	20,400	33.60	685,440.00	
	EVOLUTION AB	7,140	1,176.40	8,399,496.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,848	176.72	4,921,298.56	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	23,695	257.60	6,103,832.00	
	GETINGE AB-B SHS	9,470	231.10	2,188,517.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	8,148	246.20	2,006,037.60	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	62,450	135.10	8,436,995.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60,120	106.50	6,402,780.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	34,550	202.00	6,979,100.00	
	EQT AB	14,450	268.80	3,884,160.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	332.50	1,657,180.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	332.40	1,987,752.00	
	INVESTOR AB-B SHS	69,350	229.85	15,940,097.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,590	556.40	1,997,476.00	
	ERICSSON LM-B SHS	114,915	61.75	7,096,001.25	
	HEXAGON AB-B SHS	80,990	118.95	9,633,760.50	
	TELE2 AB-B SHS	23,245	85.66	1,991,166.70	
	TELIA CO AB	118,530	26.20	3,105,486.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	23,220	70.76	1,643,047.20	
	SAGAX AB-B	7,910	277.90	2,198,189.00	
	スウェーデンクローナ小計	1,303,217		207,398,181.97 (2,880,760,747)	
ノルウェークロ ーネ	AKER BP ASA	12,100	299.30	3,621,530.00	
	EQUINOR ASA	39,014	332.00	12,952,648.00	

	NORSK HYDRO A S	50,660	65.82	3,334,441.20	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,670	365.80	2,439,886.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,900	452.00	1,762,800.00	
	ADEVINTA ASA	11,400	112.30	1,280,220.00	
	MOWI ASA	16,360	186.30	3,047,868.00	
	ORKLA ASA	32,290	79.94	2,581,262.60	
	SALMAR ASA	3,590	579.80	2,081,482.00	
	DNB BANK ASA	35,845	210.40	7,541,788.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,410	188.10	1,393,821.00	
	TELENOR ASA	23,915	121.20	2,898,498.00	
ノルウェークローネ小計		243,154		44,936,244.80 (609,335,479)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,840	546.60	2,098,944.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,165	358.90	2,930,418.50	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	315	1,951.50	614,722.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	41,480	194.06	8,049,608.80	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	115	10,910.00	1,254,650.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	195	10,960.00	2,137,200.00	
	DSV A/S	7,890	1,134.00	8,947,260.00	
	PANDORA A/S	3,310	919.40	3,043,214.00	
	CARLSBERG AS-B	3,910	836.20	3,269,542.00	
	COLOPLAST-B	6,475	794.80	5,146,330.00	
	DEMANT A/S	3,640	297.10	1,081,444.00	
	GENMAB A/S	2,580	2,154.00	5,557,320.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	133,040	664.20	88,365,168.00	
	DANSKE BANK A/S	26,635	178.05	4,742,361.75	
	TRYG A/S	13,945	152.30	2,123,823.50	
ORSTED A/S	7,570	361.40	2,735,798.00		
デンマーククローネ小計		263,105		142,097,805.05 (2,982,632,927)	
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	35.28	309,582.00	
	SANTOS LTD	151,760	7.51	1,139,717.60	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	75,946	30.16	2,290,531.36	
	BHP GROUP LTD	207,027	48.25	9,989,052.75	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	22.27	407,763.70	
	FORTESCUE LTD	65,915	27.46	1,810,025.90	

IGO LTD	24,300	8.37	203,391.00
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	16,955	51.98	881,320.90
MINERAL RESOURCES LTD	7,320	65.40	478,728.00
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42,190	13.18	556,064.20
ORICA LIMITED	17,675	16.36	289,163.00
PILBARA MINERALS LTD	114,530	3.79	434,068.70
RIO TINTO LTD	14,858	130.04	1,932,134.32
SOUTH32 LTD	207,787	3.16	656,606.92
REECE LTD	10,200	21.44	218,688.00
BRAMBLES LTD	54,798	13.06	715,661.88
COMPUTERSHARE LTD	20,910	23.40	489,294.00
AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	3.75	275,887.50
QANTAS AIRWAYS LTD	35,030	5.34	187,060.20
TRANSURBAN GROUP	129,996	13.51	1,756,245.96
ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,520	40.44	951,148.80
IDP EDUCATION LTD	10,150	20.58	208,887.00
LOTTERY CORP LTD/THE	85,554	4.79	409,803.66
CAR GROUP LTD	14,500	29.90	433,550.00
REA GROUP LTD	1,820	169.91	309,236.20
SEEK LTD	12,860	25.16	323,557.60
WESFARMERS LTD	47,855	54.57	2,611,447.35
COLES GROUP LTD	57,925	15.99	926,220.75
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	50,462	5.06	255,337.72
WOOLWORTHS GROUP LTD	49,102	36.62	1,798,115.24
TREASURY WINE ESTATES LTD	27,906	10.54	294,129.24
COCHLEAR LTD	2,947	297.50	876,732.50
RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,105	50.53	359,015.65
SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	31.70	559,822.00
CSL LTD	19,792	276.76	5,477,633.92
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	120,799	25.24	3,048,966.76
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	68,537	109.52	7,506,172.24
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	124,183	29.95	3,719,280.85
WESTPAC BANKING CORP	140,651	22.29	3,135,110.79
ASX LTD	7,105	61.58	437,525.90
MACQUARIE GROUP LTD	14,604	178.47	2,606,375.88
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,370	33.00	276,210.00

	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	5.60	532,700.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	108,430	3.58	388,179.40	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	70,410	14.07	990,668.70	
	SUNCORP GROUP LTD	44,036	13.61	599,329.96	
	WISETECH GLOBAL LTD	5,920	72.63	429,969.60	
	XERO LTD	5,960	111.63	665,314.80	
	TELSTRA GROUP LTD	164,284	3.91	642,350.44	
	APA GROUP	45,818	8.77	401,823.86	
	ORIGIN ENERGY LTD	68,320	7.99	545,876.80	
豪ドル小計		2,819,562		66,741,481.50 (6,370,474,409)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,165	8.44	398,072.60	
	EBOS GROUP LTD	5,630	36.00	202,680.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,130	24.75	572,467.50	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	5.19	397,817.51	
	MERCURY NZ LTD	34,100	6.35	216,535.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	57,830	5.31	307,077.30	
ニュージーランドドル小計		244,432		2,094,649.91 (185,062,319)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	103,208	40.05	4,133,480.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	52,500	87.15	4,575,375.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	71,000	8.25	585,750.00	
	MTR CORP	62,500	28.85	1,803,125.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	11.34	589,680.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	91,000	41.55	3,781,050.00	
	SANDS CHINA LTD	96,600	21.20	2,047,920.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	13.16	893,564.00	
	WH GROUP LTD	299,894	4.97	1,490,473.18	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	148,000	20.45	3,026,600.00	
	HANG SENG BANK LTD	29,100	86.15	2,506,965.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	48,300	248.80	12,017,040.00	
	AIA GROUP LTD	469,790	65.35	30,700,776.50	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	9.35	1,402,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	43.20	1,080,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	63,000	63.45	3,997,350.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	456,237	5.65	2,577,739.05	

	POWER ASSETS HOLDINGS	58,000	44.10	2,557,800.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	80,538	38.05	3,064,470.90	
	ESR GROUP LTD	75,800	10.00	758,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	10.90	850,200.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	23.05	1,334,618.05	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	61,666	11.52	710,392.32	
	SINO LAND CO	123,050	7.84	964,712.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,480	80.60	4,874,688.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	17,517	60.00	1,051,020.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	15.12	628,992.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	43,000	24.20	1,040,600.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	24.35	1,553,530.00	
香港ドル小計		3,047,381		96,598,411.40 (1,762,921,008)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	68,560	6.81	466,893.60	
	SEATRUM LTD	1,488,177	0.10	156,258.58	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	63,300	3.81	241,173.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	6.45	347,655.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.98	206,878.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	3.44	254,422.40	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	71,195	31.40	2,235,523.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	134,240	12.47	1,673,972.80	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	49,900	27.79	1,386,721.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	9.60	408,000.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	354,480	2.40	850,752.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	30,200	5.18	156,436.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	105,000	3.07	322,350.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	6.50	112,450.00	
	UOL GROUP LTD	15,550	6.12	95,166.00	
シンガポールドル小計		2,779,362		8,914,651.38 (956,185,507)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	26,090	18.85	491,796.50	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,010	761.90	769,519.00	
	BANK HAPOLIM BM	50,495	31.02	1,566,354.90	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	62,565	27.52	1,721,788.80	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	48,330	17.57	849,158.10	

	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,900	131.70	908,730.00	
	NICE LTD	2,440	746.60	1,821,704.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,780	226.40	402,992.00	
イスラエルシケル小計		199,610		8,532,043.30 (330,723,328)	
合 計		45,633,722		317,161,514,512 (317,161,514,512)	

(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	929,049.50	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	12,110	441,772.80	
		AMERICAN TOWER CORP	18,929	4,016,165.93	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	18,847	379,390.11	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,790	1,108,437.60	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,717	417,226.66	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,810	488,744.10	
		CROWN CASTLE INC	18,590	2,129,484.50	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	12,525	1,664,948.25	
		EQUINIX INC	3,803	3,062,517.87	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,550	476,316.00	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	15,450	962,689.50	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	616,280.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,800	1,361,448.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,340	542,619.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	409,945.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	27,179	528,903.34	
		INVITATION HOMES INC	25,700	906,953.00	
		IRON MOUNTAIN INC	13,365	914,834.25	
		KIMCO REALTY CORP	23,760	536,738.40	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,630	779,473.50	
		PROLOGIS INC	37,625	5,159,140.00	
PUBLIC STORAGE	6,319	1,839,460.90			
REALTY INCOME CORP	28,201	1,630,581.82			

		REGENCY CENTERS CORP	6,005	407,439.25	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,735	1,187,680.05	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	13,394	1,963,292.52	
		SUN COMMUNITIES INC	5,920	806,422.40	
		UDR INC	12,100	464,035.00	
		VENTAS INC	17,025	860,273.25	
		VICI PROPERTIES INC	39,120	1,249,101.60	
		WELLTOWER INC	21,240	1,951,318.80	
		WEYERHAEUSER CO	29,998	1,018,132.12	
		WP CAREY INC	8,610	563,007.90	
米ドル小計			498,952	41,773,822.92	(5,952,769,766)
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	149,604.00	
加ドル小計			2,800	149,604.00	(15,893,928)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	94,132.50	
		GECINA SA	1,950	216,450.00	
		KLEPIERRE	8,402	208,537.64	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,990	330,936.80	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,730	217,522.20	
ユーロ小計			24,997	1,067,579.14	(167,054,783)
英ポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	188,551.16	
		SEGRO PLC	45,033	399,893.04	
英ポンド小計			71,657	588,444.20	(106,920,311)
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	42,067	334,011.98	
		GOODMAN GROUP	70,642	1,734,261.10	
		GPT GROUP	71,335	331,707.75	
		MIRVAC GROUP	159,875	342,132.50	
		SCENTRE GROUP	198,271	580,934.03	
		STOCKLAND	102,400	454,656.00	
		VICINITY CENTRES	154,902	317,549.10	
豪ドル小計			799,492	4,095,252.46	(390,891,847)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	104,160	4,197,648.00	

香港ドル小計			104,160	4,197,648.00 (76,607,076)
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,243	413,346.57
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	419,112.00
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	144,556	244,299.64
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	106,000	157,940.00
シンガポールドル小計			598,355	1,234,698.21 (132,433,730)
合計				6,842,571,441 (6,842,571,441)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 588 銘柄	97.5%	—	73.1%
	投資証券 34 銘柄	—	2.5%	1.8%
加ドル	株式 86 銘柄	99.9%	—	3.3%
	投資証券 1 銘柄	—	0.1%	0.0%
ユーロ	株式 219 銘柄	99.5%	—	9.6%
	投資証券 5 銘柄	—	0.5%	0.1%
英ポンド	株式 81 銘柄	99.2%	—	4.2%
	投資証券 2 銘柄	—	0.8%	0.0%
スイスフラン	株式 45 銘柄	100.0%	—	2.8%
スウェーデンクローナ	株式 42 銘柄	100.0%	—	0.9%
ノルウェークローネ	株式 12 銘柄	100.0%	—	0.2%
デンマーククローネ	株式 16 銘柄	100.0%	—	0.9%
豪ドル	株式 51 銘柄	94.2%	—	2.0%
	投資証券 7 銘柄	—	5.8%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 6 銘柄	100.0%	—	0.1%
香港ドル	株式 29 銘柄	95.8%	—	0.5%
	投資証券 1 銘柄	—	4.2%	0.0%
シンガポールドル	株式 15 銘柄	87.8%	—	0.3%
	投資証券 4 銘柄	—	12.2%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 8 銘柄	100.0%	—	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

2 【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2023年12月29日現在です。

【世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

【純資産額計算書】

I 資産総額	39,072,193,644円
II 負債総額	221,241,784円
III 純資産総額（I－II）	38,850,951,860円
IV 発行済口数	35,099,591,417口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.1069円

（参考）

日本リートインデックスJ－REITマザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	61,192,109,607円
II 負債総額	137,270,773円
III 純資産総額（I－II）	61,054,838,834円
IV 発行済口数	24,354,014,741口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.5070円

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	59,046,971,707円
II 負債総額	96,363,682円
III 純資産総額（I－II）	58,950,608,025円
IV 発行済口数	18,513,599,660口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	3.1842円

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	52,492,009,871円
II 負債総額	6,475,529円
III 純資産総額（I－II）	52,485,534,342円
IV 発行済口数	38,945,265,165口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.3477円

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	158,967,686,325円
II 負債総額	234,040,018円
III 純資産総額（I－II）	158,733,646,307円
IV 発行済口数	56,402,148,514口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.8143円

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	54,047,679,188円
II 負債総額	271,632,857円
III 純資産総額（I－II）	53,776,046,331円
IV 発行済口数	22,172,986,667口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.4253円

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	335,223,800,730円
II 負債総額	1,808,533,871円
III 純資産総額（I－II）	333,415,266,859円
IV 発行済口数	61,782,492,894口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	5.3966円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

① 譲渡制限はありません。

② 受益権の譲渡

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

③ 受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

2023年12月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

●過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2023年12月末現在）

・株主総会

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

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（2023年12月末現在）

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

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2023年12月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	836	275,901
株式投資信託	783	237,069
単位型	303	9,406
追加型	480	227,662
公社債投資信託	53	38,832
単位型	40	1,033
追加型	13	37,799

3 【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 38 年大蔵省令第 59 号）並びに同規則第 2 条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成 19 年 8 月 6 日内閣府令第 52 号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 52 年大蔵省令第 38 号）並びに同規則第 38 条及び第 57 条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 64 期事業年度（2022 年 4 月 1 日から 2023 年 3 月 31 日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

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

独立監査人の監査報告書

2023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 2022 年 4 月 1 日から 2023 年 3 月 31 日までの第 64 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 2023 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)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。

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月5日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第65期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注) 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。

(1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第 63 期 (2022 年 3 月 31 日)		第 64 期 (2023 年 3 月 31 日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		42,427		42,036
有価証券		170		1,025
前払費用		932		908
未収入金		96	※4	410
未収委託者報酬		25,193		21,336
未収収益	※3	1,048	※3	589
関係会社短期貸付金		5,005		3,318
立替金		1,056		1,015
その他	※2	998	※2	1,233
流動資産合計		76,928		71,875
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	244	※1	245
器具備品	※1	153	※1	122
有形固定資産合計		397		367
無形固定資産				
ソフトウェア		335		390
無形固定資産合計		335		390
投資その他の資産				
投資有価証券		23,969		23,274
関係会社株式		22,366		22,366
長期差入保証金		652		375
繰延税金資産		3,678		448
投資その他の資産合計		50,667		46,465
固定資産合計		51,399		47,224
資産合計		128,328		119,099

(単位：百万円)

	第 63 期 (2022 年 3 月 31 日)	第 64 期 (2023 年 3 月 31 日)
負債の部		
流動負債		
預り金	651	433
未払金	9,693	7,557
未払収益分配金	7	7
未払償還金	71	71
未払手数料	8,783	6,586
その他未払金	831	892
未払費用	※3 5,572	※3 4,227
未払法人税等	2,354	-
未払消費税等	※4 3,669	-
賞与引当金	3,958	2,563
役員賞与引当金	5	218
訴訟損失引当金	7,847	-
その他	1,330	647
流動負債合計	35,083	15,648
固定負債		
退職給付引当金	1,395	1,424
賞与引当金	423	437
役員賞与引当金	-	16
その他	390	181
固定負債合計	2,209	2,059
負債合計	37,292	17,708
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	68,901	79,307
利益剰余金合計	68,901	79,307
自己株式	△2,067	△2,067
株主資本合計	89,417	99,823
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	2,350	2,056
繰延ヘッジ損益	△731	△488
評価・換算差額等合計	1,618	1,567
純資産合計	91,035	101,391
負債純資産合計	128,328	119,099

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第 63 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 64 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
営業収益		
委託者報酬	94,938	73,998
その他営業収益	4,743	3,479
営業収益合計	99,682	77,477
営業費用		
支払手数料	42,026	30,699
広告宣伝費	987	755
公告費	1	3
調査費	23,000	17,479
調査費	1,042	1,170
委託調査費	21,932	16,282
図書費	25	26
委託計算費	598	581
営業雑経費	1,014	948
通信費	143	139
印刷費	308	309
協会費	52	56
諸会費	13	16
その他	494	427
営業費用計	67,628	50,469
一般管理費		
給料	11,759	9,818
役員報酬	156	314
役員賞与引当金繰入額	5	234
給料・手当	7,229	6,544
賞与	143	147
賞与引当金繰入額	4,225	2,577
交際費	22	56
寄付金	29	24
旅費交通費	66	205
租税公課	429	433
不動産賃借料	937	938
退職給付費用	394	383
退職金	169	155
固定資産減価償却費	172	183
福利費	1,171	1,097
諸経費	3,888	4,291
一般管理費計	19,042	17,588
営業利益	13,010	9,420

(単位：百万円)

	第 63 期		第 64 期	
	(自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)		(自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)	
営業外収益				
受取利息		71		107
受取配当金	※ 1	5,257	※ 1	9,255
時効成立分配金・償還金		1		1
為替差益		1,548		—
その他		58		236
営業外収益合計		6,936		9,601
営業外費用				
支払利息		177		407
デリバティブ費用		49		389
有価証券償還損		—		6
時効成立後支払分配金・償還金		9		1
為替差損		—		342
その他		39		15
営業外費用合計		275		1,163
経常利益		19,672		17,858
特別利益				
投資有価証券売却益		253		427
子会社有償減資払戻益		1,445		—
訴訟損失引当金戻入額		—	※ 3	4,481
特別利益合計		1,699		4,909
特別損失				
投資有価証券売却損		132		347
固定資産処分損		0		0
訴訟損失引当金繰入額		7,847		—
特別損失合計		7,980		347
税引前当期純利益		13,391		22,420
法人税、住民税及び事業税		3,435		1,340
法人税等還付税額	※ 2	△329		—
法人税等調整額		△1,851		3,252
法人税等合計		1,255		4,593
当期純利益		12,136		17,826

(3) 【株主資本等変動計算書】

第63期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	61,956	61,956	△2,067	82,472
当期変動額							
剰余金の配当				△5,191	△5,191		△5,191
当期純利益				12,136	12,136		12,136
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	—	—	—	6,944	6,944	—	6,944
当期末残高	17,363	5,220	5,220	68,901	68,901	△2,067	89,417

	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	1,461	115	1,577	84,049
当期変動額				
剰余金の配当				△5,191
当期純利益				12,136
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	889	△847	41	41
当期変動額合計	889	△847	41	6,985
当期末残高	2,350	△731	1,618	91,035

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

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第 64 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)				
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>① 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>② その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 市場価格のない株式等 総平均法による原価法</p> <p>(2) デリバティブ 時価法</p>				
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016 年 4 月 1 日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table border="0" data-bbox="510 806 1021 884"> <tr> <td>建物</td> <td>3 年～15 年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3 年～20 年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5 年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	3 年～15 年	器具備品	3 年～20 年
建物	3 年～15 年				
器具備品	3 年～20 年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>② 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10 年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p>				
4 収益の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。</p> <p>(1) 投資信託委託業務 当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高(以下「AUM」)に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドの AUM に固定料率を乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問業務 当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドの AUM に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドの AUM に投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。</p>				

5 ヘッジ会計の方法	<p>(3) 成功報酬 当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。</p> <p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
6 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。</p>

(会計方針の変更)

第 64 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
(時価の算定に関する会計基準の適用) 「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準第 31 号 2021 年 6 月 17 日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。)を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第 27-2 項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしております。本会計基準適用指針の適用が当財務諸表に与える影響は軽微であります。

(表示方法の変更)

第 64 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
その他有価証券の為替リスクヘッジに係るヘッジ損益について、ヘッジ対象の損益認識時に繰延ヘッジ損益を純損益に計上するに当たり、前事業年度において、「為替差損益」に含めていましたが、金額的重要性が高まったことから、ヘッジの効果をより明瞭に表示するため当事業年度よりヘッジ対象の損益区分と同一区分である投資有価証券売却益あるいは投資有価証券売却損として表示することとしております。

(重要な会計上の見積り)

第 63 期(自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)

1 当事業年度の財務諸表に計上した金額

訴訟損失引当金を 7,847 百万円計上しております。

2 会計上の見積りの内容に関する理解に資する情報

(1) 当事業年度の財務諸表に計上した金額の算出方法

訴訟について将来発生しうる損失の見込額を算出し、訴訟損失引当金として計上しています。

(2) 当事業年度の財務諸表に計上した金額の算出に用いた主要な仮定

原告が主張する損害額に基づき、将来発生することが予想される損失の見積を行っています。

(3) 翌事業年度の財務諸表に与える影響

当社では、現在までに想定しうる最善の仮定に基づき訴訟損失引当金を計上しておりますが、今後の経過により、翌事業年度において訴訟損失引当金の追加計上または取り崩しを行う可能性があります。

第 64 期(自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)

該当事項はありません。

(貸借対照表関係)

第 63 期 (2022 年 3 月 31 日)	第 64 期 (2023 年 3 月 31 日)
※ 1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,390 百万円 器具備品 823 百万円	※ 1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,437 百万円 器具備品 879 百万円
※ 2 信託資産 流動資産のその他のうち 2 百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。	※ 2 信託資産 流動資産のその他のうち 2 百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。
※ 3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりで あります。 (流動資産) 未収収益 233 百万円 (流動負債) 未払費用 2,314 百万円	※ 3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりで あります。 (流動資産) 未収収益 263 百万円 (流動負債) 未払費用 1,778 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。	※ 4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 「未収入金」に含めて表示しております。
※ 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 5 百万豪ドルを提供す る義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・ マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務 を保証しております。	※ 5 保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピ ーティーワイ・リミテッド (旧社名「日興 AM エク イティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リ ミテッド」) が発行する買戻し条件付株式の買戻請 求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネ ジメント・リミテッドは最大 448 百万円 (5 百万豪 ドル) を提供する義務を負っています。当社はヤ ラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う 当該資金提供義務を保証しております。

(損益計算書関係)

第 63 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 64 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
※ 1 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 5,194 百万円	※ 1 各科目に含まれている関係会社に対するものは、 次のとおりであります。 受取配当金 9,241 百万円
※ 2 法人税等還付税額 過年度の取引に関する法人税等の還付金相当額を 計上しています。	※ 3 訴訟損失引当金戻入額 原告との和解が成立したことにより、前事業年度 に計上した訴訟損失引当金から、和解金を控除した 額を計上しております。

(株主資本等変動計算書関係)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022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	
2011年度 ストックオプション(1)	普通株式	432,300	—	432,300	—	—
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,016,000	—	928,000	88,000	—
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	1,772,000	—	956,000	816,000	—
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,607,000	—	1,071,000	1,536,000	—
合計		5,827,300	—	3,387,300	2,440,000	—

(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(1)88,000株、2016年度ストックオプション(2)816,000株及び2017年度ストックオプション(1)847,000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。また、2017年度ストックオプション(1)689,000株は、権利行使期間の初日が到来しておりません。

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
2021年5月25日 取締役会	普通株式	5,191	26.74	2021年3月31日	2021年6月29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
2022年5月27日 取締役会	普通株式	利益剰余金	7,420	38.22	2022年3月31日	2022年6月27日

第64期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	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(1)	普通株式	88,000	—	88,000	—	—
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	816,000	—	599,000	217,000	—
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,536,000	—	784,000	752,000	—
合計		2,440,000	—	1,391,800	969,000	—

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(リース取引関係)

第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		第64期 (自 2022年4月1日 至 2023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	911百万円	1年内	899百万円
1年超	4,324百万円	1年超	3,425百万円
合計	5,236百万円	合計	4,324百万円

(金融商品関係)

第 63 期(自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

② 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日。以下、「時価算定適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した投資信託及び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 (*4)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
デリバティブ取引(*1)				
株式関連 (*2)	△262	—	—	△262
通貨関連 (*3)	—	△1,066	—	△1,066
デリバティブ取引計	△262	△1,066	—	△1,329

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

(※2) 株式関連のデリバティブ取引のうち△262百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。

(※3) 通貨関連のデリバティブ取引の△1,066百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。

(※4) 時価算定適用指針に従い、経過措置を適用した投資信託は上記に含めておりません。貸借対照表における当該投資信託の金額は有価証券に170百万円、投資有価証券に23,952百万円となります。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

デリバティブ取引

株式関連

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

通貨関連

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位：百万円)

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

3 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	42,427			
未収委託者報酬	25,193			
未収収益	1,048			
有価証券及び投資有価証券				
投資信託	170	345	8,874	19
合計	68,839	345	8,874	19

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

① 信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

② 市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

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

③ 流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

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

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

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

(※2) 株式関連のデリバティブ取引のうち△246百万円は、貸借対照表上流動資産及び流動負債のその他に含まれております。

(※3) 通貨関連のデリバティブ取引の△352百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

資産

有価証券

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

デリバティブ取引

株式関連

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

通貨関連

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位：百万円)

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

3 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

(有価証券関係)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	投資信託	20,934	17,366	3,568
	小計	20,934	17,366	3,568
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	3,188	3,369	△180
	小計	3,188	3,369	△180
合計		24,123	20,735	3,387

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	3,079	253	△132
合計	3,079	253	△132

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

(デリバティブ取引関係)

第 63 期(2022 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	2,306	-	△ 262	△ 262
	買建	-	-	-	-
合計		2,306	-	△ 262	△ 262

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建 米ドル	4,708	-	△ 293	△ 293
合計		4,708	-	△ 293	△ 293

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引	投資有価証券			
	売建				
	米ドル		5,445	-	△367
	豪ドル		222	-	△20
	香港ドル		1,097	-	△59
	人民元		5,185	-	△324
	ユーロ	35	-	△0	
合計			11,986	-	△772

(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 64 期(2023 年 3 月 31 日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		6,132	-	△280
	豪ドル		105	-	0
	香港ドル		699	-	△34
	人民元		5,822	-	△1
	ユーロ		234	-	△10
合計			12,994	-	△328

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第 63 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	第 64 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 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 5,312	(1) 関連会社に対する投資の金額 5,326
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 15,942	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 16,722
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,964	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,185

(退職給付関係)

第 63 期(自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 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	1,429
勤務費用	143
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	△12
退職給付の支払額	△211
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>1,352</u>

(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	1,352
未積立退職給付債務	1,352
未認識数理計算上の差異	43
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,395</u>
退職給付引当金	1,395
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,395</u>

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	143
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	3
<u>確定給付制度に係る退職給付費用</u>	<u>150</u>

(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 0.3%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、244 百万円でありました。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	133
利息費用	4
数理計算上の差異の費用処理額	△1
確定給付制度に係る退職給付費用	136

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.6%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、247百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2011年度ストックオプション(1)	2016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 186名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16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 6,101,700株	普通株式 4,437,000株
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定条件	2013年10月7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2分の1、4分の1、4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。	2018年7月15日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
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	2013年10月7日から 2021年10月6日まで	2018年7月15日から 2026年7月31日まで

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

① ストックオプション(新株予約権)の数

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利確定前(株)		
期首	432,300	1,016,000
付与	0	0
失効	432,300	928,000
権利確定	0	0
権利未確定残	—	88,000
権利確定後(株)		
期首	—	—
権利確定	—	—
権利行使	—	—
失効	—	—
権利未行使残	—	—

	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	1,772,000	2,607,000
付与	0	0
失効	956,000	1,071,000
権利確定	0	0
権利未確定残	816,000	1,536,000
権利確定後(株)		
期首	—	—
権利確定	—	—
権利行使	—	—
失効	—	—
権利未行使残	—	—

(注) 株式数に換算して記載しております。

② 単価情報

	2011年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(1)
付与日	2011年10月7日	2016年7月15日
権利行使価格(円)	737(注)3	558
付与日における公正な評価単価(円) (注)1	0	0

	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 1,222百万円
- 3 株式公開価格が737円（割当日後、株式の分割又は併合が行われたときは、当該金額は、当該株式の分割又は併合の内容を適切に反映するように調整される。）を上回る金額に定められた場合には、株式公開日において、権利行使価格は株式公開価格と同一の金額に調整されます。

第 64 期(自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

	2016 年度ストックオプション(1)	2016 年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16 名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31 名
株式の種類別のストックオプション の付与数 (注)	普通株式 4,437,000 株	普通株式 4,409,000 株
付与日	2016 年 7 月 15 日	2017 年 4 月 27 日
権利確定条件	2018 年 7 月 15 日 (以下「権利行使 可能初日」といいます。)、当該権利 行使可能初日から 1 年経過した日の 翌日、及び当該権利行使可能初日か ら 2 年経過した日の翌日まで原則と して従業員等の地位にあることを要 し、それぞれ保有する新株予約権の 3 分の 1、3 分の 1、3 分の 1 ずつ 権利確定する。ただし、本新株予約 権の行使時において、当社が株式公 開していることを要する。	2019 年 4 月 27 日 (以下「権利行使可 能初日」といいます。)、当該権利行 使可能初日から 1 年経過した日の翌 日、及び当該権利行使可能初日から 2 年経過した日の翌日まで原則とし て従業員等の地位にあることを要 し、それぞれ保有する新株予約権の 3 分の 1、3 分の 1、3 分の 1 ずつ 権利確定する。ただし、本新株予約 権の行使時において、当社が株式公 開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から 2 年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から 2 年を経過した日まで
権利行使期間	2018 年 7 月 15 日から 2026 年 7 月 31 日まで	2019 年 4 月 27 日から 2027 年 4 月 30 日まで

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

① ストックオプション(新株予約権)の数

	2016年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2016年7月15日	2017年4月27日
権利確定前(株)		
期首	88,000	816,000
付与	0	0
失効	88,000	539,000
権利確定	0	0
権利未確定残	—	217,000
権利確定後(株)		
期首	—	—
権利確定	—	—
権利行使	—	—
失効	—	—
権利未行使残	—	—

	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2018年4月27日
権利確定前(株)	
期首	1,536,000
付与	0
失効	784,000
権利確定	0
権利未確定残	752,000
権利確定後(株)	
期首	—
権利確定	—
権利行使	—
失効	—
権利未行使残	—

(注) 株式数に換算して記載しております。

② 単価情報

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

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

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

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

(税効果会計関係)

第 63 期 (2022 年 3 月 31 日)		第 64 期 (2023 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)	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)
	繰延税金資産		繰延税金資産
	賞与引当金		賞与引当金
	投資有価証券評価損		投資有価証券評価損
	関係会社株式評価損		関係会社株式評価損
	退職給付引当金		退職給付引当金
	固定資産減価償却費		固定資産減価償却費
	繰延ヘッジ損益		繰延ヘッジ損益
	訴訟損失引当金		その他
	その他		繰延税金資産小計
	繰延税金資産小計		評価性引当金
	評価性引当金(注)		繰延税金資産合計
	繰延税金資産合計		繰延税金負債
	繰延税金負債		その他有価証券評価差額金
	その他有価証券評価差額金		その他
	その他		繰延税金負債合計
	繰延税金負債合計		繰延税金資産の純額
	繰延税金資産の純額		
	(注) 関係会社株式評価損に係る繰延税金資産から控除した評価性引当金が、在外子会社の減資により 1,377 百万円減少しております。		
2	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	2	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳
	法定実効税率		法定実効税率
	(調整)		(調整)
	交際費等永久に損金に算入されない項目		交際費等永久に損金に算入されない項目
	受取配当金等永久に益金に算入されない項目		受取配当金等永久に益金に算入されない項目
	評価性引当金の減少		その他
	その他		税効果会計適用後の法人税等の負担率
	税効果会計適用後の法人税等の負担率		

(関連当事者情報)

第 63 期(自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	232,369 (SGD 千)	アセットマネジメント業	直接 100.00	-	資金の貸付(米国ドル貨建)(注1)	-	関係会社 短期貸付金	2,019 (USD 16,500 千)
							貸付金利息(米国ドル貨建)(注1)	44 (USD 397 千)	未収収益	10 (USD 86 千)
							資金の返済(円貨建)(注1)	577	関係会社 短期貸付金	-
							貸付金利息(円貨建)(注1)	3	未収収益	-
							資金の貸付(シンガポールドル貨建)(注1)	2,788 (SGD 33,000 千)	関係会社 短期貸付金	2,985 (SGD 33,000 千)
							貸付金利息(シンガポールドル貨建)(注1)	23 (SGD 266 千)	未収収益	23 (SGD 266 千)
							減資(注2)	9,149 (SGD 110,000 千)	-	-
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	3,788 (USD 34,000 千)	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 融資枠 5,300 百万円(若しくは 5,300 百万円相当額の外国通貨)、返済期間 1 年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 2 Nikko Asset Management International Limited の行った 110,000 千株の減資により、当社は資金の払戻を受けております。
- 3 Nikko AM Americas Holding Co., Inc. の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は 2021 年 12 月 31 日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	34,450 百万円
負債合計	6,257 百万円
純資産合計	28,192 百万円

営業収益	18,176 百万円
税引前当期純利益	5,587 百万円
当期純利益	3,956 百万円

第 64 期(自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金 又は 出資金	事業 の内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合(%)	関連 当事者 との 関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガ ポール 国	232,369 (SGD 千)	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	—	資金の貸付 (シンガポールド ル貨建) (注 1)	—	関係会社 短期 貸付金	3,318 (SGD 33,000 千)
							貸付金利息 (シンガポールド ル貨建) (注 1)	103 (SGD 1,043 千)	未収収益	55 (SGD 551 千)
							資金の返済 (米国ドル貨建) (注 2)	2,019 (USD 16,500 千)	関係会社 短期 貸付金	—
							貸付金利息 (米国ドル貨建) (注 2)	3 (USD 26 千)	未収収益	—
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD 千) (注 3)	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	—	配当の受取	7,795 (USD 58,000 千)	—	—

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

資産合計	34,828 百万円
負債合計	5,655 百万円
純資産合計	29,173 百万円

営業収益	15,864 百万円
税引前当期純利益	4,191 百万円
当期純利益	3,159 百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第 63 期(自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 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 64 期(自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)

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

関連情報

第 63 期(自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 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 64 期(自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の 10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

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63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

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63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

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63期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

(収益認識関係)

第63期(自 2021年4月1日 至 2022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64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

(1株当たり情報)

項目	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	468円88銭	522円22銭
1株当たり当期純利益金額	62円50銭	91円81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63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益(百万円)	12,136	17,826
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)	12,136	17,826
普通株式の期中平均株式数(千株)	194,152	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2016年度ストックオプション(1) 88,000株、2016年度ストックオプション(2) 816,000株、2017年度ストックオプション(1) 1,536,000株	2016年度ストックオプション(2) 217,000株、2017年度ストックオプション(1) 752,000株

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63期 (2022年3月31日)	第64期 (2023年3月31日)
純資産の部の合計額(百万円)	91,035	101,391
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)	91,035	101,391
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)

当社は2022年12月21日付け株式売買契約書に基づき、星州子会社の日興アセットマネジメントインターナショナルが保有する関連会社AHAMアセットマネジメント 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。

中間財務諸表等
 (1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第 65 期中間会計期間
 (2023 年 9 月 30 日)

資産の部		
流動資産		
現金・預金		31,751
金銭の信託		2,500
有価証券		78
未収委託者報酬		16,602
未収収益		940
その他	※ 2	3,797
流動資産合計		55,670
固定資産		
有形固定資産	※ 1	330
無形固定資産		389
投資その他の資産		
投資有価証券		24,116
関係会社株式		37,647
長期差入保証金		338
繰延税金資産		240
投資その他の資産合計		62,343
固定資産合計		63,063
資産合計		118,734

(単位：百万円)

第 65 期中間会計期間
(2023 年 9 月 30 日)

負債の部		
流動負債		
未払金		8,446
未払費用		3,085
未払法人税等		1,334
未払消費税等	※3	575
賞与引当金		1,383
役員賞与引当金		162
その他		1,230
流動負債合計		16,218
固定負債		
退職給付引当金		1,458
賞与引当金		397
役員賞与引当金		40
その他		170
固定負債合計		2,067
負債合計		18,286
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		77,549
利益剰余金合計		77,549
自己株式		△2,067
株主資本合計		98,066
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		3,457
繰延ヘッジ損益		△1,075
評価・換算差額等合計		2,381
純資産合計		100,447
負債純資産合計		118,734

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

		第 65 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)
営業収益		
委託者報酬		37,779
その他営業収益		1,652
営業収益合計		39,431
営業費用及び一般管理費	※ 1	35,014
営業利益		4,416
営業外収益	※ 2	1,245
営業外費用	※ 3	1,458
経常利益		4,203
特別利益	※ 4	501
特別損失	※ 5	99
税引前中間純利益		4,605
法人税等	※ 6	1,270
中間純利益		3,335

(3) 中間株主資本等変動計算書

第 65 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)

(単位: 百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本 準備金	資本 剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	79,307	79,307	△ 2,067	99,823
当中間期変動額							
剰余金の配当				△ 5,092	△ 5,092		△ 5,092
中間純利益				3,335	3,335		3,335
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)							
当中間期変動額合計	—	—	—	△ 1,757	△ 1,757	—	△ 1,757
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	77,549	77,549	△ 2,067	98,066

	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
当中間期変動額				
剰余金の配当				△ 5,092
中間純利益				3,335
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)	1,400	△ 587	813	813
当中間期変動額合計	1,400	△ 587	813	△ 943
当中間期末残高	3,457	△ 1,075	2,381	100,447

注記事項
(重要な会計方針)

項目	第 65 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>①子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>②その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定)</p> <p>市場価格のない株式等 総平均法による原価法</p> <p>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016 年 4 月 1 日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>② 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 収益の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行业務の内容及び当該履行业務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。</p> <p>(1) 投資信託委託業務 当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高(以下「AUM」)に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドの AUM に固定料率を乗じて毎日計算さ</p>

	<p>れ、日次で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問業務 当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドの AUM に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドの AUM に投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。</p> <p>(3) 成功報酬 当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。</p>
<p>5 ヘッジ会計の方法</p>	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引細則等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価しております。</p>
<p>6 その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>(1) 資産に係る控除対象外消費税等の会計処理 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は当中間会計期間の費用として処理しております。</p> <p>(2) 税金費用の計算方法 税金費用については、当中間会計期間を含む事業年度の税引前当期純利益に対する税効果会計適用後の実効税率を合理的に見積り、税引前中間純利益に、当該見積実効税率を乗じて計算しております。</p>

(中間貸借対照表関係)

第 65 期中間会計期間 (2023 年 9 月 30 日)	
※ 1	有形固定資産の減価償却累計額 2,354 百万円
※ 2	信託資産 流動資産のその他のうち 2 百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
※ 3	消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
※ 4	保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド(旧社名「日興 AM エクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」)が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大 480 百万円(5 百万豪ドル)を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。

(中間損益計算書関係)

第 65 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
※ 1	減価償却実施額 有形固定資産 46 百万円 無形固定資産 50 百万円
※ 2	営業外収益のうち主要なもの 受取利息 16 百万円 受取配当金 1,205 百万円
※ 3	営業外費用のうち主要なもの 支払利息 255 百万円 為替差損 184 百万円 デリバティブ費用 1,017 百万円
※ 4	特別利益のうち主要なもの 投資有価証券売却益 501 百万円
※ 5	特別損失のうち主要なもの 投資有価証券売却損 97 百万円
※ 6	中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。

(中間株主資本等変動計算書関係)

第 65 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会 計期間末 残高 (百万円)
		当事業 年度期首	当中間 会計期間 増加	当中間 会計期間 減少	当中間 会計期間末	
2016 年度 ストックオプション (2)	普通株式	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 当中間会計期間の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

2 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、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額 (百万円)	1 株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
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) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間末後となるもの該当事項はありません。

(リース取引関係)

第 65 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
オペレーティング・リース取引	
解約不能のものに係る未経過リース料	
1 年内	911 百万円
1 年超	3,049 百万円
合計	3,961 百万円

(金融商品関係)

第 65 期中間会計期間(2023 年 9 月 30 日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額			
	レベル 1	レベル 2	レベル 3	合計
金銭の信託	—	2,500	—	2,500
有価証券				
其他有価証券				
投資信託	6,821	17,357	—	24,178
資産計	6,821	19,857	—	26,678
デリバティブ取引(※1、2)				
株式関連	242	—	—	242
通貨関連	—	△685	—	△685
デリバティブ取引計	242	△685	—	△442

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

(※2) 株式関連のデリバティブ取引のうち 242 百万円は、中間貸借対照表上流動資産のその他に含まれております。また通貨関連のデリバティブ取引のうち 685 百万円は、流動負債のその他に含まれております。

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、未収収益、未払金及び未払費用は、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、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

有価証券

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

デリバティブ取引

株式関連

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

通貨関連

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

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

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
非上場株式	16
子会社株式	19,011
関連会社株式	18,635

(有価証券関係)

第 65 期中間会計期間(2023 年 9 月 30 日)

1 子会社株式及び関連会社株式

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

2 その他有価証券

(単位:百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	22,320	17,117	5,202
	小計	22,320	17,117	5,202
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	1,858	2,078	△220
	小計	1,858	2,078	△220
合計		24,178	19,195	4,982

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

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

(デリバティブ取引関係)

第 65 期中間会計期間(2023 年 9 月 30 日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
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	13,289	-	242	242
	合計	13,289	-	242	242

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

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		6,055	-	△528
	豪ドル		124	-	△2
	ユーロ		344	-	△7
	香港ドル		527	-	△53
	人民元		2,876	-	△93
合計			9,928	-	△685

(持分法損益等)

第 65 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	5,339 百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	16,494 百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,148 百万円

(収益認識関係)

第 65 期中間会計期間(2023 年 9 月 30 日)

1 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(ストックオプション等関係)

第 65 期中間会計期間(自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

第 65 期中間会計期間(自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)

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

[関連情報]

第 65 期中間会計期間(自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の 10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第 65 期中間会計期間(自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第 65 期中間会計期間(自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第 65 期中間会計期間(自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)
該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

項目	第 65 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)
1 株当たり純資産額	517 円 36 銭
1 株当たり中間純利益金額	17 円 17 銭

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

2 1 株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第 65 期中間会計期間 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2023 年 9 月 30 日)
中間純利益 (百万円)	3,335
普通株主に帰属しない金額 (百万円)	—
普通株式に係る中間純利益 (百万円)	3,335
普通株式の期中平均株式数 (千株)	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後 1 株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2016 年度ストックオプション(2)121,000 株、 2017 年度ストックオプション(1)346,000 株

3 1 株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第 65 期中間会計期間 (2023 年 9 月 30 日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額 (百万円)	100,447
純資産の部の合計額から控除する金額 (百万円)	—
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額 (百万円)	100,447
1 株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数 (千株)	194,152

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

5 【その他】

- (1) 定款の変更
委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

<約款>

<追加型証券投資信託 世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型>

運用の基本方針

約款第21条の規定に基づき、委託者が別に定める運用の基本方針は次のものとします。

基本方針

この投資信託は、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長を目標として運用を行ないます。

運用方法

(1)投資対象

投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

(2)投資態度

主として、以下に掲げる各証券投資信託の受益証券に投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。

各マザーファンドの受益証券への投資比率は、原則として、信託財産の純資産総額の6分の1を基本としますが、資金動向やその見通し等によっては5%から25%の範囲内で組入率を変更する場合があります。

証券投資信託 日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

証券投資信託 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

証券投資信託 日本債券インデックスマザーファンド

証券投資信託 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

証券投資信託 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-KOKUSA I（ヘッジなし）マザーファンド

特に「日本リートインデックスJ-REITマザーファンド」や「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」においては、投資対象としている資産の流動性が他のマザーファンドと比べて相対的に低いため、資金の流入に備える場合や純資産規模が大きくなった場合等には両マザーファンドの組入率をそれぞれ5%を下限として引き下げることがあります。両マザーファンドの組入率を引き下げた場合には、現金の比率を高くする場合や他のマザーファンドの組入率をそれぞれ25%を上限に引き上げる場合があります。

また、組入率はファンド全体として国内資産の実質組入率と海外資産の実質組入率が概ね50%程度ずつになるように決定します。

ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

運用制限

(1)投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。

(2)有価証券先物取引等のデリバティブ取引の指図ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れの指図は行ないません。

(3)投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。

(4)外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

(5)外国為替の売買の予約取引の指図は、約款第24条の範囲で行ないます。

(6)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、委託者は、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。

収益分配方針

第1計算期から第3計算期までは、収益分配を行いません。第4計算期以降、毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行いません。

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。）等の全額とします。

②分配対象額についての分配方針

分配金額は、委託者が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことを目指します。

③留保益の運用方針

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益（無分配期の利益を含みます。）については、運用の基本方針に基づき運用を行いません。

（信託の種類、委託者および受託者）

第1条 この信託は証券投資信託であり、日興アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者とします。

② この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

（信託の目的、金額および追加信託の限度額）

第2条 委託者は、金100万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者は、これを引き受けます。

② 委託者は、受託者と合意の上、金30兆円を限度として信託金を追加できるものとし、追加信託を行なったときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 委託者は、受託者と合意の上、前項の限度額を変更することができます。

（信託期間）

第3条 この信託の期間は、信託契約締結日から第44条、第45条第1項、第46条第1項および第48条第2項の規定による解約の日までとします。

（受益権の取得申込の勧誘の種類）

第4条 この信託に係る受益権の取得申込の勧誘は、金融商品取引法第2条第3項第1号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第8項で定める公募により行なわれます。

（当初の受益者）

第5条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第6条により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

（受益権の分割および再分割）

第6条 委託者は、第2条第1項による受益権については100万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第7条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受託者と協議の上、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとし、

（追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法）

第7条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に、当該追加信託に係る受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産を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て得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）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、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。））、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

③ 第24条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

（追加日時異なる受益権の内容）

第8条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

（受益権の帰属と受益証券の不発行）

第9条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社振法の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第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。）。

② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

- ③ 委託者は、第6条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。
- ④ 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在のすべての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約に係る一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権に係る受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日に係る収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、保護預り会社または第41条に規定する委託者の指定する口座管理機関、委託者の指定する第一種金融商品取引業者（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。以下同じ。）および委託者の指定する登録金融機関（委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

（受益権の設定に係る受託者の通知）

第10条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

（受益権の申込単位および価額）

第11条 委託者は、第6条第1項の規定により分割される受益権を、取得申込者に対し、委託者が定める単位をもって、当該受益権の取得の申込に応ずることができるものとします。なお、第40条第3項に規定する収益分配金の再投資に係る受益権の取得の申込に限り、1口の整数倍をもって当該取得の申込に応ずることができます。また、受益権の取得申込者がその申込をしようとする場合において、委託者に対し、当該取得の申込に係る受益権について、第40条第3項に規定する収益分配金の再投資に係る受益権の取得の申込をしないことを申し出たときは、委託者が定める単位をもって、当該受益権の取得の申込に応ずることができるものとします。

- ② 委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関は、第6条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関が定める単位をもって取得の申込に応ずることができます。ただし、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関と別に定める自動けいぞく投資契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に限り、1口の整数倍をもって取得の申込に応ずることができます。
- ③ 前2項の取得申込者は、委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、委託者（第41条に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関は、当該取得申込の代金（第5項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。
- ④ 第1項および第2項の規定にかかわらず、取得申込日がニューヨーク証券取引所の休業日またはニューヨークの銀行休業日に該当する場合は、受益権の取得の申込に応じないものとします。
- ⑤ 第1項および第2項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、手数料および当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込に係る受益証券の価額は、1口につき1円に、手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑥ 前項の手数は、委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関がそれぞれ独自に定めるものとします。
- ⑦ 証券投資信託の受益証券または受益権を信託終了時まで保有した受益者（信託期間を延長した証券投資信託（追加型証券投資信託）にあっては、延長前の信託終了日（以下「当初の信託終了日」とい

ます。)以降、収益分配金の再投資以外の追加信託を行なわないものをいいます。以下本項において同じ。)にあっては、当初の信託終了日まで当該信託の受益証券または受益権を保有した受益者をいいます。以下本項において同じ。)が、その償還金(信託期間を延長した証券投資信託にあっては、当初の信託終了日以降における当該信託の受益証券または受益権の買取請求に係る売却代金または一部解約金を含みます。以下本項において同じ。)をもって、当該信託終了日(信託期間を延長した証券投資信託にあっては、当初の信託終了日以降における当該信託の受益証券または受益権の買取約定日または一部解約請求日を含みます。)の属する月の翌月の初日から起算して3ヵ月以内に、当該償還金の支払いを受けた委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関がこの信託に係る受益権の取得申込をする場合の1口当たりの受益権の価額は、当該償還金額の範囲内(単位型証券投資信託にあっては、当該償還金額とその元本額とのいずれか大きい額)で取得する口数について取得申込日の翌営業日の基準価額に、取得申込を行なう委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

なお、委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関は、当該受益者に対し、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求めることができます。

- ⑧ 第5項の規定にかかわらず、受益者が第40条第3項の規定または別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第34条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑨ 追加型証券投資信託の受益証券または受益権を保有する者が、当該信託の信託終了日の1年前の日以降に開始する委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関が別に定める期間内に、当該信託の受益証券または受益権の買取請求に係る売却代金または一部解約金をもって、当該売却代金または一部解約金の支払いを受けた委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関がこの信託に係る受益権の取得申込をする場合の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、取得申込を行なう委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関が独自に定める手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑩ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、投資対象とする投資信託証券(マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。)への投資ができない場合、金融商品取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。)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、受益権の取得申込の受付を中止することおよび既に受け付けた取得申込の受付を取消することができます。

(受益権の譲渡に係る記載または記録)

第12条 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。

- ② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項の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。)に社振法の規定に従い、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。
- ③ 委託者は、第1項に規定する振替について、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等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(受益権の譲渡の対抗要件)

第13条 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

(無記名式の受益証券の再交付)

第14条 (削除)

(記名式の受益証券の再交付)

第15条 (削除)

(毀損した場合等の再交付)

第16条 (削 除)

(受益証券の再交付の費用)

第17条 (削 除)

(投資の対象とする資産の種類)

第18条 この信託において投資の対象とする資産の種類(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条各号で定める特定資産の種類をいいます。)は、次に掲げるものとします。

1. 有価証券
2. 金銭債権
3. 約束手形

② この信託においては、前項各号に掲げる資産のほか、次に掲げる資産を投資の対象とします。

1. 為替手形

(運用の指図範囲)

第19条 委託者は、信託金を、主として日興アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者として締結された次の証券投資信託(その受益権を他の証券投資信託の信託財産に取得させることを目的とした証券投資信託であり、以下「マザーファンド」といいます。)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。)に投資することを指図します。

1. 証券投資信託 日本リートインデックスJ-REITマザーファンド 受益証券
2. 証券投資信託 海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド 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. 証券投資信託 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド 受益証券
6. 証券投資信託 海外株式インデックスMSCI-KOKUSA I(ヘッジなし)マザーファンド 受益証券
7. 短期社債等(社振法第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)およびコマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。)
10. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)のうち投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)に類する証券以外のもの
11. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

なお、第9号および第10号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

② 前項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、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の指図ができます。

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

(受託者の自己または利害関係人等との取引)

第20条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者および受託者の利害関係人(金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本条および第25条において同じ。)、第25条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第18条ならびに第19条第1項および第2項に定める資産への投資を行なうことができます。

② 前項の取扱いは、第22条、第24条および第29条から第31条までにおける委託者の指図による取引に

についても同様とします。

(運用の基本方針)

第21条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行いません。

(同一銘柄の投資信託証券への投資制限)

第22条 (削除)

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第23条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

(外国為替予約の指図)

第24条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額と投資信託証券の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

- ② 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する投資信託証券の時価総額に当該投資信託証券の信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(信託業務の委託等)

第25条 受託者は、委託者と協議の上、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの(受託者の利害関係人を含みます。)を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 信託財産の保管等を委託する場合においては、当該財産の分別管理を行なう体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務(裁量性のないものに限り、)を、受託者および委託者が適当と認める者(受託者の利害関係人を含みます。)に委託することができるものとします。

1. 信託財産の保存に係る業務
2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

(有価証券の保管)

第26条 (削除)

(混蔵寄託)

第27条 金融機関または金融商品取引業者(金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう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。以下本条において同じ。)から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託することができるものとします。

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第28条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することが

あります。

- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

（一部解約の請求および有価証券の売却等の指図）

第29条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第30条 委託者は、前条の規定による一部解約の代金および売却代金、有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等ならびにその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第31条 委託者は、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、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借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。

- ② 前項の資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、一部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
2. 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
3. 借入れ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

- ③ 一部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。

- ④ 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。

- ⑤ 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

（損益の帰属）

第32条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。（受託者による資金の立替え）

第33条 信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は、資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

（信託の計算期間）

第34条 この信託の計算期間は、毎月16日から翌月15日までとすることを原則とします。

- ② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、第1計算期間は2005年9月29日から2005年10月17日までとし、最終計算期間の終了日は第3条に定める信託期間の終了日とします。

（信託財産に関する報告）

第35条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

（信託事務等の諸費用）

第36条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託者の立替えた立替金の利息（第2項各号に掲げる諸費用を含め、以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から

支弁します。

- ② 前項に定める諸費用のほか、以下の諸費用（消費税等相当額を含みます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができます。
1. 受益証券の発行および管理事務に係る費用（券面の作成、印刷、発行および交付に係る費用ならびに印紙税を含みます。）
 2. 有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書（これらの訂正に係る書類を含みます。）の作成、印刷および提出に係る費用
 3. 目論見書および仮目論見書（これらの訂正事項分を含みます。）の作成、印刷および交付に係る費用（これらを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）
 4. 信託約款の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）
 5. 運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）
 6. この信託の受益者に対して行なう公告に係る費用ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用
 7. 格付の取得に要する費用
 8. この信託の監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用
 9. この信託の主要投資対象の1つである「日本リートインデックスJーREITマザーファンド」の運用の基本方針に規定する「東証REIT指数（配当込み）」その他これに類する標章の使用料
 10. この信託の主要投資対象の1つである「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」の運用の基本方針に規定する「S&P先進国REIT指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）」その他これに類する標章の使用料
- ③ 委託者は、前項に定める諸費用の支払いを信託財産のために行ない、支払金額の支弁を信託財産から受けることができ、また、現に信託財産のために支払った金額の支弁を受けることについて、あらかじめ受領する金額に上限を付することができます。この場合、委託者は、信託財産の規模等を考慮して、かかる上限額を定期的に見直すことができます。
- ④ 前項に基づいて実際に支払った金額の支弁を受ける代わりに、委託者は、かかる諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、実際の費用額にかかわらず、合理的な見積率により計算した金額を諸費用とみなして、その支弁を信託財産から受けることもできます。この場合、委託者は、かかる見積率に上限を付することとし、その上限の範囲内で、かかる見積率を何時にても見直すことができるものとします。
- ⑤ 前項の場合において、第2項に定める諸費用としてみならず額は、信託財産の純資産総額に見積率（前項に規定する見積率の上限は、年万分の10とします。）を乗じて得た額とし、第34条に規定する計算期間を通じて毎日計上され、委託者が定めた時期に信託財産中から支弁するものとします。

（信託報酬等の額）

第37条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第34条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の95の率を乗じて得た額とします。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。
- ③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁の時に信託財産中から支弁します。

（収益分配）

第38条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。ただし、第1、第2および第3計算期末には、収益の分配は行ないません。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

- ② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第39条 受託者は、収益分配金については、原則として毎計算期間終了日（第1計算期から第3計算期までを除きます。）の翌営業日までに、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第40条第4項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第40条第5項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

- ② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第40条 収益分配金は、第1、第2および第3計算期を除く毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行なわれた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者（第41条に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に支払います。なお、平成19年1月4日以降においても、第42条に規定する時効前の収益分配金に係る収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引き換えに受益者に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日（第1計算期から第3計算期までを除きます。）の翌営業日に収益分配金が委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関に支払われます。この場合、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の取得の申込に応じたものとしします。当該取得により増加した受益権は、第9条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。ただし、第43条第4項により信託の一部解約が行なわれた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、第1項の規定に準じて受益者に支払います。

- ③ 委託者は、第1項の規定にかかわらず、委託者の自らの募集に係る受益権に帰属する収益分配金（受益者が自己の有する受益権の全部もしくは一部の口数について、委託者に対し、この信託の収益分配金の再投資に係る受益権の取得の申込をしないことをあらかじめ申し出た場合において、委託者が、当該申し出を受け付けた受益権に帰属する収益分配金を除きます。）をこの信託の受益権の取得申込金として、各受益者ごとに当該収益分配金の再投資に係る受益権の取得の申込に応じたものとしします。当該取得により増加した受益権は、第9条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。ただし、第43条第4項により信託の一部解約が行なわれた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、第1項の規定に準じて受益者に支払います。

- ④ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者（第41条に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

- ⑤ 一部解約金は、第43条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として5営業日目から当該受益者に支払います。

- ⑥ 前各項に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関の営業所等において行なうものとしします。ただし、委託者の自らの募集に係る受益権に帰属する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行なうものとしします。

- ⑦ 収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

(委託者の自らの募集に係る受益権の口座管理機関)

第41条 委託者は、委託者の自らの募集に係る受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または記録等に関する業務を委任することができます。

(収益分配金および償還金の時効)

第42条 受益者が、収益分配金については第40条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については第40条第4項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(一部解約)

第43条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

- ② 平成19年1月4日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日以前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。
- ③ 前2項の規定にかかわらず、一部解約の実行の請求日がニューヨーク証券取引所の休業日またはニューヨークの銀行休業日に該当する場合は、受益権の一部解約の実行を受け付けられないものとします。
- ④ 委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第1項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。
- ⑤ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額から当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。
- ⑥ 委託者は、投資対象とする投資信託証券（マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。）からの換金ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受付を中止することおよび既に受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取消することができます。
- ⑦ 前項により一部解約の実行の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一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が第3項に規定する一部解約の請求を受け付けられない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の請求を受け付けることができる日とします。）を一部解約の実行の請求日として、第5項の規定に準じて算定した価額とします。
- ⑧ 委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下ることとなった場合には、第44条の規定に従ってこの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

(質権口記載または記録の受益権の取り扱い)

第43条の2 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係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受け付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

(信託契約の解約)

第44条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出るものとします。

- ② 委託者は、前項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合は、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べる

べき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約を行ないません。
- ⑤ 委託者は、この信託契約の解約を行なわないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
- ⑥ 前3項の規定は、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あって、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合は、適用しないものとします。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第45条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、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、第49条の規定に従うものとします。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第46条 委託者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は、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第49条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第47条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第48条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第49条の規定に従い新受託者を選任します。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更)

第49条 委託者は、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、受託者と合意の上、この信託約款を変更することができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出るものとします。

- ② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更を行ないません。
- ⑤ 委託者は、前項の規定により信託約款の変更を行なわないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

(反対者の買取請求権)

第50条 第44条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行なう場合において、第44条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

(公告)

第51条 委託者が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

(運用報告書の交付省略)

第51条の2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項で定める運用報告書の交付に代えて、当該運用報告書を次のアドレスに掲載するものとします。

www.nikkoam.com/

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第52条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

附 則

第1条 この約款において「自動けいぞく投資契約」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関が締結する「自動けいぞく投資契約」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合、「自動けいぞく投資契約」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第40条第7項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額を言い、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

第3条 平成18年12月29日現在の信託約款第9条、第10条および第12条から第17条までの規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 2005年9月29日

東京都港区赤坂九丁目7番1号
委託者 日興アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区大手町二丁目2番2号
受託者 野村信託銀行株式会社

