

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 20)

愛称 「DC Aナビ 20」

追加型投信／内外／資産複合

◆この目論見書により行なう「年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 20)」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 1 月 26 日に関東財務局長に提出しており、2024 年 1 月 27 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 1 月 26 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】	64
第3【ファンドの経理状況】	68
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	286
第三部【委託会社等の情報】	287
約款	346

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

- 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 20) (以下「ファンド」といいます。)
- ・愛称として「DC Aナビ 20」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1.1%（税抜1%）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。ただし、確定拠出年金制度上の取得申込みを行なう場合は、1円以上1円単位とします。

(7)【申込期間】

- 2024年1月27日から2024年7月26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
4つの異なる資産に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざします。
- ② ファンドの基本的性格
 - 1) 商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式 債券
	海外	不動産投信
追加型投信	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 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (含む日本) 日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)
不動産投信	日々	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)))	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)))

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

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

◇年1回

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

◇グローバル (含む日本)

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

◇ファミリーファンド

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

◇為替ヘッジあり (部分ヘッジ)

目論見書または投資信託約款において、一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるものをいいます。

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

③ ファンドの特色

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

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

2. インデックスファンドで構成しています。

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

<国内株式>

「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

<海外株式>

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

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

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

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

<国内債券>

「日本債券インデックスマザーファンド」

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

<海外債券>

「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

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

「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」

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

著作権などについて

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

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

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

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

3. 株式に20%、債券などに80%投資します。

資産の標準実質組入比率は、株式20%、債券など80%とします。

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

各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

投資対象	基本投資比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	15%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	2.5%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	2.5%
日本債券インデックスマザーファンド	65%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	5%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	5%
短期金融資産	5%

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

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

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

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ないます。



主な投資制限

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

分配方針

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

④ 信託金限度額

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

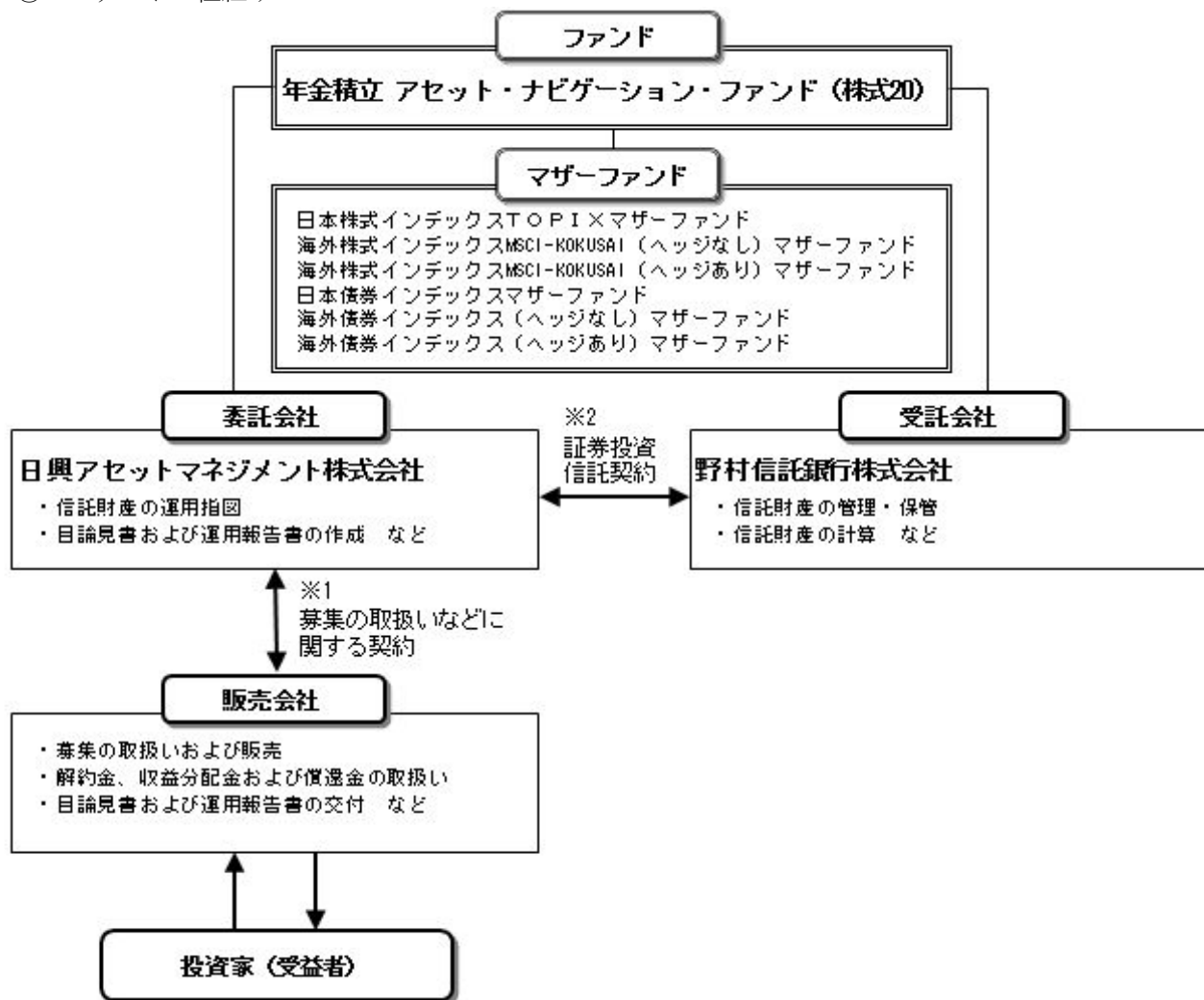
(2) 【ファンドの沿革】

2001年10月17日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

① ファンドの仕組み



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

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

② 委託会社の概況（2023年10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、以下に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」

- ・純資産総額に対する株式ならびに公社債および短期金融資産の実質組入比率については、次の標準実質組入比率を目処として投資を行ないます。

株式の標準実質組入比率……………20%

公社債および短期金融資産の標準実質組入比率……………80%

- ・組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないますが、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。
- ・また、資金動向などによっては組入比率を引き下げることがあります。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存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】

<年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）>

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」

- ① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1) 有価証券

2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限り。）

3) 金銭債権

4) 約束手形

5) 為替手形

- ② 主として次のマザーファンドの受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。

1) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券

2) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券

3) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」受益証券

4) 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

- 5) 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
 - 6) 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」受益証券
 - 7) 株券または新株引受権証書
 - 8) 国債証券
 - 9) 地方債証券
 - 10) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 11) 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。）
 - 12) 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。）
 - 13) コマーシャル・ペーパー
 - 14) 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
 - 15) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)～14)の証券または証書の性質を有するもの
 - 16) 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。）
 - 17) 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18)に定めるもの以外のもの
 - 18) 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
 - 19) 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。）
 - 20) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
 - 21) 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。）
 - 22) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 23) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
 - 24) 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
 - 25) 外国の者に対する権利で24)の有価証券の性質を有するもの
- ③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
- ④ 次の取引ができます。
- 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
 - 10) 資金の借入
- <日本株式インデックストップIX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。))

券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)

- 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)~7)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 - 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)で12)に定めるもの以外のもの
 - 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 - 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 - 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
- ③ 次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。

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

④ 次の取引ができます。

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。)
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

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

- 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
- <日本債券インデックスマザーファンド>
わが国の公社債を主要投資対象とします。
- ① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。）
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- ② 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
- 1) 国債証券
 - 2) 地方債証券
 - 3) 特別の法律により法人の発行する債券

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

限ります。)

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

④ 次の取引ができます。

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

<海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド>

内外の公社債を主要投資対象とします。

① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限ります。）
- 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 9) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 11) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの

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

- 1) 預金

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

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

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数）*配当込みの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の株式に投資し、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。

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

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

<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。

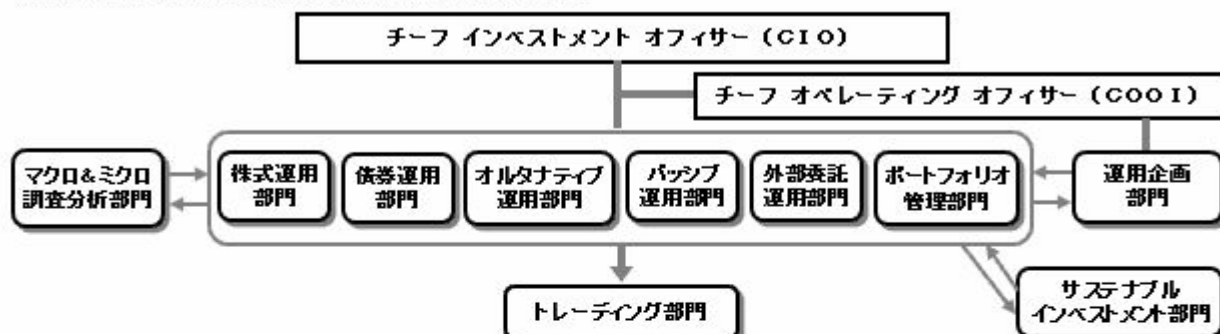
<海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド>

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

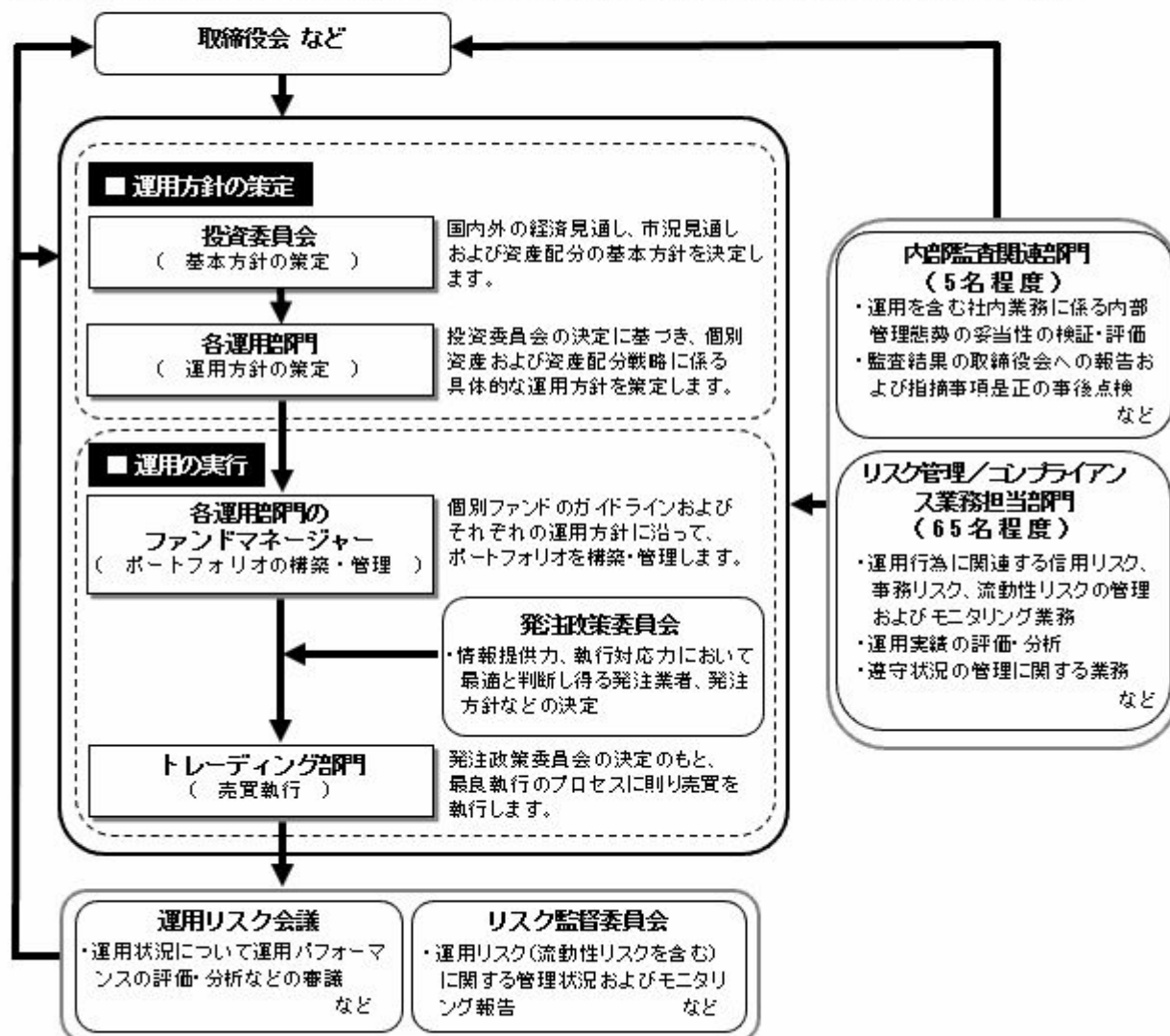
*FTSE 世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLC は、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利は FTSE Fixed Income LLC に帰属します。

(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10月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

① 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

② 収益分配金の支払い

原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

(5) 【投資制限】

① 約款に定める投資制限

＜年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 20）＞

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の 30%以下とします。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の総額の 5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の 50%以下とします。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の 50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の 50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財

産の純資産総額の範囲内とします。

- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
 - ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- ニ) 解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。
- ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- 16) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 17) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

ることができます。

イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

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

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

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

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

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

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

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

<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、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡し取引および為替先渡し取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 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者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 3) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡し取引および為替先渡し取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限り

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 価格変動リスク

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

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

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

- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
- ・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

④ 為替変動リスク

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

<その他の留意事項>

- ・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

- ・投資対象とする投資信託証券に関する事項

ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴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。

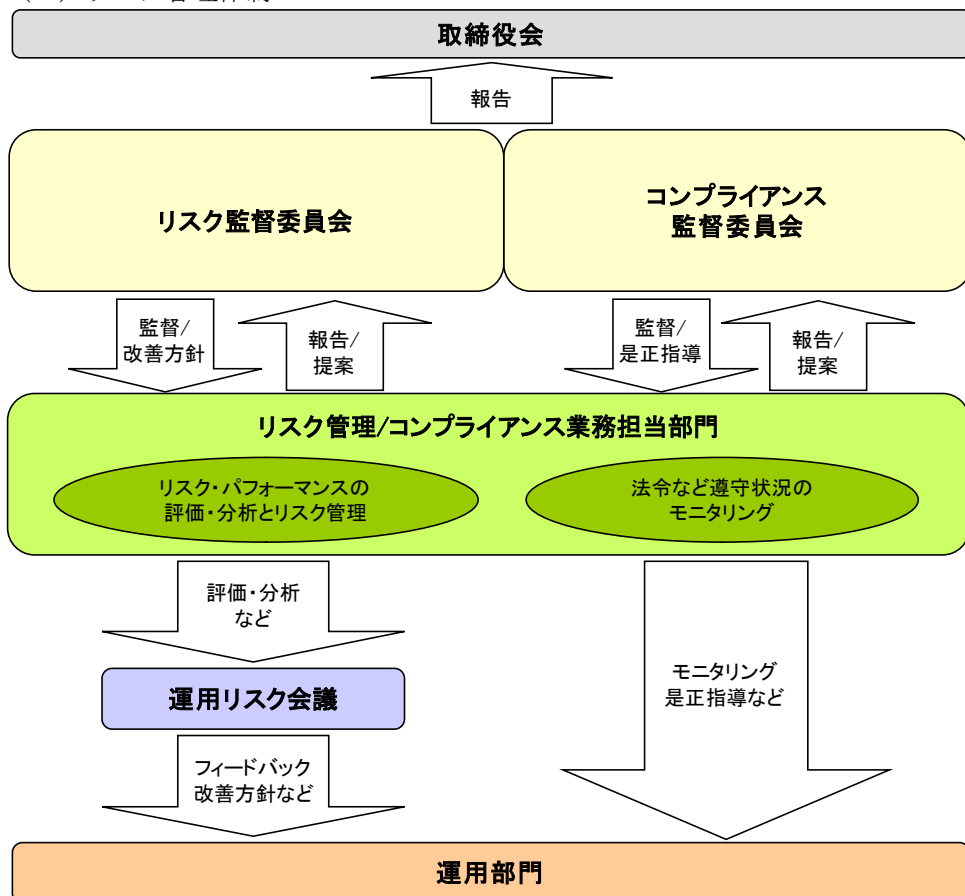
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項

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。

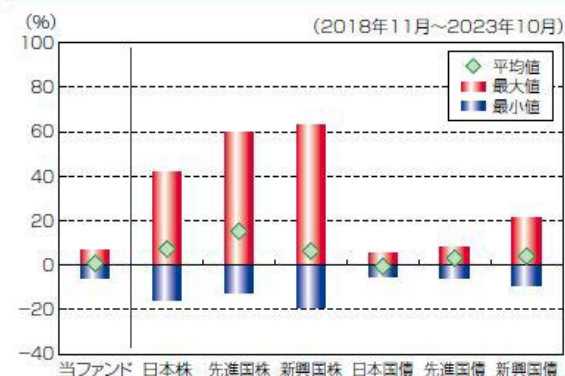
■法令など遵守状況のモニタリング

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10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	0.9%	7.2%	15.2%	6.3%	-0.6%	3.1%	3.9%
最大値	6.9%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	7.9%	21.5%
最小値	-5.6%	-16.0%	-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2018年11月から2023年10月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株 …… TOPIX(東証株価指数) 配当込み

先進国株 …… MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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、2018年11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1.1%（税抜1%）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。
- ・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。

※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0.15%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0.5885%（税抜0.535%）の率を乗じて得た額とします。

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
0.535%	0.150%	0.350%	0.035%

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

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

③ 支払時期

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

(4) 【その他の手数料等】

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 組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および先物・オプション取引などに要する費用。
- ② 信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。
- ③ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用、解約に伴う支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

- ・組入有価証券の売買時の売買委託手数料

- ・信託事務の処理に要する諸費用
- ・信託財産に関する租税 など

※監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

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

《確定拠出年金の場合》

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会の場合、所得税および地方税はかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

《確定拠出年金でない場合》

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。

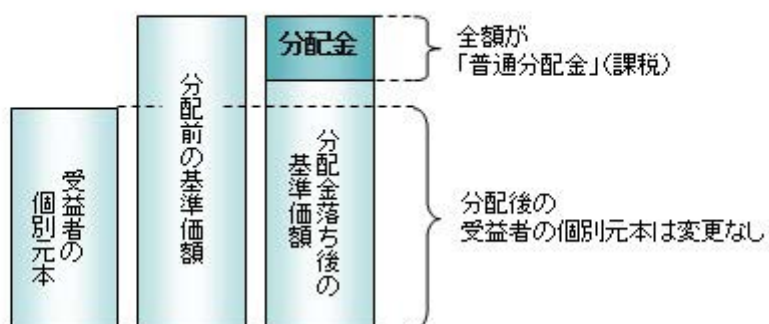
ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金

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。

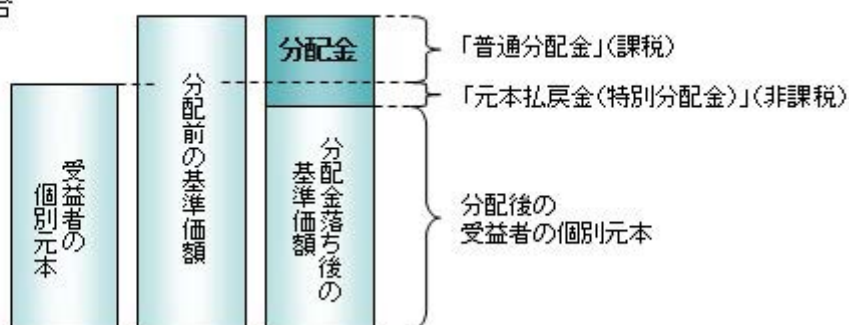
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<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 1 月 26 日現在のもので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

【年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）】

以下の運用状況は2023年10月31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	3,027,718,913	94.97
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	160,207,408	5.03
合計（純資産総額）		3,187,926,321	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	日本債券インデックスマザーファンド	1,573,090,800	1.3204	2,077,109,093	1.3148	2,068,299,783	64.88
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	209,218,206	2.2756	476,105,793	2.3059	482,436,261	15.13
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	58,964,858	2.7113	159,871,420	2.7159	160,142,657	5.02
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	125,802,471	1.2679	159,505,061	1.2728	160,121,385	5.02
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	34,744,617	2.2693	78,848,028	2.2560	78,383,855	2.46
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	15,933,401	4.9633	79,083,000	4.9164	78,334,972	2.46

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	94.97
合計	94.97

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13 計算期間末 (2014年10月27日)	2,160	2,162	1.2946	1.2956
第14 計算期間末 (2015年10月26日)	2,323	2,325	1.3723	1.3733
第15 計算期間末 (2016年10月26日)	2,400	2,402	1.3831	1.3841
第16 計算期間末 (2017年10月26日)	2,576	2,578	1.4396	1.4406
第17 計算期間末 (2018年10月26日)	2,617	2,619	1.4164	1.4174
第18 計算期間末 (2019年10月28日)	2,891	2,893	1.4687	1.4697
第19 計算期間末 (2020年10月26日)	3,015	3,017	1.4694	1.4704
第20 計算期間末 (2021年10月26日)	3,165	3,167	1.5409	1.5419
第21 計算期間末 (2022年10月26日)	3,098	3,100	1.4750	1.4760
第22 計算期間末 (2023年10月26日)	3,190	3,190	1.4867	1.4867
2022年10月末日	3,121	—	1.4860	—
11月末日	3,122	—	1.4858	—
12月末日	3,080	—	1.4543	—
2023年1月末日	3,113	—	1.4656	—
2月末日	3,148	—	1.4776	—
3月末日	3,196	—	1.4966	—
4月末日	3,223	—	1.5066	—
5月末日	3,250	—	1.5162	—
6月末日	3,305	—	1.5420	—
7月末日	3,266	—	1.5290	—
8月末日	3,267	—	1.5236	—
9月末日	3,237	—	1.5114	—
10月末日	3,187	—	1.4852	—

② 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金 (円)
第13期	2013年10月29日～2014年10月27日	0.0010
第14期	2014年10月28日～2015年10月26日	0.0010
第15期	2015年10月27日～2016年10月26日	0.0010
第16期	2016年10月27日～2017年10月26日	0.0010
第17期	2017年10月27日～2018年10月26日	0.0010
第18期	2018年10月27日～2019年10月28日	0.0010

第19期	2019年10月29日～2020年10月26日	0.0010
第20期	2020年10月27日～2021年10月26日	0.0010
第21期	2021年10月27日～2022年10月26日	0.0010
第22期	2022年10月27日～2023年10月26日	0.0000

③【収益率の推移】

期	期間	収益率 (%)
第13期	2013年10月29日～2014年10月27日	3.55
第14期	2014年10月28日～2015年10月26日	6.08
第15期	2015年10月27日～2016年10月26日	0.86
第16期	2016年10月27日～2017年10月26日	4.16
第17期	2017年10月27日～2018年10月26日	△1.54
第18期	2018年10月27日～2019年10月28日	3.76
第19期	2019年10月29日～2020年10月26日	0.12
第20期	2020年10月27日～2021年10月26日	4.93
第21期	2021年10月27日～2022年10月26日	△4.21
第22期	2022年10月27日～2023年10月26日	0.79

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

(4)【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数 (口)	解約口数 (口)
第13期	2013年10月29日～2014年10月27日	212,989,533	148,787,933
第14期	2014年10月28日～2015年10月26日	249,489,847	225,223,159
第15期	2015年10月27日～2016年10月26日	219,948,062	177,581,645
第16期	2016年10月27日～2017年10月26日	289,166,294	235,119,540
第17期	2017年10月27日～2018年10月26日	296,266,553	237,811,695
第18期	2018年10月27日～2019年10月28日	315,074,712	194,178,364
第19期	2019年10月29日～2020年10月26日	378,453,487	295,668,704
第20期	2020年10月27日～2021年10月26日	306,629,427	304,267,500
第21期	2021年10月27日～2022年10月26日	308,980,135	262,381,026
第22期	2022年10月27日～2023年10月26日	242,774,249	197,512,138

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2023年10月31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	50,237,972,840	98.68
コール・ローン等、その他資産 (負債控除後)	—	674,430,694	1.32
合計 (純資産総額)		50,912,403,534	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	676,200,000	1.33

(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	860,300	2,594.40	2,231,970,336	2,590.00	2,228,177,000	4.38
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	110,800	12,244.88	1,356,733,435	12,425.00	1,376,690,000	2.70
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	966,500	1,226.51	1,185,427,214	1,257.00	1,214,890,500	2.39
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,700	52,391.52	822,546,942	58,150.00	912,955,000	1.79
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4,674,700	173.50	811,060,450	176.80	826,486,960	1.62
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	109,700	7,117.02	780,737,360	7,220.00	792,034,000	1.56
日本	株式	三菱商事	卸売業	109,500	6,909.29	756,567,777	6,955.00	761,572,500	1.50
日本	株式	日立製作所	電気機器	77,000	8,708.58	670,560,960	9,477.00	729,729,000	1.43
日本	株式	三井物産	卸売業	124,900	5,331.53	665,908,436	5,417.00	676,583,300	1.33
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	33,200	19,342.76	642,179,962	19,755.00	655,866,000	1.29
日本	株式	信越化学工業	化学	142,300	4,239.04	603,216,404	4,468.00	635,796,400	1.25
日本	株式	任天堂	その他製品	98,900	6,116.00	604,872,772	6,221.00	615,256,900	1.21
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	109,300	5,344.67	584,173,348	5,373.00	587,268,900	1.15
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	382,100	1,593.70	608,954,316	1,506.50	575,633,650	1.13
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	139,100	4,345.45	604,452,276	4,063.00	565,163,300	1.11
日本	株式	KDDI	情報・通信業	121,400	4,455.85	540,940,875	4,487.00	544,721,800	1.07
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	208,300	2,502.00	521,166,600	2,545.50	530,227,650	1.04

日本	株式	第一三共	医薬品	136,900	4,024.34	550,932,476	3,858.00	528,160,200	1.04
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	119,300	4,220.42	503,496,970	4,333.00	516,926,900	1.02
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	152,500	3,335.75	508,702,172	3,343.00	509,807,500	1.00
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	77,500	6,044.27	468,431,579	6,124.00	474,610,000	0.93
日本	株式	HOYA	精密機器	31,100	14,410.00	448,151,000	14,335.00	445,818,500	0.88
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	252,900	1,681.49	425,250,674	1,705.00	431,194,500	0.85
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	85,300	4,660.31	397,524,780	4,857.00	414,302,100	0.81
日本	株式	ダイキン工業	機械	18,900	21,185.60	400,407,978	21,630.00	408,807,000	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	142,600	2,490.12	355,091,982	2,477.50	353,291,500	0.69
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	93,800	3,454.99	324,078,984	3,521.00	330,269,800	0.65
日本	株式	SMC	機械	4,700	68,400.00	321,480,000	68,680.00	322,796,000	0.63
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	57,200	5,413.64	309,660,382	5,493.00	314,199,600	0.62
日本	株式	丸紅	卸売業	138,300	2,183.85	302,027,685	2,178.00	301,217,400	0.59

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	0.09
		鉱業	0.40
		建設業	2.17
		食料品	3.50
		繊維製品	0.41
		パルプ・紙	0.19
		化学	5.87
		医薬品	4.78
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.69
		ガラス・土石製品	0.68
		鉄鋼	0.97
		非鉄金属	0.66
		金属製品	0.51
		機械	5.03
		電気機器	16.13
		輸送用機器	8.47
		精密機器	2.14
		その他製品	2.25
		電気・ガス業	1.42
陸運業	2.85		
海運業	0.74		
空運業	0.46		
倉庫・運輸関連業	0.14		
情報・通信業	7.76		

	卸売業	7.11
	小売業	4.31
	銀行業	7.52
	証券、商品先物取引業	0.78
	保険業	2.49
	その他金融業	1.19
	不動産業	1.94
	サービス業	4.57
合 計		98.68

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 2023年12月	買建	30	日本円	670,356,050	676,200,000	1.33

(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10月31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	208,164,796,957	69.60
	カナダ	10,026,850,935	3.35
	ドイツ	7,046,274,955	2.36
	イタリア	1,613,014,103	0.54
	フランス	9,317,856,665	3.12
	オランダ	5,357,875,997	1.79
	スペイン	2,154,827,848	0.72
	ベルギー	606,118,725	0.20
	オーストリア	157,237,446	0.05
	ルクセンブルク	145,904,573	0.05
	フィンランド	929,031,981	0.31
	アイルランド	5,520,873,480	1.85
	ポルトガル	156,264,629	0.05
	イギリス	12,189,599,465	4.08
	スイス	9,429,017,168	3.15
	スウェーデン	2,388,414,262	0.80
	ノルウェー	607,175,769	0.20
	デンマーク	2,892,285,140	0.97
	ケイマン	433,493,865	0.14
	オーストラリア	5,634,657,631	1.88
	バミューダ	343,190,043	0.11
	ニュージーランド	224,162,578	0.07
	香港	1,625,364,825	0.54
	シンガポール	973,655,588	0.33
	イスラエル	555,352,181	0.19
	ジャージー	832,322,703	0.28
	アラブ首長国連邦	0	0.00
マン島	41,285,999	0.01	
小計		289,366,905,511	96.75
投資証券	アメリカ	4,946,901,031	1.65
	カナダ	12,378,791	0.00
	フランス	105,425,476	0.04
	ベルギー	28,011,931	0.01
	イギリス	83,962,460	0.03

	オーストラリア	332,866,573	0.11
	香港	72,492,026	0.02
	シンガポール	119,811,138	0.04
	小計	5,701,849,426	1.91
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	4,006,172,524	1.34
合計（純資産総額）		299,074,927,461	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	3,598,416,024	1.20
	買建	ドイツ	695,533,708	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	—	3,685,018,510	1.23
	売建	—	16,957,256	△0.01

(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	629,794	25,581.16	16,110,861,711	25,460.05	16,034,591,705	5.36
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	282,814	50,933.57	14,404,727,147	50,431.21	14,262,654,516	4.77
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	369,750	18,149.01	6,710,599,738	19,841.47	7,336,384,309	2.45
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	98,880	62,463.78	6,176,418,854	61,539.81	6,085,056,522	2.03
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	238,020	18,779.95	4,470,003,961	18,608.01	4,429,079,635	1.48
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	88,560	44,782.73	3,965,958,595	45,250.69	4,007,401,691	1.34
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	211,550	18,938.43	4,006,425,226	18,800.88	3,977,326,693	1.33
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	114,285	31,758.91	3,629,567,509	29,507.29	3,372,241,049	1.13
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	37,185	79,271.69	2,947,718,056	79,238.80	2,946,494,960	0.99
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライ	32,269	87,681.63	2,829,398,666	84,579.30	2,729,289,499	0.91

			フサイエ ンス						
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サー ビス	51,825	50,369.91	2,610,421,053	50,446.16	2,614,372,714	0.87
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	161,521	16,235.29	2,622,340,422	15,830.11	2,556,896,619	0.85
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	116,880	20,991.20	2,453,451,924	20,545.66	2,401,377,232	0.80
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サー ビス	64,762	35,411.44	2,293,315,904	34,847.79	2,256,812,628	0.75
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	96,501	22,661.23	2,186,831,424	21,982.45	2,121,328,919	0.71
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用 品・パー ソナル用 品	94,409	22,516.20	2,125,732,492	22,315.86	2,106,818,272	0.70
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・ 半導体製 造装置	16,530	127,028.18	2,099,775,837	125,775.28	2,079,065,502	0.70
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	131,150	14,720.42	1,930,583,607	14,407.90	1,889,596,347	0.63
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サー ビス	33,865	57,757.20	1,955,947,852	55,680.51	1,885,620,613	0.63
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲 料・タバ コ	107,170	16,336.63	1,750,797,012	16,195.72	1,735,696,277	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	40,105	42,001.84	1,684,483,966	42,084.07	1,687,781,820	0.56
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	72,391	23,304.12	1,687,008,819	21,841.91	1,581,158,134	0.53
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	101,193	15,493.72	1,567,856,139	15,351.68	1,553,483,242	0.52
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	70,306	21,717.82	1,526,893,236	21,213.97	1,491,469,649	0.50
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需 品流通・ 小売り	17,664	82,229.00	1,452,493,143	82,960.10	1,465,407,362	0.49
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需 品流通・ 小売り	59,162	24,334.24	1,439,662,756	24,373.12	1,441,962,537	0.48
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウ ェア・サ ービス	18,194	77,915.64	1,417,597,179	78,782.79	1,433,374,252	0.48
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・ 半導体製 造装置	16,172	88,960.66	1,438,671,826	87,580.31	1,416,348,935	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲 料・タバ コ	164,852	8,390.50	1,383,190,904	8,394.98	1,383,930,315	0.46

アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	55,211	24,272.94	1,340,133,760	24,262.48	1,339,555,938	0.45
------	----	-------------	-----------	--------	-----------	---------------	-----------	---------------	------

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	5.38
		素材	4.02
		資本財	6.51
		商業・専門サービス	1.56
		運輸	1.74
		自動車・自動車部品	1.89
		耐久消費財・アパレル	1.53
		消費者サービス	2.06
		メディア・娯楽	5.96
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.53
		生活必需品流通・小売り	1.76
		食品・飲料・タバコ	3.77
		家庭用品・パーソナル用品	1.76
		ヘルスケア機器・サービス	4.47
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.26
		銀行	5.16
		金融サービス	6.39
		保険	3.24
		ソフトウェア・サービス	9.85
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.81
電気通信サービス	1.22		
公益事業	2.75		
半導体・半導体製造装置	5.81		
不動産管理・開発	0.32		
投資証券	—	—	1.91
合計			98.66

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 EMINI2312	買建	115	米ドル	24,119,687.5	3,606,134,478	24,068,062.5	3,598,416,024	1.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2312	買建	115	ユーロ	4,436,370	703,874,464	4,383,800	695,533,708	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	20,800,000.00	3,097,163,510	3,085,553,790	1.03
	ユーロ	買建	3,800,000.00	599,234,121	599,464,720	0.20
	加ドル	売建	157,000.00	16,957,570	16,957,256	△0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド

以下の運用状況は2023年10月31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	13,434,549,992	67.60
	カナダ	648,296,844	3.26
	ドイツ	456,892,240	2.30
	イタリア	105,684,332	0.53
	フランス	606,210,743	3.05
	オランダ	345,566,603	1.74
	スペイン	138,552,711	0.70
	ベルギー	41,524,474	0.21
	オーストリア	9,171,913	0.05
	ルクセンブルク	11,396,573	0.06
	フィンランド	62,059,145	0.31
	アイルランド	356,774,435	1.80
	ポルトガル	8,145,065	0.04
	イギリス	784,037,685	3.95
	スイス	606,425,229	3.05
	スウェーデン	150,866,921	0.76
	ノルウェー	38,665,360	0.19
	デンマーク	187,696,709	0.94
	ケイマン	30,240,307	0.15
	オーストラリア	364,998,150	1.84
	バミューダ	21,219,630	0.11
	ニュージーランド	11,586,464	0.06
	香港	102,160,957	0.51
	シンガポール	61,759,507	0.31
	イスラエル	35,309,889	0.18
	ジャージー	55,717,206	0.28
マン島	2,751,845	0.01	
小計		18,678,260,929	93.99
投資証券	アメリカ	324,756,451	1.63
	フランス	2,499,351	0.01
	イギリス	5,966,927	0.03
	オーストラリア	21,949,372	0.11
	香港	4,649,066	0.02
	シンガポール	6,332,761	0.03

	小計	366,153,928	1.84
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	828,947,450	4.17
合計（純資産総額）		19,873,362,307	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（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	657,102,056	3.31
	買建	ドイツ	127,010,503	0.64

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	—	19,317,763,379	△97.20

(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	40,620	25,581.16	1,039,106,760	25,460.05	1,034,187,552	5.20
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	18,240	50,933.57	929,028,348	50,431.21	919,865,418	4.63
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	23,840	18,149.01	432,672,611	19,841.47	473,020,695	2.38
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	6,380	62,463.78	398,518,935	61,539.81	392,623,995	1.98
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	15,300	18,779.95	287,333,251	18,608.01	284,702,623	1.43
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	5,710	44,782.73	255,709,390	45,250.69	258,381,478	1.30
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	13,690	18,938.43	259,267,130	18,800.88	257,384,081	1.30
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	7,360	31,758.91	233,745,609	29,507.29	217,173,681	1.09
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	2,400	79,271.69	190,252,073	79,238.80	190,173,132	0.96
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2,090	87,681.63	183,254,616	84,579.30	176,770,741	0.89
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	3,350	50,369.91	168,739,228	50,446.16	168,994,666	0.85
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	10,400	16,235.29	168,847,026	15,830.11	164,633,236	0.83

アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	7,510	20,991.20	157,643,942	20,545.66	154,297,938	0.78
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サー ビス	4,160	35,411.44	147,311,605	34,847.79	144,966,810	0.73
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・ バイオテ クノロジ ー・ライ フサイエ ンス	6,200	22,661.23	140,499,630	21,982.45	136,291,223	0.69
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用 品・パー ソナル用 品	6,100	22,516.20	137,348,857	22,315.86	136,126,762	0.68
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・ 半導体製 造装置	1,070	127,028.18	135,920,154	125,775.28	134,579,558	0.68
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サー ビス	2,180	57,757.20	125,910,714	55,680.51	121,383,521	0.61
デンマー ク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・ バイオテ クノロジ ー・ライ フサイエ ンス	8,400	14,720.42	123,651,562	14,407.90	121,026,377	0.61
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲 料・タバ コ	6,900	16,336.63	112,722,771	16,195.72	111,750,530	0.56
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	2,580	42,001.84	108,364,758	42,084.07	108,576,913	0.55
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギ ー	4,660	23,304.12	108,597,216	21,841.91	101,783,328	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	6,550	15,493.72	101,483,875	15,351.68	100,553,549	0.51
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・ バイオテ クノロジ ー・ライ フサイエ ンス	4,550	21,717.82	98,816,093	21,213.97	96,523,581	0.49
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需 品流通・ 小売り	1,140	82,229.00	93,741,066	82,960.10	94,574,524	0.48
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需 品流通・ 小売り	3,860	24,334.24	93,930,196	24,373.12	94,080,244	0.47
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウ ェア・サ ービス	1,170	77,915.64	91,161,300	78,782.79	92,175,875	0.46
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・ 半導体製 造装置	1,040	88,960.66	92,519,089	87,580.32	91,083,533	0.46
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲 料・タバ コ	10,640	8,390.50	89,274,932	8,394.98	89,322,656	0.45
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲 料・タバ コ	3,540	24,272.94	85,926,238	24,262.48	85,889,189	0.43

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	5.23
		素材	3.89
		資本財	6.34
		商業・専門サービス	1.55
		運輸	1.70
		自動車・自動車部品	1.85
		耐久消費財・アパレル	1.48
		消費者サービス	2.02
		メディア・娯楽	5.79
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.39
		生活必需品流通・小売り	1.71
		食品・飲料・タバコ	3.64
		家庭用品・パーソナル用品	1.72
		ヘルスケア機器・サービス	4.34
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.01
		銀行	5.02
		金融サービス	6.13
		保険	3.18
		ソフトウェア・サービス	9.60
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.61
		電気通信サービス	1.17
		公益事業	2.69
		半導体・半導体製造装置	5.63
不動産管理・開発	0.30		
投資証券	—	—	1.84
合計			95.83

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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 EMINI2312	買建	21	米ドル	4,416,825	660,359,505	4,395,037.5	657,102,056	3.31
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2312	買建	21	ユーロ	811,530	128,757,350	800,520	127,010,503	0.64

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	96,910,000.00	14,460,192,802	14,395,165,864	△72.43

加ドル	売建	5,918,000.00	636,958,140	633,908,130	△3.19
ユーロ	売建	12,000,000.00	1,889,983,677	1,890,636,334	△9.51
英ポンド	売建	4,667,000.00	839,564,699	840,064,940	△4.23
スイスフラン	売建	3,287,000.00	546,740,397	542,938,147	△2.73
スウェーデンクローナ	売建	12,409,000.00	165,408,117	165,112,185	△0.83
ノルウェークローネ	売建	2,892,000.00	38,405,276	38,493,660	△0.19
デンマーククローネ	売建	8,838,000.00	186,616,240	186,669,111	△0.94
豪ドル	売建	4,303,000.00	402,570,470	406,106,972	△2.04
ニュージーランドドル	売建	87,000.00	7,479,146	7,496,788	△0.04
香港ドル	売建	6,623,000.00	125,677,169	125,259,702	△0.63
シンガポールドル	売建	624,000.00	67,824,814	67,875,115	△0.34
イスラエルシェケル	売建	488,000.00	17,942,152	18,036,431	△0.09

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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 10 月 31 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	43,957,501,110	86.83
地方債証券	日本	2,726,009,340	5.38
特殊債券	日本	2,498,406,000	4.94
社債券	日本	1,294,268,000	2.56
コール・ローン等、その他資産 (負債控除後)	—	149,411,936	0.30
合計 (純資産総額)		50,625,596,386	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	100.35	702,457,000	0.300	2025/12/20	1.39
日本	国債証券	第344回利付国債 (10年)	700,000,000	99.87	699,090,000	99.68	697,788,000	0.100	2026/9/20	1.38
日本	国債証券	第347回利付国債 (10年)	680,000,000	99.54	676,919,600	99.29	675,233,200	0.100	2027/6/20	1.33
日本	国債証券	第345回利付国債 (10年)	660,000,000	99.78	658,548,000	99.57	657,221,400	0.100	2026/12/20	1.30
日本	国債証券	第346回利付国債 (10年)	660,000,000	99.67	657,881,400	99.44	656,350,200	0.100	2027/3/20	1.30
日本	国債証券	第343回利付国債 (10年)	645,000,000	99.94	644,658,150	99.77	643,561,650	0.100	2026/6/20	1.27
日本	国債証券	第342回利付国債 (10年)	630,000,000	100.00	630,000,000	99.85	629,099,100	0.100	2026/3/20	1.24
日本	国債証券	第340回利付国債 (10年)	620,000,000	100.65	624,054,800	100.55	623,434,800	0.400	2025/9/20	1.23
日本	国債証券	第349回利付国債 (10年)	590,000,000	99.24	585,521,900	98.96	583,869,900	0.100	2027/12/20	1.15
日本	国債証券	第339回利付国債 (10年)	570,000,000	100.61	573,516,900	100.54	573,112,200	0.400	2025/6/20	1.13
日本	国債証券	第358回利付国債 (10年)	590,000,000	97.34	574,306,000	96.95	572,046,300	0.100	2030/3/20	1.13
日本	国債証券	第360回利付国債 (10年)	580,000,000	96.68	560,784,600	96.28	558,424,000	0.100	2030/9/20	1.10
日本	国債証券	第357回利付国債 (10年)	560,000,000	97.61	546,638,400	97.24	544,560,800	0.100	2029/12/20	1.08
日本	国債証券	第350回利付国債 (10年)	540,000,000	99.06	534,967,200	98.75	533,250,000	0.100	2028/3/20	1.05
日本	国債証券	第351回利付国債 (10年)	535,000,000	98.87	529,002,650	98.52	527,098,050	0.100	2028/6/20	1.04
日本	国債証券	第352回利付国債 (10年)	520,000,000	98.67	513,120,400	98.30	511,175,600	0.100	2028/9/20	1.01

日本	国債証券	第348回利付国債 (10年)	500,000,000	99.40	497,005,000	99.13	495,680,000	0.100	2027/9/20	0.98
日本	国債証券	第363回利付国債 (10年)	500,000,000	95.57	477,875,000	95.16	475,845,000	0.100	2031/6/20	0.94
日本	国債証券	第364回利付国債 (10年)	500,000,000	95.18	475,940,000	94.80	474,040,000	0.100	2031/9/20	0.94
日本	国債証券	第361回利付国債 (10年)	460,000,000	96.30	443,016,800	95.92	441,245,800	0.100	2030/12/20	0.87
日本	国債証券	第359回利付国債 (10年)	420,000,000	97.02	407,488,200	96.62	405,825,000	0.100	2030/6/20	0.80
日本	国債証券	第370回利付国債 (10年)	420,000,000	96.87	406,854,000	96.28	404,413,800	0.500	2033/3/20	0.80
日本	国債証券	第353回利付国債 (10年)	400,000,000	98.48	393,944,000	98.12	392,480,000	0.100	2028/12/20	0.78
日本	国債証券	第338回利付国債 (10年)	390,000,000	100.55	392,172,300	100.49	391,934,400	0.400	2025/3/20	0.77
日本	国債証券	第362回利付国債 (10年)	400,000,000	95.95	383,800,000	95.55	382,216,000	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	94.87	379,508,000	0.200	2032/3/20	0.75
日本	国債証券	第369回利付国債 (10年)	390,000,000	97.02	378,413,100	96.54	376,513,800	0.500	2032/12/20	0.74
日本	国債証券	第117回利付国債 (20年)	343,000,000	109.91	377,005,020	109.45	375,423,790	2.100	2030/3/20	0.74
日本	国債証券	第368回利付国債 (10年)	390,000,000	94.70	369,330,000	94.24	367,539,900	0.200	2032/9/20	0.73
日本	国債証券	第144回利付国債 (20年)	330,000,000	105.88	349,420,500	105.23	347,275,500	1.500	2033/3/20	0.69

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	86.83
地方債証券	5.38
特殊債券	4.94
社債券	2.56
合 計	99.70

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10月31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	74,475,315,307	47.78
	カナダ	3,072,315,071	1.97
	メキシコ	1,367,170,571	0.88
	ドイツ	10,087,039,067	6.47
	イタリア	11,491,967,352	7.37
	フランス	12,925,293,126	8.29
	オランダ	2,266,737,278	1.45
	スペイン	7,609,617,683	4.88
	ベルギー	2,802,379,985	1.80
	オーストリア	1,853,548,269	1.19
	フィンランド	801,449,089	0.51
	アイルランド	904,208,022	0.58
	イギリス	7,513,054,758	4.82
	スウェーデン	306,943,978	0.20
	ノルウェー	252,102,694	0.16
	デンマーク	491,098,693	0.32
	ポーランド	825,422,477	0.53
	オーストラリア	2,219,296,389	1.42
	ニュージーランド	350,462,780	0.22
	シンガポール	678,374,045	0.44
マレーシア	823,845,371	0.53	
中国	10,838,055,044	6.95	
イスラエル	447,447,902	0.29	
	小計	154,403,144,951	99.05
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	1,480,900,665	0.95
合計（純資産総額）		155,884,045,616	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	—	26,907,480	0.02
	売建	—	22,419,300	△0.01

(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	14,458.08	975,920,432	14,490.77	978,127,536	3.625	2026/5/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,190,000	12,505.68	899,159,053	12,571.68	903,904,001	1.750	2029/11/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	12,627.74	883,942,441	12,680.89	887,662,997	0.375	2027/7/31	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,950,000	14,457.49	860,221,095	14,518.81	863,869,281	4.125	2028/7/31	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	14,045.76	858,196,046	14,118.75	862,655,783	4.125	2032/11/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,930,000	11,867.35	822,407,788	11,930.41	826,778,076	1.625	2031/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,130,000	11,414.44	813,849,972	11,476.92	818,304,812	1.250	2031/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,740,000	14,140.37	811,657,338	14,160.80	812,830,480	1.125	2025/2/28	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,830,000	11,438.09	781,222,099	11,500.57	785,489,499	1.375	2031/11/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,190,000	14,481.56	751,593,406	14,491.48	752,107,865	2.250	2024/10/31	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,901.93	745,096,541	14,924.71	746,235,807	5.000	2025/8/31	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,240,000	11,844.57	739,101,226	11,909.98	743,182,849	1.875	2032/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,412.52	720,626,239	14,435.29	721,764,758	3.000	2025/7/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,403.18	720,159,020	14,424.78	721,239,230	2.875	2025/6/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,107.07	705,353,793	14,159.06	707,953,024	3.250	2027/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,900,000	14,121.68	691,962,466	14,189.42	695,281,872	4.000	2030/7/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,980,000	13,681.33	681,330,293	13,749.07	684,703,893	3.250	2029/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,910,000	11,386.11	672,919,306	11,451.52	676,785,074	0.875	2030/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,650,000	14,465.82	672,660,867	14,477.50	673,203,835	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,730,000	14,134.82	668,577,218	14,162.27	669,875,605	2.000	2025/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	13,744.39	665,228,694	13,780.02	666,953,100	1.625	2026/5/15	0.43
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	2,074.65	663,888,387	2,074.66	663,892,803	3.020	2025/10/22	0.43
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	2,059.90	659,170,633	2,059.27	658,968,493	2.940	2024/10/17	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,530,000	14,325.21	648,932,055	14,342.73	649,725,828	2.000	2025/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	12,609.64	643,091,819	12,678.55	646,606,186	2.750	2032/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	13,093.21	629,783,817	13,158.62	632,930,068	2.375	2029/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,930,000	12,649.35	623,613,120	12,713.01	626,751,625	1.500	2028/11/30	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	12,792.44	614,037,570	12,860.19	617,289,233	2.875	2032/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,590,000	13,342.30	612,411,676	13,407.99	615,427,062	2.625	2029/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,630,000	13,118.62	607,392,124	13,185.49	610,488,475	2.375	2029/3/31	0.39

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.05
合計	99.05

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	180,000.00	26,962,200	26,907,480	0.02
	米ドル	売建	150,000.00	22,414,500	22,419,300	△0.01

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

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

以下の運用状況は2023年10月31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	10,542,549,415	48.20
	カナダ	428,838,515	1.96
	メキシコ	193,379,457	0.88
	ドイツ	1,401,957,794	6.41
	イタリア	1,610,226,040	7.36
	フランス	1,787,743,325	8.17
	オランダ	322,056,806	1.47
	スペイン	1,054,597,247	4.82
	ベルギー	398,043,557	1.82
	オーストリア	262,822,616	1.20
	フィンランド	98,248,960	0.45
	アイルランド	128,409,344	0.59
	イギリス	1,053,003,150	4.81
	スウェーデン	54,298,726	0.25
	ノルウェー	41,683,714	0.19
	デンマーク	67,008,141	0.31
	ポーランド	119,191,633	0.54
	オーストラリア	297,245,921	1.36
	ニュージーランド	33,726,984	0.15
	シンガポール	89,279,262	0.41
マレーシア	257,316,463	1.18	
中国	1,507,463,576	6.89	
イスラエル	68,202,506	0.31	
	小計	21,817,293,152	99.74
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	57,102,303	0.26
合計（純資産総額）		21,874,395,455	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	—	22,043,087,533	△100.77

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,800,000	14,465.82	549,701,354	14,477.50	550,145,070	2.250	2024/11/15	2.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	13,705.26	548,210,709	13,751.98	550,079,584	2.000	2026/11/15	2.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	14,122.26	451,912,515	14,149.13	452,772,257	2.250	2025/11/15	2.07
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,650,000	14,325.21	379,618,090	14,342.73	380,082,438	2.000	2025/2/15	1.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	12,175.42	292,210,119	12,244.62	293,871,115	1.500	2030/2/15	1.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,100,000	13,744.39	288,632,284	13,780.02	289,380,477	1.625	2026/5/15	1.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	14,134.82	282,696,498	14,162.27	283,245,499	2.000	2025/8/15	1.29
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,800,000	14,421.57	259,588,262	14,432.96	259,793,330	2.250	2024/12/31	1.19
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,990,000	12,581.61	250,374,047	12,637.67	251,489,765	0.625	2027/11/30	1.15
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	13,844.85	221,517,605	13,874.63	221,994,123	1.625	2026/2/15	1.01
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	13,708.19	205,622,972	13,757.83	206,367,532	2.375	2027/5/15	0.94
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	13,641.60	204,624,096	13,702.05	205,530,799	2.875	2028/8/15	0.94
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	13,559.85	203,397,814	13,590.80	203,862,043	0.375	2025/11/30	0.93
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	12,670.09	202,721,447	12,729.07	203,665,154	1.250	2028/6/30	0.93
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	11,351.65	192,978,074	11,418.82	194,120,046	0.625	2030/5/15	0.89
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	14,258.05	185,354,664	14,281.12	185,654,566	2.125	2025/5/15	0.85
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,400,000	12,515.90	175,222,610	12,576.64	176,073,053	1.125	2028/8/31	0.80
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	14,243.15	170,917,919	14,264.76	171,177,169	1.750	2025/3/15	0.78
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	850,000	18,707.02	159,009,750	18,809.22	159,878,390	5.750	2032/10/25	0.73
イギリス	国債証券	UNITED KINGDOM GILT	900,000	17,304.81	155,743,292	17,331.56	155,984,061	2.000	2025/9/7	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,350,000	6,576.09	154,538,178	6,620.48	155,581,332	1.250	2050/5/15	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	13,733.88	151,072,723	13,782.35	151,605,906	2.250	2027/2/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	13,570.36	149,274,014	13,621.75	149,839,266	2.250	2027/8/15	0.68
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,000,000	14,004.71	140,047,119	14,096.78	140,967,823	1.500	2031/5/25	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	12,556.49	138,121,419	12,613.14	138,744,562	0.500	2027/10/31	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	13,217.02	132,170,279	13,266.08	132,660,821	1.125	2027/2/28	0.61
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	900,000	14,504.11	130,536,992	14,576.72	131,190,560	1.700	2032/8/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	12,746.31	127,463,105	12,808.50	128,085,067	1.250	2028/4/30	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	14,198.77	127,788,933	14,225.63	128,030,736	2.625	2025/12/31	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,270,000	9,972.19	126,646,907	10,031.17	127,395,974	2.875	2052/5/15	0.58

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.74
合計	99.74

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	71,127,000.00	10,618,412,872	10,570,353,063	△48.32

加ドル	売建	4,025,000.00	435,016,037	432,146,588	△1.98
メキシコペソ	売建	24,271,000.00	194,523,490	196,710,167	△0.90
ユーロ	売建	45,221,000.00	7,139,436,428	7,142,219,195	△32.65
英ポンド	売建	5,955,000.00	1,075,323,234	1,076,263,625	△4.92
スウェーデンクローナ	売建	4,151,000.00	55,600,996	55,415,796	△0.25
ノルウェークローネ	売建	3,172,000.00	42,185,792	42,317,930	△0.19
デンマーククローネ	売建	3,263,000.00	68,902,090	68,910,029	△0.32
ポーランドズロチ	売建	3,412,000.00	120,273,386	120,934,605	△0.55
豪ドル	売建	3,187,000.00	298,407,105	301,037,156	△1.38
ニュージーランドドル	売建	411,000.00	35,593,230	35,755,737	△0.16
シンガポールドル	売建	834,000.00	90,677,994	90,752,641	△0.41
マレーシアリングgit	売建	10,130,000.00	316,518,941	316,979,856	△1.45
中国元	売建	74,686,000.00	1,528,579,892	1,522,364,572	△6.96
イスラエルシェケル	売建	1,911,000.00	70,427,038	70,926,573	△0.32

(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10月31日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 14,852円

純資産総額…………… 31.87億円

※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10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ことにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2019年10月	2020年10月	2021年10月	2022年10月	2023年10月	設定来累計
10円	10円	10円	10円	0円	180円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	15.13%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	2.46%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	2.46%
日本債券インデックスマザーファンド	64.88%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	5.02%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	5.02%
現金その他	5.03%

※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	業種・種類	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	輸送用機器	4.38%
	2 ソニーグループ	電気機器	2.70%
	3 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.39%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.36%
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.77%
	3 AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	2.45%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	1 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.20%
	2 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.63%
	3 AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	2.38%
日本債券インデックスマザーファンド	1 第341回利付国債(10年)	国債証券	1.39%
	2 第344回利付国債(10年)	国債証券	1.38%
	3 第347回利付国債(10年)	国債証券	1.33%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	国債証券	0.63%
	2 US TREASURY N/B(クーポン1.750%)	国債証券	0.58%
	3 US TREASURY N/B(クーポン0.375%)	国債証券	0.57%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン2.250%)	国債証券	2.52%
	2 US TREASURY N/B(クーポン2.000%)	国債証券	2.51%
	3 US TREASURY N/B(クーポン2.250%)	国債証券	2.07%

※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。

※2023年は、2023年10月末までの騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。なお、確定拠出年金制度上の取得申込みを行なう場合は、当該規定に従うものとします。

(2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(3) 取扱時間

原則として、午後3時までに、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、翌営業日の取扱いとなります。

(4) 申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、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。

(5) 申込単位

販売会社の照会先にお問い合わせください。ただし、確定拠出年金制度上の取得申込みを行なう場合は、1円以上1円単位とします。

(6) 申込代金の支払い

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

(7) 受付の中止および取消

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

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

2【換金（解約）手続等】

<解約請求による換金>

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

原則として、午後3時までに、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、翌営業日の取扱いとなります。

(3) 解約制限

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

(4) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に0.15%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。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。

※確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会が委託する事務委託先金融機関でない場合、解約価額から解約に係る所定の税金が差し引かれます。

※税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、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。

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

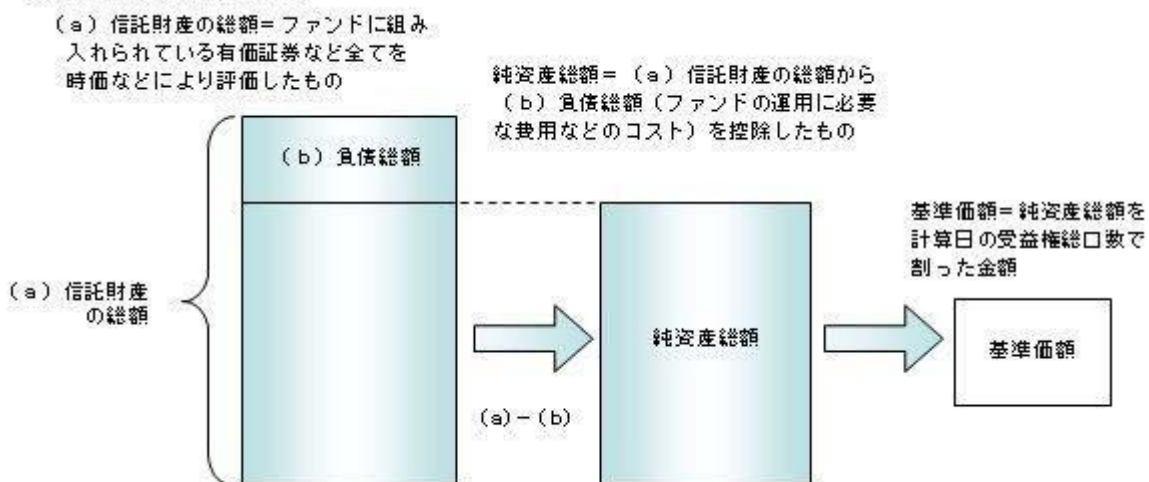
3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

① 基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



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。
- ・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(2001年10月17日設定)。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎年10月27日から翌年10月26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、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。
- 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。

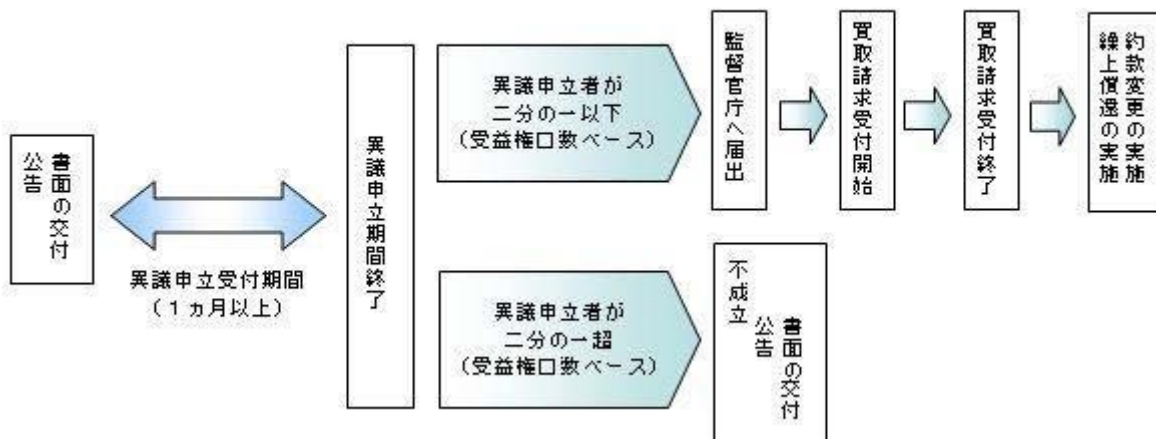
④ 異議の申立て

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第22期計算期間（2022年10月27日から2023年10月26日まで）の財務諸表について、PwC Japan 有限責任監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年1月17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」に掲げられている年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）の2022年10月27日から2023年10月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）の2023年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注) 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】

【年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 21 期 2022 年 10 月 26 日現在	第 22 期 2023 年 10 月 26 日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	163,655,277	170,513,148
親投資信託受益証券	2,946,511,140	3,029,720,138
流動資産合計	3,110,166,417	3,200,233,286
資産合計	3,110,166,417	3,200,233,286
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,100,863	-
未払解約金	5,839	9,026
未払受託者報酬	605,208	628,306
未払委託者報酬	8,646,766	8,976,751
未払利息	266	60
その他未払費用	69,115	71,749
流動負債合計	11,428,057	9,685,892
負債合計	11,428,057	9,685,892
純資産の部		
元本等		
元本	2,100,863,562	2,146,125,673
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	997,874,798	1,044,421,721
（分配準備積立金）	376,074,357	364,043,672
元本等合計	3,098,738,360	3,190,547,394
純資産合計	3,098,738,360	3,190,547,394
負債純資産合計	3,110,166,417	3,200,233,286

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 21 期		第 22 期	
	自	2021 年 10 月 27 日	自	2022 年 10 月 27 日
	至	2022 年 10 月 26 日	至	2023 年 10 月 26 日
営業収益				
有価証券売買等損益		△117,414,315		43,441,686
営業収益合計		△117,414,315		43,441,686
営業費用				
支払利息		27,586		60,959
受託者報酬		1,211,658		1,229,413
委託者報酬		17,311,211		17,564,912
その他費用		138,365		140,595
営業費用合計		18,688,820		18,995,879
営業利益又は営業損失 (△)		△136,103,135		24,445,807
経常利益又は経常損失 (△)		△136,103,135		24,445,807
当期純利益又は当期純損失 (△)		△136,103,135		24,445,807
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 (△)		△8,274,187		5,561,215
期首剰余金又は期首欠損金 (△)		1,111,056,677		997,874,798
剰余金増加額又は欠損金減少額		157,693,430		121,285,971
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		157,693,430		121,285,971
剰余金減少額又は欠損金増加額		140,945,498		93,623,640
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		140,945,498		93,623,640
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		2,100,863		-
期末剰余金又は期末欠損金 (△)		997,874,798		1,044,421,721

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		第 21 期 2022 年 10 月 26 日現在	第 22 期 2023 年 10 月 26 日現在
1.	期首元本額	2,054,264,453 円	2,100,863,562 円
	期中追加設定元本額	308,980,135 円	242,774,249 円
	期中一部解約元本額	262,381,026 円	197,512,138 円
2.	受益権の総数	2,100,863,562 口	2,146,125,673 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 21 期 自 2021 年 10 月 27 日 至 2022 年 10 月 26 日		第 22 期 自 2022 年 10 月 27 日 至 2023 年 10 月 26 日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益 20,520,231 円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益 20,931,071 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 814,103,330 円	C	信託約款に定める収益調整金 873,304,048 円
D	信託約款に定める分配準備積立 金 357,654,989 円	D	信託約款に定める分配準備積立 金 343,112,601 円
E	分配対象収益 (A+B+C+D) 1,192,278,550 円	E	分配対象収益 (A+B+C+D) 1,237,347,720 円
F	分配対象収益(1 万口当たり) 5,675 円	F	分配対象収益(1 万口当たり) 5,765 円
G	分配金額 2,100,863 円	G	分配金額 0 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) 0 円

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	第 21 期 自 2021 年 10 月 27 日 至 2022 年 10 月 26 日	第 22 期 自 2022 年 10 月 27 日 至 2023 年 10 月 26 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

	第 21 期	第 22 期
--	--------	--------

	2022年10月26日現在	2023年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第21期(2022年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	△111,606,134
合計	△111,606,134

第22期(2023年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	27,737,337
合計	27,737,337

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第21期 2022年10月26日現在		第22期 2023年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.4750円	1口当たり純資産額	1.4867円
(1万口当たり純資産額)	(14,750円)	(1万口当たり純資産額)	(14,867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	15,811,296	78,482,529	
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI (ヘッジあり) マザーファンド	34,386,093	78,042,676	
	日本債券インデックスマザーファンド	1,574,305,602	2,078,713,116	
	海外債券インデックス (ヘッジなし) マザーファンド	59,299,022	160,777,438	
	海外債券インデックス (ヘッジあり) マザーファンド	125,965,523	159,711,686	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	208,302,656	473,992,693	
合計		2,018,070,192	3,029,720,138	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2022年10月26日現在	2023年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	148,573,517	199,216,513
株式	43,156,227,610	49,297,077,010
派生商品評価勘定	21,683,500	29,450
未収配当金	453,000,178	475,719,551
前払金	-	22,607,100
流動資産合計	43,779,484,805	49,994,649,624
資産合計	43,779,484,805	49,994,649,624
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	31,323,050
前受金	18,700,000	-
未払解約金	9,624,321	5,851,369
未払利息	241	71
流動負債合計	28,324,562	37,174,490
負債合計	28,324,562	37,174,490
純資産の部		
元本等		
元本	22,875,362,128	21,954,159,010
剰余金		
剰余金又は欠損金(△)	20,875,798,115	28,003,316,124
元本等合計	43,751,160,243	49,957,475,134
純資産合計	43,751,160,243	49,957,475,134
負債純資産合計	43,779,484,805	49,994,649,624

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)

		2022年10月26日現在	2023年10月26日現在
1.	期首	2021年10月27日	2022年10月27日
	期首元本額	21,309,131,563円	22,875,362,128円
	期首からの追加設定元本額	3,195,854,871円	1,794,794,202円
	期首からの一部解約元本額	1,629,624,306円	2,715,997,320円
	元本の内訳 ※		
	DCインデックスバランス（株式20）	812,653,264円	745,167,154円
	DCインデックスバランス（株式40）	2,151,421,241円	2,067,436,177円
	DCインデックスバランス（株式60）	4,264,520,991円	4,402,676,540円
	DCインデックスバランス（株式80）	4,651,930,057円	5,228,953,333円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,697,661,452円	1,811,645,166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	3,238,040,982円	2,707,551,045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）	600,774,622円	493,098,615円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	－円	922,892円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	－円	580,795円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	－円	322,580円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	2,446,891,512円	1,753,076,468円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	245,697,725円	208,302,656円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	685,625,100円	604,003,733円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,049,367,499円	961,323,653円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,030,777,683円	969,098,203円
計	22,875,362,128円	21,954,159,010円	
2.	受益権の総数	22,875,362,128口	21,954,159,010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	530,690,000円	702,225,000円

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	自 2021 年 10 月 27 日 至 2022 年 10 月 26 日	自 2022 年 10 月 27 日 至 2023 年 10 月 26 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

	2022 年 10 月 26 日現在	2023 年 10 月 26 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)

(2022 年 10 月 26 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	△1,858,734,739
合計	△1,858,734,739

(2023 年 10 月 26 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	6,510,114,601
合計	6,510,114,601

(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)

(2022年10月26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	553,850,000	—	575,550,000	21,700,000
合計		553,850,000	—	575,550,000	21,700,000

(2023年10月26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	698,327,100	—	667,050,000	△31,277,100
合計		698,327,100	—	667,050,000	△31,277,100

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2022年10月26日現在		2023年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.9126円	1口当たり純資産額	2.2755円
(1万口当たり純資産額)	(19,126円)	(1万口当たり純資産額)	(22,755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	3,750.00	3,000,000	
ニッセイ	21,900	706.50	15,472,350	
マルハニチロ	3,300	2,481.00	8,187,300	
雪国まいたけ	1,800	885.00	1,593,000	
カネコ種苗	700	1,398.00	978,600	
サカタのタネ	2,500	3,970.00	9,925,000	
ホクト	1,900	1,810.00	3,439,000	
ホクリヨウ	200	1,033.00	206,600	
住石ホールディングス	2,300	505.00	1,161,500	
日鉄鉱業	900	4,455.00	4,009,500	
三井松島ホールディングス	1,000	2,642.00	2,642,000	
I N P E X	80,900	2,137.50	172,923,750	
石油資源開発	2,500	5,010.00	12,525,000	
K&Oエナジーグループ	1,000	2,387.00	2,387,000	
ショーボンドホールディングス	3,000	5,604.00	16,812,000	
ミライト・ワン	7,300	1,927.50	14,070,750	
サンヨーホームズ	300	716.00	214,800	
日本アクア	700	909.00	636,300	
ファーストコーポレーション	500	749.00	374,500	
ベステラ	400	981.00	392,400	
キャンディル	400	550.00	220,000	
ダイセキ環境ソリューション	400	991.00	396,400	
第一カッター興業	600	1,194.00	716,400	
安藤・間	12,700	1,139.00	14,465,300	
東急建設	6,300	745.00	4,693,500	
コムシスホールディングス	7,000	3,036.00	21,252,000	
ビーアールホールディングス	3,700	359.00	1,328,300	
高松コンストラクショングループ	1,500	2,782.00	4,173,000	
東建コーポレーション	600	7,670.00	4,602,000	
ソネック	200	962.00	192,400	
ヤマウラ	1,200	1,214.00	1,456,800	
オリエンタル白石	8,200	327.00	2,681,400	
大成建設	14,300	4,988.00	71,328,400	

大林組	54,800	1,265.50	69,349,400
清水建設	43,500	1,037.00	45,109,500
飛島建設	1,800	1,348.00	2,426,400
長谷工コーポレーション	15,800	1,836.50	29,016,700
松井建設	1,600	749.00	1,198,400
銭高組	200	3,755.00	751,000
鹿島建設	34,000	2,406.00	81,804,000
不動テトラ	1,100	1,947.00	2,141,700
大末建設	400	1,419.00	567,600
鉄建建設	1,100	1,991.00	2,190,100
西松建設	2,600	3,485.00	9,061,000
三井住友建設	12,600	391.00	4,926,600
大豊建設	700	3,870.00	2,709,000
ナカノフドー建設	1,000	376.00	376,000
奥村組	2,500	4,465.00	11,162,500
東鉄工業	2,100	2,871.00	6,029,100
イチケン	300	2,013.00	603,900
富士ピー・エス	700	441.00	308,700
浅沼組	1,300	3,510.00	4,563,000
戸田建設	18,900	804.70	15,208,830
熊谷組	2,600	3,695.00	9,607,000
北野建設	200	2,994.00	598,800
植木組	300	1,413.00	423,900
矢作建設工業	2,200	1,219.00	2,681,800
ピーエス三菱	2,100	789.00	1,656,900
日本ハウスホールディングス	3,500	372.00	1,302,000
新日本建設	2,200	1,171.00	2,576,200
東亜道路工業	600	5,330.00	3,198,000
日本道路	1,600	1,947.00	3,115,200
東亜建設工業	1,300	3,635.00	4,725,500
日本国土開発	4,500	593.00	2,668,500
若築建設	700	2,926.00	2,048,200
東洋建設	5,000	1,229.00	6,145,000
五洋建設	21,800	851.00	18,551,800
福田組	600	4,735.00	2,841,000
住友林業	13,200	3,479.00	45,922,800

日本基礎技術	800	441.00	352,800
巴コーポレーション	1,300	570.00	741,000
大和ハウス工業	42,300	3,999.00	169,157,700
ライト工業	2,900	1,891.00	5,483,900
積水ハウス	46,500	2,861.00	133,036,500
日特建設	1,600	1,035.00	1,656,000
北陸電気工事	1,200	973.00	1,167,600
ユアテック	3,400	936.00	3,182,400
日本リーテック	1,400	1,223.00	1,712,200
四電工	700	2,880.00	2,016,000
中電工	2,400	2,398.00	5,755,200
関電工	8,400	1,306.00	10,970,400
きんでん	10,800	2,098.50	22,663,800
東京エネシス	1,600	950.00	1,520,000
トーエネック	500	4,015.00	2,007,500
住友電設	1,500	2,638.00	3,957,000
日本電設工業	2,600	1,983.00	5,155,800
エクシオグループ	7,100	2,992.00	21,243,200
新日本空調	900	2,271.00	2,043,900
九電工	3,700	4,448.00	16,457,600
三機工業	3,400	1,680.00	5,712,000
日揮ホールディングス	15,200	1,844.50	28,036,400
中外炉工業	600	2,067.00	1,240,200
ヤマト	1,000	909.00	909,000
太平電業	1,000	3,860.00	3,860,000
高砂熱学工業	3,700	2,802.00	10,367,400
三晃金属工業	100	4,020.00	402,000
朝日工業社	700	2,361.00	1,652,700
明星工業	2,700	994.00	2,683,800
大気社	1,800	4,335.00	7,803,000
ダイダン	2,100	1,442.00	3,028,200
日比谷総合設備	1,300	2,236.00	2,906,800
フィル・カンパニー	400	545.00	218,000
テスホールディングス	3,400	457.00	1,553,800
インフロニア・ホールディングス	16,100	1,540.00	24,794,000
東洋エンジニアリング	2,200	588.00	1,293,600

レイズネクスト	2,300	1,412.00	3,247,600
ニッポン	4,100	2,166.00	8,880,600
日清製粉グループ本社	14,200	1,816.50	25,794,300
日東富士製粉	300	4,720.00	1,416,000
昭和産業	1,300	2,915.00	3,789,500
鳥越製粉	900	703.00	632,700
中部飼料	2,100	1,074.00	2,255,400
フィード・ワン	2,200	756.00	1,663,200
東洋精糖	200	1,889.00	377,800
日本甜菜製糖	900	1,843.00	1,658,700
DM三井製糖ホールディングス	1,500	2,967.00	4,450,500
塩水港精糖	1,200	241.00	289,200
ウェルネオシュガー	800	2,007.00	1,605,600
森永製菓	2,700	5,335.00	14,404,500
中村屋	400	3,055.00	1,222,000
江崎グリコ	4,400	4,207.00	18,510,800
名糖産業	600	1,601.00	960,600
井村屋グループ	800	2,298.00	1,838,400
不二家	1,100	2,451.00	2,696,100
山崎製パン	10,300	2,887.50	29,741,250
第一屋製パン	200	486.00	97,200
モロゾフ	500	3,695.00	1,847,500
亀田製菓	1,000	4,020.00	4,020,000
寿スピリッツ	8,200	1,955.00	16,031,000
カルビー	7,000	2,753.50	19,274,500
森永乳業	2,800	5,791.00	16,214,800
六甲バター	1,100	1,371.00	1,508,100
ヤクルト本社	22,000	3,509.00	77,198,000
明治ホールディングス	18,800	3,713.00	69,804,400
雪印メグミルク	3,700	2,333.00	8,632,100
プリマハム	2,100	2,264.00	4,754,400
日本ハム	6,000	4,355.00	26,130,000
林兼産業	300	544.00	163,200
丸大食品	1,600	1,622.00	2,595,200
S F o o d s	1,700	3,100.00	5,270,000
柿安本店	600	2,447.00	1,468,200

伊藤ハム米久ホールディングス	2,300	4,040.00	9,292,000	
サッポロホールディングス	5,100	5,073.00	25,872,300	
アサヒグループホールディングス	35,500	5,297.00	188,043,500	
麒麟ホールディングス	64,000	2,099.50	134,368,000	
宝ホールディングス	10,500	1,221.50	12,825,750	
オエノンホールディングス	4,600	384.00	1,766,400	
養命酒製造	500	1,850.00	925,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	12,000	1,938.00	23,256,000	
サントリー食品インターナショナル	10,800	4,445.00	48,006,000	
ダイドーグループホールディングス	900	5,610.00	5,049,000	
伊藤園	5,200	4,738.00	24,637,600	
キーコーヒー	1,700	2,018.00	3,430,600	
ユニカフェ	300	943.00	282,900	
ジャパンフーズ	200	1,103.00	220,600	
日清オイリオグループ	2,200	4,005.00	8,811,000	
不二製油グループ本社	3,600	2,296.50	8,267,400	
J-オイルミルズ	1,600	1,723.00	2,756,800	
キッコーマン	10,200	8,151.00	83,140,200	
味の素	37,100	5,533.00	205,274,300	
ブルドックソース	800	2,030.00	1,624,000	
キューピー	8,300	2,545.00	21,123,500	
ハウス食品グループ本社	4,700	3,114.00	14,635,800	
カゴメ	6,600	3,088.00	20,380,800	
焼津水産化学工業	400	1,198.00	479,200	
アリアケジャパン	1,400	4,694.00	6,571,600	
ピエトロ	200	1,803.00	360,600	
エバラ食品工業	400	2,913.00	1,165,200	
やまみ	100	2,261.00	226,100	
ニチレイ	7,000	3,151.00	22,057,000	
東洋水産	7,800	6,424.00	50,107,200	
イトアンドホールディングス	700	1,986.00	1,390,200	
大冷	100	1,914.00	191,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,000	974.00	974,000	
日清食品ホールディングス	5,400	12,525.00	67,635,000	
永谷園ホールディングス	800	2,217.00	1,773,600	

一正蒲鉾	400	737.00	294,800
フジッコ	1,600	1,911.00	3,057,600
ロック・フィールド	1,700	1,532.00	2,604,400
日本たばこ産業	93,400	3,455.00	322,697,000
ケンコーマヨネーズ	1,100	1,502.00	1,652,200
わらべや日洋ホールディングス	1,100	3,445.00	3,789,500
なとり	1,000	1,971.00	1,971,000
イフジ産業	200	1,537.00	307,400
ファーマフーズ	2,200	1,302.00	2,864,400
ユーグレナ	9,600	723.00	6,940,800
紀文食品	1,200	1,131.00	1,357,200
ピクルスホールディングス	900	1,164.00	1,047,600
ミヨシ油脂	400	1,244.00	497,600
理研ビタミン	1,300	2,187.00	2,843,100
片倉工業	1,400	1,702.00	2,382,800
グンゼ	1,100	4,455.00	4,900,500
東洋紡	6,800	1,002.00	6,813,600
ユニチカ	4,800	190.00	912,000
富士紡ホールディングス	600	3,395.00	2,037,000
倉敷紡績	1,200	2,260.00	2,712,000
シキボウ	600	1,075.00	645,000
日本毛織	4,200	1,343.00	5,640,600
ダイトウボウ	1,800	87.00	156,600
トーア紡コーポレーション	400	426.00	170,400
ダイドーリミテッド	1,500	340.00	510,000
帝国繊維	1,700	1,841.00	3,129,700
帝人	15,000	1,363.00	20,445,000
東レ	104,700	713.10	74,661,570
住江織物	200	2,105.00	421,000
日本フェルト	600	414.00	248,400
イチカワ	100	1,551.00	155,100
日東製網	100	1,407.00	140,700
アツギ	600	416.00	249,600
ダイニック	300	780.00	234,000
セーレン	3,000	2,135.00	6,405,000
ソトー	300	716.00	214,800

東海染工	100	979.00	97,900
小松マテーレ	2,300	710.00	1,633,000
ワコールホールディングス	2,800	3,445.00	9,646,000
ホギメディカル	2,100	3,250.00	6,825,000
クラウドディアホールディングス	200	407.00	81,400
T S I ホールディングス	5,200	798.00	4,149,600
マツオカコーポレーション	300	1,572.00	471,600
ワールド	2,000	1,518.00	3,036,000
三陽商会	400	2,596.00	1,038,400
ナイガイ	400	275.00	110,000
オンワードホールディングス	10,200	463.00	4,722,600
ルックホールディングス	300	1,981.00	594,300
ゴールドウイン	2,800	9,597.00	26,871,600
デザート	2,700	4,145.00	11,191,500
キング	400	661.00	264,400
ヤマトインターナショナル	800	296.00	236,800
特種東海製紙	700	3,465.00	2,425,500
王子ホールディングス	65,100	629.30	40,967,430
日本製紙	8,100	1,298.00	10,513,800
三菱製紙	1,300	551.00	716,300
北越コーポレーション	9,800	1,075.00	10,535,000
中越パルプ工業	400	1,289.00	515,600
大王製紙	6,900	1,207.50	8,331,750
阿波製紙	200	453.00	90,600
レンゴー	14,200	988.50	14,036,700
トーモク	900	2,285.00	2,056,500
ザ・パック	1,200	3,260.00	3,912,000
北の達人コーポレーション	6,500	194.00	1,261,000
クラレ	22,800	1,696.00	38,668,800
旭化成	97,600	910.40	88,855,040
共和レザー	600	647.00	388,200
巴川製紙所	300	658.00	197,400
レゾナック・ホールディングス	15,100	2,400.00	36,240,000
住友化学	115,900	393.60	45,618,240
住友精化	700	4,395.00	3,076,500
日産化学	7,300	6,000.00	43,800,000

ラサ工業	600	1,955.00	1,173,000
クレハ	1,200	8,710.00	10,452,000
多木化学	600	3,305.00	1,983,000
テイカ	1,000	1,665.00	1,665,000
石原産業	2,800	1,362.00	3,813,600
片倉コープアグリ	200	1,060.00	212,000
日本曹達	1,700	5,220.00	8,874,000
東ソー	20,900	1,806.00	37,745,400
トクヤマ	5,000	2,195.50	10,977,500
セントラル硝子	2,500	2,829.00	7,072,500
東亜合成	7,800	1,314.00	10,249,200
大阪ソーダ	900	7,960.00	7,164,000
関東電化工業	3,000	749.00	2,247,000
デンカ	5,700	2,664.50	15,187,650
信越化学工業	129,900	4,215.00	547,528,500
日本カーバイド工業	400	1,695.00	678,000
堺化学工業	1,200	1,999.00	2,398,800
第一稀元素化学工業	1,400	909.00	1,272,600
エア・ウォーター	14,700	1,830.50	26,908,350
日本酸素ホールディングス	15,200	3,620.00	55,024,000
日本化学工業	500	1,866.00	933,000
東邦アセチレン	200	1,606.00	321,200
日本パーカライジング	7,700	1,069.00	8,231,300
高压ガス工業	2,200	745.00	1,639,000
四国化成ホールディングス	2,000	1,636.00	3,272,000
戸田工業	400	1,690.00	676,000
ステラ ケミファ	900	3,085.00	2,776,500
保土谷化学工業	400	2,956.00	1,182,400
日本触媒	2,400	5,412.00	12,988,800
大日精化工業	1,100	2,114.00	2,325,400
カネカ	3,600	3,685.00	13,266,000
三菱瓦斯化学	11,700	1,958.50	22,914,450
三井化学	12,900	3,658.00	47,188,200
J S R	14,600	3,960.00	57,816,000
東京応化工業	2,500	8,278.00	20,695,000
大阪有機化学工業	1,300	2,466.00	3,205,800

三菱ケミカルグループ	105,400	837.80	88,304,120
KHネオケム	2,400	2,203.00	5,287,200
ダイセル	21,800	1,266.00	27,598,800
住友ベークライト	2,300	6,481.00	14,906,300
積水化学工業	31,700	1,991.00	63,114,700
日本ゼオン	9,400	1,475.00	13,865,000
アイカ工業	3,900	3,263.00	12,725,700
UBE	8,000	2,269.50	18,156,000
積水樹脂	2,200	2,399.00	5,277,800
タキロンシーアイ	3,400	571.00	1,941,400
旭有機材	1,000	3,500.00	3,500,000
ニチバン	1,000	1,790.00	1,790,000
リケンテクノス	3,300	693.00	2,286,900
大倉工業	700	2,626.00	1,838,200
積水化成成品工業	2,200	431.00	948,200
群栄化学工業	400	3,130.00	1,252,000
タイガースポリマー	400	623.00	249,200
ミライアル	300	1,354.00	406,200
ダイキアクシス	400	724.00	289,600
ダイキョーニシカワ	3,500	741.00	2,593,500
竹本容器	400	783.00	313,200
森六ホールディングス	800	2,291.00	1,832,800
恵和	1,100	1,272.00	1,399,200
日本化薬	11,900	1,260.00	14,994,000
カーリットホールディングス	1,400	927.00	1,297,800
日本精化	900	2,607.00	2,346,300
扶桑化学工業	1,500	3,875.00	5,812,500
トリケミカル研究所	2,100	3,040.00	6,384,000
ADEKA	5,400	2,454.00	13,251,600
日油	4,800	5,866.00	28,156,800
新日本理化	1,400	205.00	287,000
ハリマ化成グループ	800	793.00	634,400
花王	35,300	5,507.00	194,397,100
第一工業製薬	600	1,647.00	988,200
石原ケミカル	700	1,609.00	1,126,300
日華化学	400	888.00	355,200

ニイタカ	200	2,082.00	416,400
三洋化成工業	900	3,925.00	3,532,500
有機合成薬品工業	800	286.00	228,800
大日本塗料	1,900	926.00	1,759,400
日本ペイントホールディングス	82,900	979.90	81,233,710
関西ペイント	12,500	2,216.50	27,706,250
神東塗料	900	125.00	112,500
中国塗料	2,500	1,320.00	3,300,000
日本特殊塗料	700	1,193.00	835,100
藤倉化成	2,100	437.00	917,700
太陽ホールディングス	2,400	2,334.00	5,601,600
D I C	6,100	2,336.00	14,249,600
サカタインクス	3,500	1,213.00	4,245,500
東洋インキS Cホールディングス	3,400	2,443.00	8,306,200
T & K TOKA	1,400	1,425.00	1,995,000
富士フイルムホールディングス	30,000	8,244.00	247,320,000
資生堂	32,700	4,932.00	161,276,400
ライオン	20,500	1,444.00	29,602,000
高砂香料工業	1,100	3,055.00	3,360,500
マンダム	3,400	1,386.00	4,712,400
ミルボン	2,100	3,995.00	8,389,500
ファンケル	6,800	2,281.00	15,510,800
コーセー	3,200	10,270.00	32,864,000
コタ	1,400	1,611.00	2,255,400
ポーラ・オルビスホールディングス	8,000	1,682.00	13,456,000
ノエビアホールディングス	1,400	5,200.00	7,280,000
アジュバンホールディングス	300	928.00	278,400
新日本製薬	900	1,464.00	1,317,600
アクシージア	800	980.00	784,000
エステー	1,200	1,497.00	1,796,400
アグロ カネショウ	600	1,285.00	771,000
コニシ	2,600	2,132.00	5,543,200
長谷川香料	3,000	3,015.00	9,045,000
星光PMC	700	1,069.00	748,300
小林製薬	4,600	6,173.00	28,395,800
荒川化学工業	1,300	996.00	1,294,800

メック	1,300	3,350.00	4,355,000	
日本高純度化学	400	2,586.00	1,034,400	
タカラバイオ	4,200	1,301.00	5,464,200	
JCU	1,800	3,220.00	5,796,000	
新田ゼラチン	700	670.00	469,000	
OATアグリオ	400	1,817.00	726,800	
デクセリアルズ	4,300	3,469.00	14,916,700	
アース製薬	1,400	4,945.00	6,923,000	
北興化学工業	1,600	895.00	1,432,000	
大成ラミック	500	2,949.00	1,474,500	
クミアイ化学工業	6,200	1,088.00	6,745,600	
日本農薬	2,800	644.00	1,803,200	
アキレス	1,000	1,501.00	1,501,000	
有沢製作所	2,600	1,053.00	2,737,800	
日東電工	11,400	9,300.00	106,020,000	
レック	2,200	1,006.00	2,213,200	
三光合成	2,000	528.00	1,056,000	
きもと	1,400	182.00	254,800	
藤森工業	1,200	3,670.00	4,404,000	
前澤化成工業	1,000	1,462.00	1,462,000	
未来工業	600	3,535.00	2,121,000	
ウェーブロックホールディングス	300	612.00	183,600	
JSP	1,100	1,844.00	2,028,400	
エフピコ	3,000	2,632.00	7,896,000	
天馬	1,300	2,421.00	3,147,300	
信越ポリマー	2,900	1,259.00	3,651,100	
東リ	2,400	323.00	775,200	
ニフコ	5,600	3,670.00	20,552,000	
バルカー	1,300	3,835.00	4,985,500	
ユニ・チャーム	32,600	5,089.00	165,901,400	
ショーエイコーポレーション	300	582.00	174,600	
協和キリン	18,900	2,351.00	44,433,900	
武田薬品工業	138,500	4,347.00	602,059,500	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	147,800	1,924.00	284,367,200	
住友ファーマ	11,600	468.80	5,438,080	

塩野義製薬	19,700	6,837.00	134,688,900
わかもと製薬	1,000	205.00	205,000
日本新薬	3,700	5,424.00	20,068,800
中外製薬	49,000	4,325.00	211,925,000
科研製薬	2,700	3,318.00	8,958,600
エーザイ	19,000	8,140.00	154,660,000
ロート製薬	15,100	3,555.00	53,680,500
小野薬品工業	30,200	2,607.50	78,746,500
久光製薬	3,500	4,836.00	16,926,000
持田製薬	1,800	3,255.00	5,859,000
参天製薬	28,500	1,285.00	36,622,500
扶桑薬品工業	500	1,940.00	970,000
日本ケミファ	100	1,750.00	175,000
ツムラ	4,900	2,611.00	12,793,900
キッセイ薬品工業	2,300	3,120.00	7,176,000
生化学工業	3,000	785.00	2,355,000
栄研化学	2,500	1,419.00	3,547,500
鳥居薬品	800	3,650.00	2,920,000
JCRファーマ	5,300	1,075.50	5,700,150
東和薬品	2,400	2,702.00	6,484,800
富士製薬工業	1,100	1,136.00	1,249,600
ゼリア新薬工業	2,200	1,963.00	4,318,600
そーせいグループ	5,000	1,340.00	6,700,000
第一三共	136,300	4,025.00	548,607,500
杏林製薬	3,400	1,753.00	5,960,200
大幸薬品	3,200	331.00	1,059,200
ダイト	1,200	1,859.00	2,230,800
大塚ホールディングス	32,600	4,953.00	161,467,800
大正製薬ホールディングス	3,500	5,911.00	20,688,500
ペプチドリーム	7,500	1,277.50	9,581,250
あすか製薬ホールディングス	1,600	1,682.00	2,691,200
サワイグループホールディングス	3,600	4,559.00	16,412,400
日本コークス工業	14,100	108.00	1,522,800
ニチレキ	1,800	2,059.00	3,706,200
ユシロ化学工業	800	1,435.00	1,148,000
ビーピー・カストロール	400	898.00	359,200

富士石油	3,300	308.00	1,016,400
MORESCO	300	1,215.00	364,500
出光興産	17,300	3,336.00	57,712,800
ENEOSホールディングス	265,400	544.80	144,589,920
コスモエネルギーホールディングス	6,200	5,422.00	33,616,400
横浜ゴム	7,900	2,769.00	21,875,100
TOYO TIRE	9,000	2,229.50	20,065,500
ブリヂストン	45,800	5,678.00	260,052,400
住友ゴム工業	15,300	1,524.00	23,317,200
藤倉コンポジット	800	1,117.00	893,600
オカモト	800	5,110.00	4,088,000
フコク	800	1,444.00	1,155,200
ニッタ	1,600	3,350.00	5,360,000
住友理工	3,100	991.00	3,072,100
三ツ星ベルト	2,300	4,350.00	10,005,000
バンドー化学	2,300	1,471.00	3,383,300
日東紡績	1,800	3,655.00	6,579,000
AGC	14,600	5,029.00	73,423,400
日本板硝子	7,900	651.00	5,142,900
石塚硝子	200	3,085.00	617,000
日本山村硝子	400	1,555.00	622,000
日本電気硝子	6,400	2,762.50	17,680,000
オハラ	700	1,254.00	877,800
住友大阪セメント	2,200	3,411.00	7,504,200
太平洋セメント	9,900	2,471.50	24,467,850
日本ヒューム	1,400	862.00	1,206,800
日本コンクリート工業	3,000	297.00	891,000
三谷セキサン	700	4,330.00	3,031,000
アジアパイルホールディングス	2,400	675.00	1,620,000
東海カーボン	14,400	1,122.50	16,164,000
日本カーボン	800	4,355.00	3,484,000
東洋炭素	1,100	4,925.00	5,417,500
ノリタケカンパニーリミテド	800	5,730.00	4,584,000
TOTO	10,300	3,628.00	37,368,400
日本碍子	18,100	1,741.50	31,521,150
日本特殊陶業	11,900	3,179.00	37,830,100

ダントーホールディングス	700	764.00	534,800	
MARUWA	600	22,730.00	13,638,000	
品川リフラクトリーズ	2,100	1,404.00	2,948,400	
黒崎播磨	300	9,190.00	2,757,000	
ヨータイ	800	1,405.00	1,124,000	
東京窯業	900	324.00	291,600	
ニッカトー	400	577.00	230,800	
フジインコーポレーテッド	3,700	2,898.00	10,722,600	
クニミネ工業	300	991.00	297,300	
エーアンドエーマテリアル	200	1,068.00	213,600	
ニチアス	3,900	2,920.00	11,388,000	
ニチハ	2,000	2,882.00	5,764,000	
日本製鉄	72,100	3,181.00	229,350,100	
神戸製鋼所	32,400	1,740.50	56,392,200	
合同製鐵	800	4,125.00	3,300,000	
JFEホールディングス	44,800	2,053.50	91,996,800	
東京製鐵	4,600	1,649.00	7,585,400	
共英製鋼	1,900	1,770.00	3,363,000	
大和工業	2,700	6,828.00	18,435,600	
東京鐵鋼	800	3,220.00	2,576,000	
大阪製鐵	800	1,654.00	1,323,200	
淀川製鋼所	1,900	3,405.00	6,469,500	
中部鋼板	1,400	2,006.00	2,808,400	
丸一鋼管	4,900	3,640.00	17,836,000	
モリ工業	300	4,225.00	1,267,500	
大同特殊鋼	2,000	5,732.00	11,464,000	
日本高周波鋼業	600	615.00	369,000	
日本冶金工業	1,200	4,000.00	4,800,000	
山陽特殊製鋼	1,600	2,551.00	4,081,600	
愛知製鋼	900	3,590.00	3,231,000	
日本金属	300	853.00	255,900	
大平洋金属	1,200	1,172.00	1,406,400	
新日本電工	8,300	281.00	2,332,300	
栗本鐵工所	800	2,807.00	2,245,600	
虹技	200	1,398.00	279,600	
日本鑄鐵管	200	1,059.00	211,800	

三菱製鋼	1,100	1,374.00	1,511,400
日亜鋼業	1,400	299.00	418,600
日本精線	200	4,815.00	963,000
エンビプロ・ホールディングス	900	629.00	566,100
シンニッタン	1,500	239.00	358,500
新家工業	300	3,065.00	919,500
大紀アルミニウム工業所	2,300	1,179.00	2,711,700
日本軽金属ホールディングス	4,300	1,551.00	6,669,300
三井金属鉱業	4,700	3,766.00	17,700,200
東邦亜鉛	900	1,562.00	1,405,800
三菱マテリアル	10,700	2,341.50	25,054,050
住友金属鉱山	18,700	4,063.00	75,978,100
DOWAホールディングス	3,600	4,422.00	15,919,200
古河機械金属	2,400	1,939.00	4,653,600
エス・サイエンス	7,000	22.00	154,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,400	2,919.00	7,005,600
東邦チタニウム	2,900	1,734.00	5,028,600
UACJ	2,200	2,904.00	6,388,800
CKサンエツ	400	3,470.00	1,388,000
古河電気工業	5,300	2,253.00	11,940,900
住友電気工業	55,600	1,586.00	88,181,600
フジクラ	17,200	1,079.50	18,567,400
SWCC	1,800	2,018.00	3,632,400
タツタ電線	3,300	691.00	2,280,300
カナレ電気	200	1,417.00	283,400
平河ヒューテック	1,000	1,450.00	1,450,000
リョービ	1,700	2,737.00	4,652,900
アーレスティ	1,200	729.00	874,800
AREホールディングス	6,500	1,771.00	11,511,500
稲葉製作所	800	1,476.00	1,180,800
宮地エンジニアリンググループ	900	3,035.00	2,731,500
トーカロ	4,300	1,320.00	5,676,000
アルファC o	400	1,375.00	550,000
SUMCO	28,600	1,849.50	52,895,700
川田テクノロジーズ	400	6,430.00	2,572,000
RS Technologies	1,100	2,403.00	2,643,300

ジェイテックコーポレーション	100	2,036.00	203,600
信和	600	739.00	443,400
東洋製罐グループホールディングス	9,600	2,460.50	23,620,800
ホッカンホールディングス	900	1,546.00	1,391,400
コロナ	900	903.00	812,700
横河ブリッジホールディングス	2,000	2,430.00	4,860,000
駒井ハルテック	200	2,063.00	412,600
高田機工	100	3,145.00	314,500
三和ホールディングス	14,800	1,970.50	29,163,400
文化シャッター	4,600	1,129.00	5,193,400
三協立山	1,800	766.00	1,378,800
アルインコ	1,200	944.00	1,132,800
東洋シャッター	200	660.00	132,000
L I X I L	23,400	1,638.50	38,340,900
日本ファイルコン	700	475.00	332,500
ノーリツ	2,700	1,532.00	4,136,400
長府製作所	1,600	2,113.00	3,380,800
リンナイ	8,700	2,673.50	23,259,450
ダイニチ工業	500	709.00	354,500
日東精工	2,300	569.00	1,308,700
三洋工業	100	2,083.00	208,300
岡部	2,900	706.00	2,047,400
ジーテクト	1,800	1,714.00	3,085,200
東プレ	2,800	1,598.00	4,474,400
高周波熱錬	2,500	993.00	2,482,500
東京製綱	1,000	1,328.00	1,328,000
サンコール	900	491.00	441,900
モリテック スチール	800	277.00	221,600
パイオラックス	2,200	2,220.00	4,884,000
エイチワン	1,700	767.00	1,303,900
日本発條	14,200	1,066.00	15,137,200
中央発條	1,200	730.00	876,000
アドバネクス	100	954.00	95,400
立川ブラインド工業	800	1,374.00	1,099,200
三益半導体工業	1,200	2,412.00	2,894,400
日本ドライケミカル	200	2,119.00	423,800

日本製鋼所	4,300	2,458.00	10,569,400
三浦工業	6,600	2,845.00	18,777,000
タクマ	4,800	1,410.00	6,768,000
ツガミ	3,500	1,093.00	3,825,500
オークマ	1,600	6,253.00	10,004,800
芝浦機械	1,600	3,685.00	5,896,000
アマダ	25,100	1,429.00	35,867,900
アイダエンジニアリング	3,300	889.00	2,933,700
TAKISAWA	300	2,591.00	777,300
FUJI	6,800	2,230.00	15,164,000
牧野フライス製作所	1,700	6,050.00	10,285,000
オーエスジー	6,900	1,680.50	11,595,450
ダイジェット工業	100	898.00	89,800
旭ダイヤモンド工業	4,400	827.00	3,638,800
DMG森精機	9,500	2,434.00	23,123,000
ソディック	3,900	756.00	2,948,400
ディスコ	7,600	26,960.00	204,896,000
日東工器	800	1,872.00	1,497,600
日進工具	1,300	1,069.00	1,389,700
パンチ工業	900	409.00	368,100
富士ダイス	500	661.00	330,500
豊和工業	600	744.00	446,400
リケンNPR	1,600	1,689.00	2,702,400
東洋機械金属	700	660.00	462,000
島精機製作所	2,500	1,559.00	3,897,500
オプトラン	2,600	1,720.00	4,472,000
NCホールディングス	200	1,681.00	336,200
イワキポンプ	1,000	1,773.00	1,773,000
フリー	1,600	1,506.00	2,409,600
ヤマシンフィルタ	3,800	296.00	1,124,800
日阪製作所	1,500	931.00	1,396,500
やまびこ	2,500	1,382.00	3,455,000
野村マイクロ・サイエンス	500	7,250.00	3,625,000
平田機工	800	6,680.00	5,344,000
PEGASUS	1,800	612.00	1,101,600
マルマエ	700	1,385.00	969,500

タツモ	1,000	2,872.00	2,872,000
ナブテスコ	9,900	2,654.50	26,279,550
三井海洋開発	2,000	1,640.00	3,280,000
レオン自動機	1,700	1,275.00	2,167,500
SMC	5,100	68,400.00	348,840,000
ホソカワミクロン	1,000	4,070.00	4,070,000
ユニオンツール	700	3,575.00	2,502,500
瑞光	1,100	1,193.00	1,312,300
オイレス工業	2,200	1,877.00	4,129,400
日精エー・エス・ビー機械	600	4,520.00	2,712,000
サトーホールディングス	2,200	1,998.00	4,395,600
技研製作所	1,500	1,824.00	2,736,000
日本エアータック	800	1,325.00	1,060,000
カワタ	300	1,000.00	300,000
日精樹脂工業	1,200	1,018.00	1,221,600
オカダアイヨン	300	1,939.00	581,700
ワイエイシイホールディングス	400	2,308.00	923,200
小松製作所	73,800	3,678.00	271,436,400
住友重機械工業	9,300	3,486.00	32,419,800
日立建機	6,300	4,110.00	25,893,000
日工	2,300	654.00	1,504,200
巴工業	600	2,784.00	1,670,400
井関農機	1,500	1,082.00	1,623,000
TOWA	1,600	4,940.00	7,904,000
丸山製作所	200	2,069.00	413,800
北川鉄工所	600	1,393.00	835,800
ローツェ	800	11,390.00	9,112,000
タカキタ	300	437.00	131,100
クボタ	82,700	2,005.50	165,854,850
荏原実業	800	2,616.00	2,092,800
三菱化工機	500	2,635.00	1,317,500
月島ホールディングス	2,100	1,246.00	2,616,600
帝国電機製作所	1,100	2,348.00	2,582,800
新東工業	3,100	1,017.00	3,152,700
澁谷工業	1,500	2,346.00	3,519,000
アイチ コーポレーション	2,200	906.00	1,993,200

小森コーポレーション	3,600	1,012.00	3,643,200
鶴見製作所	1,200	3,125.00	3,750,000
酒井重工業	200	5,200.00	1,040,000
荏原製作所	6,500	6,448.00	41,912,000
石井鐵工所	100	2,907.00	290,700
西島製作所	1,400	1,809.00	2,532,600
北越工業	1,600	1,859.00	2,974,400
ダイキン工業	18,800	21,185.00	398,278,000
オルガノ	2,200	4,585.00	10,087,000
トーヨーカネツ	600	3,235.00	1,941,000
栗田工業	8,800	4,468.00	39,318,400
椿本チエイン	2,200	3,775.00	8,305,000
大同工業	400	737.00	294,800
木村化工機	1,200	691.00	829,200
アネスト岩田	2,700	1,106.00	2,986,200
ダイフク	24,400	2,480.00	60,512,000
サムコ	400	4,215.00	1,686,000
加藤製作所	500	1,178.00	589,000
油研工業	200	2,245.00	449,000
タダノ	9,000	1,116.50	10,048,500
フジテック	5,500	3,216.00	17,688,000
CKD	4,400	1,910.00	8,404,000
平和	5,200	2,095.00	10,894,000
理想科学工業	1,300	2,293.00	2,980,900
SANKYO	3,100	6,170.00	19,127,000
日本金銭機械	1,700	958.00	1,628,600
マースグループホールディングス	900	2,539.00	2,285,100
フクシマガリレイ	1,200	4,790.00	5,748,000
オーイズミ	400	367.00	146,800
ダイコク電機	900	4,275.00	3,847,500
竹内製作所	2,900	4,445.00	12,890,500
アマノ	4,500	3,109.00	13,990,500
JUKI	2,400	601.00	1,442,400
サンデン	1,600	178.00	284,800
ジャノメ	1,600	691.00	1,105,600
マックス	1,900	2,433.00	4,622,700

グローリー	3,800	2,758.50	10,482,300
新晃工業	1,600	2,125.00	3,400,000
大和冷機工業	2,400	1,255.00	3,012,000
セガサミーホールディングス	12,700	2,367.50	30,067,250
T P R	1,800	1,718.00	3,092,400
ツバキ・ナカシマ	3,200	715.00	2,288,000
ホシザキ	9,300	4,804.00	44,677,200
大豊工業	1,400	810.00	1,134,000
日本精工	26,200	803.80	21,059,560
N T N	31,000	262.00	8,122,000
ジェイテクト	14,000	1,263.00	17,682,000
不二越	1,200	3,660.00	4,392,000
日本トムソン	3,800	534.00	2,029,200
THK	9,100	2,671.00	24,306,100
ユーシン精機	1,300	651.00	846,300
前澤給装工業	1,100	1,274.00	1,401,400
イーグル工業	1,800	1,626.00	2,926,800
前澤工業	600	891.00	534,600
日本ピラー工業	1,500	3,655.00	5,482,500
キット	5,300	992.00	5,257,600
マキタ	19,600	3,558.00	69,736,800
三井E & S	7,700	413.00	3,180,100
日立造船	12,900	769.00	9,920,100
三菱重工業	27,600	7,747.00	213,817,200
I H I	9,900	2,816.50	27,883,350
サノヤスホールディングス	1,400	130.00	182,000
スター精密	3,000	1,794.00	5,382,000
日清紡ホールディングス	11,800	1,078.00	12,720,400
イビデン	9,000	7,203.00	64,827,000
コニカミノルタ	35,100	437.00	15,338,700
ブラザー工業	21,000	2,358.00	49,518,000
ミネベアミツミ	27,400	2,279.00	62,444,600
日立製作所	76,600	8,705.00	666,803,000
東芝	30,300	4,601.00	139,410,300
三菱電機	162,900	1,728.00	281,491,200
富士電機	9,600	6,007.00	57,667,200

東洋電機製造	300	929.00	278,700
安川電機	18,700	4,951.00	92,583,700
シンフォニアテクノロジー	1,800	1,522.00	2,739,600
明電舎	2,400	1,990.00	4,776,000
オリジン	200	1,245.00	249,000
山洋電気	700	6,120.00	4,284,000
デンヨー	1,200	2,077.00	2,492,400
PHCホールディングス	2,200	1,409.00	3,099,800
ソシオネクスト	2,300	14,700.00	33,810,000
東芝テック	2,300	3,200.00	7,360,000
芝浦メカトロニクス	900	6,480.00	5,832,000
マブチモーター	3,900	4,288.00	16,723,200
ニデック	38,300	5,632.00	215,705,600
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,200	425.00	510,000
トレックス・セミコンダクター	700	1,910.00	1,337,000
東光高岳	900	1,875.00	1,687,500
ダブル・スコープ	4,500	874.00	3,933,000
ダイヘン	1,400	4,625.00	6,475,000
ヤーマン	2,800	1,043.00	2,920,400
JVCケンウッド	14,300	633.00	9,051,900
ミマキエンジニアリング	1,600	723.00	1,156,800
I-PEX	1,100	1,452.00	1,597,200
大崎電気工業	3,700	617.00	2,282,900
オムロン	14,400	6,153.00	88,603,200
日東工業	2,100	3,380.00	7,098,000
IDEC	2,300	2,664.00	6,127,200
正興電機製作所	400	1,041.00	416,400
不二電機工業	200	1,102.00	220,400
ジーエス・ユアサコーポレーション	5,200	2,374.50	12,347,400
サクサホールディングス	200	2,178.00	435,600
メルコホールディングス	400	3,335.00	1,334,000
テクノメディカ	400	2,210.00	884,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	600	804.00	482,400
日本電気	22,300	7,271.00	162,143,300
富士通	15,700	16,760.00	263,132,000
沖電気工業	7,100	901.00	6,397,100

岩崎通信機	500	776.00	388,000	
電気興業	600	2,422.00	1,453,200	
サンケン電気	1,500	7,250.00	10,875,000	
ナカヨ	200	1,209.00	241,800	
アイホン	1,000	2,914.00	2,914,000	
ルネサスエレクトロニクス	102,900	2,106.00	216,707,400	
セイコーエプソン	20,200	2,192.00	44,278,400	
ワコム	12,000	535.00	6,420,000	
アルバック	3,700	5,257.00	19,450,900	
アクセル	400	1,820.00	728,000	
E I Z O	1,200	4,755.00	5,706,000	
日本信号	3,500	908.00	3,178,000	
京三製作所	3,300	477.00	1,574,100	
能美防災	2,100	1,730.00	3,633,000	
ホーチキ	1,200	1,600.00	1,920,000	
星和電機	500	487.00	243,500	
エレコム	3,800	1,695.00	6,441,000	
パナソニック ホールディングス	186,100	1,461.50	271,985,150	
シャープ	18,900	929.60	17,569,440	
アンリツ	11,100	980.10	10,879,110	
富士通ゼネラル	4,500	2,627.00	11,821,500	
ソニーグループ	110,300	12,245.00	1,350,623,500	代用有価証券 35,000株
TDK	25,000	5,445.00	136,125,000	
帝国通信工業	700	1,803.00	1,262,100	
タムラ製作所	6,700	485.00	3,249,500	
アルプスアルパイン	14,000	1,190.00	16,660,000	
池上通信機	300	864.00	259,200	
日本電波工業	1,900	1,168.00	2,219,200	
鈴木	900	1,086.00	977,400	
メイコー	1,700	3,010.00	5,117,000	
日本トリム	400	2,859.00	1,143,600	
ローランド ディー. ジー.	900	3,250.00	2,925,000	
フォスター電機	1,500	885.00	1,327,500	
SMK	400	2,415.00	966,000	
ヨコオ	1,300	1,255.00	1,631,500	

ホシデン	3,600	1,749.00	6,296,400
ヒロセ電機	2,500	16,905.00	42,262,500
日本航空電子工業	3,200	2,733.00	8,745,600
TOA	1,800	1,034.00	1,861,200
マクセル	3,200	1,549.00	4,956,800
古野電気	2,100	1,701.00	3,572,100
スミダコーポレーション	2,200	1,269.00	2,791,800
アイコム	600	3,435.00	2,061,000
リオン	700	2,306.00	1,614,200
横河電機	17,200	2,670.50	45,932,600
新電元工業	600	2,889.00	1,733,400
アズビル	10,900	4,360.00	47,524,000
東亜ディーケーケー	500	859.00	429,500
日本光電工業	7,200	3,461.00	24,919,200
チノー	700	2,037.00	1,425,900
共和電業	1,000	374.00	374,000
日本電子材料	1,000	1,360.00	1,360,000
堀場製作所	3,000	7,454.00	22,362,000
アドバンテスト	49,200	3,984.00	196,012,800
小野測器	400	445.00	178,000
エスベック	1,300	2,139.00	2,780,700
キーエンス	15,600	52,360.00	816,816,000
日置電機	700	6,350.00	4,445,000
シスメックス	13,500	6,720.00	90,720,000
日本マイクロニクス	2,800	2,285.00	6,398,000
メガチップス	1,300	3,865.00	5,024,500
OBARA GROUP	800	3,530.00	2,824,000
澤藤電機	100	1,252.00	125,200
原田工業	500	809.00	404,500
コーセル	1,900	1,123.00	2,133,700
イリソ電子工業	1,400	3,575.00	5,005,000
オブテックスグループ	2,900	1,637.00	4,747,300
千代田インテグレ	600	2,751.00	1,650,600
レーザーテック	7,200	24,635.00	177,372,000
スタンレー電気	11,000	2,391.50	26,306,500
ウシオ電機	7,900	1,836.50	14,508,350

岡谷電機産業	800	281.00	224,800	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,100	368.00	404,800	
エノモト	300	1,629.00	488,700	
日本セラミック	1,300	2,598.00	3,377,400	
遠藤照明	500	1,156.00	578,000	
古河電池	1,200	885.00	1,062,000	
双信電機	500	334.00	167,000	
山一電機	1,300	1,725.00	2,242,500	
図研	1,400	3,550.00	4,970,000	
日本電子	3,900	4,277.00	16,680,300	
カシオ計算機	11,600	1,174.00	13,618,400	
ファナック	76,100	3,645.00	277,384,500	
日本シイエムケイ	3,300	647.00	2,135,100	
エンプラス	500	9,500.00	4,750,000	
大真空	1,900	712.00	1,352,800	
ローム	28,800	2,494.00	71,827,200	
浜松ホトニクス	12,500	5,592.00	69,900,000	
三井ハイテック	1,600	6,400.00	10,240,000	
新光電気工業	5,500	5,438.00	29,909,000	
京セラ	24,200	7,244.00	175,304,800	
太陽誘電	7,600	3,396.00	25,809,600	
村田製作所	142,000	2,490.00	353,580,000	
双葉電子工業	3,000	504.00	1,512,000	
北陸電気工業	400	1,315.00	526,000	
ニチコン	3,200	1,225.00	3,920,000	
日本ケミコン	1,500	1,262.00	1,893,000	
KOA	2,400	1,423.00	3,415,200	
市光工業	2,800	517.00	1,447,600	
小糸製作所	18,700	2,198.00	41,102,600	
ミツバ	2,900	684.00	1,983,600	
SCREENホールディングス	5,300	7,068.00	37,460,400	
キヤノン電子	1,700	1,866.00	3,172,200	
キヤノン	77,800	3,636.00	282,880,800	代用有価証券 10,000株
リコー	39,100	1,214.50	47,486,950	
象印マホービン	4,300	1,504.00	6,467,200	

MUTOHホールディングス	100	1,958.00	195,800
東京エレクトロン	33,000	19,340.00	638,220,000
イノテック	1,000	1,542.00	1,542,000
トヨタ紡織	6,600	2,509.00	16,559,400
芦森工業	200	2,014.00	402,800
ユニプレス	2,800	1,060.00	2,968,000
豊田自動織機	11,400	10,790.00	123,006,000
モリタホールディングス	2,700	1,516.00	4,093,200
三櫻工業	2,400	861.00	2,066,400
デンソー	128,700	2,272.50	292,470,750
東海理化電機製作所	4,400	2,212.00	9,732,800
川崎重工業	11,800	3,318.00	39,152,400
名村造船所	2,700	759.00	2,049,300
日本車輛製造	600	1,983.00	1,189,800
三菱ロジスネクスト	2,500	1,115.00	2,787,500
近畿車輛	200	1,807.00	361,400
日産自動車	221,800	584.30	129,597,740
いすゞ自動車	45,400	1,711.00	77,679,400
トヨタ自動車	856,500	2,594.50	2,222,189,250
日野自動車	20,100	530.20	10,657,020
三菱自動車工業	60,900	504.00	30,693,600
エフテック	800	690.00	552,000
レシップホールディングス	500	509.00	254,500
GMB	200	1,585.00	317,000
ファルテック	200	554.00	110,800
武蔵精密工業	3,800	1,444.00	5,487,200
日産車体	2,800	828.00	2,318,400
新明和工業	4,900	1,184.00	5,801,600
極東開発工業	2,600	1,744.00	4,534,400
トピー工業	1,300	2,301.00	2,991,300
ティラド	400	2,079.00	831,600
タチエス	2,500	1,609.00	4,022,500
NOK	6,100	1,827.00	11,144,700
フタバ産業	4,200	684.00	2,872,800
カヤバ	1,500	4,435.00	6,652,500
大同メタル工業	3,100	519.00	1,608,900

プレス工業	7,000	640.00	4,480,000
ミクニ	1,300	428.00	556,400
太平洋工業	3,600	1,352.00	4,867,200
アイシン	12,000	5,347.00	64,164,000
マツダ	51,600	1,503.50	77,580,600
今仙電機製作所	700	589.00	412,300
本田技研工業	380,400	1,594.00	606,357,600
スズキ	28,700	5,779.00	165,857,300
S U B A R U	49,400	2,635.50	130,193,700
安永	500	721.00	360,500
ヤマハ発動機	22,500	3,712.00	83,520,000
T B K	1,100	378.00	415,800
エクセディ	2,600	2,450.00	6,370,000
豊田合成	4,500	2,943.50	13,245,750
愛三工業	2,600	1,124.00	2,922,400
盟和産業	200	993.00	198,600
日本プラスト	900	434.00	390,600
ヨロズ	1,500	875.00	1,312,500
エフ・シー・シー	2,800	1,780.00	4,984,000
シマノ	6,300	21,145.00	133,213,500
テイ・エス テック	7,100	1,674.50	11,888,950
ジャムコ	600	1,448.00	868,800
テルモ	48,000	3,945.00	189,360,000
クリエートメディック	300	905.00	271,500
日機装	3,600	930.00	3,348,000
日本エム・ディ・エム	900	705.00	634,500
島津製作所	19,000	3,530.00	67,070,000
J M S	1,500	519.00	778,500
長野計器	1,100	2,256.00	2,481,600
ブイ・テクノロジー	700	1,846.00	1,292,200
東京計器	1,200	1,417.00	1,700,400
愛知時計電機	600	1,944.00	1,166,400
インターアクション	800	972.00	777,600
オーバル	900	440.00	396,000
東京精密	3,400	7,040.00	23,936,000
マニー	6,200	2,018.00	12,511,600

ニコン	22,500	1,428.00	32,130,000
トプコン	8,200	1,678.00	13,759,600
オリンパス	96,100	1,931.50	185,617,150
理研計器	1,000	5,920.00	5,920,000
タムロン	1,000	4,120.00	4,120,000
HOYA	33,100	14,410.00	476,971,000
シード	500	750.00	375,000
ノーリツ鋼機	1,500	3,110.00	4,665,000
A&Dホロンホールディングス	2,300	1,485.00	3,415,500
朝日インテック	17,400	2,398.00	41,725,200
シチズン時計	14,300	871.00	12,455,300
リズム	300	2,290.00	687,000
大研医器	800	529.00	423,200
メニコン	5,300	1,713.50	9,081,550
シンシア	100	526.00	52,600
松風	700	2,328.00	1,629,600
セイコーグループ	2,400	2,340.00	5,616,000
ニプロ	12,900	1,118.50	14,428,650
KYORITSU	1,500	169.00	253,500
中本パックス	300	1,608.00	482,400
スノーピーク	2,200	989.00	2,175,800
パラマウントベッドホールディングス	3,600	2,314.00	8,330,400
トランザクション	1,000	1,921.00	1,921,000
粧美堂	200	468.00	93,600
ニホンフラッシュ	1,500	854.00	1,281,000
前田工織	1,300	2,835.00	3,685,500
永大産業	1,100	215.00	236,500
アートネイチャー	1,600	812.00	1,299,200
バンダイナムコホールディングス	42,800	3,059.00	130,925,200
アイフィスジャパン	300	601.00	180,300
SHOEI	3,500	2,029.00	7,101,500
フランスベッドホールディングス	1,800	1,179.00	2,122,200
パイロットコーポレーション	2,200	5,008.00	11,017,600
萩原工業	1,000	1,689.00	1,689,000
フジシールインターナショナル	3,200	1,646.00	5,267,200
タカラトミー	7,100	2,009.00	14,263,900

広済堂ホールディングス	700	2,800.00	1,960,000
エステールホールディングス	200	624.00	124,800
タカノ	400	802.00	320,800
プロネクサス	1,300	1,143.00	1,485,900
ホクシン	700	118.00	82,600
ウッドワン	300	1,064.00	319,200
大建工業	900	2,991.00	2,691,900
TOPPANホールディングス	19,200	3,341.00	64,147,200
大日本印刷	17,000	3,847.00	65,399,000
共同印刷	400	3,115.00	1,246,000
NISSHA	2,700	1,540.00	4,158,000
光村印刷	100	1,278.00	127,800
TAKARA & COMPANY	1,000	2,292.00	2,292,000
アシックス	13,300	4,659.00	61,964,700
ツツミ	300	2,320.00	696,000
ローランド	1,100	4,250.00	4,675,000
小松ウオール工業	600	2,887.00	1,732,200
ヤマハ	9,800	3,900.00	38,220,000
河合楽器製作所	400	3,915.00	1,566,000
クリナップ	1,700	686.00	1,166,200
ピジョン	9,900	1,617.50	16,013,250
キングジム	1,400	887.00	1,241,800
リンテック	3,100	2,467.00	7,647,700
イトーキ	3,200	1,368.00	4,377,600
任天堂	98,500	6,116.00	602,426,000
三菱鉛筆	2,200	1,823.00	4,010,600
タカラスタンダード	2,900	1,768.00	5,127,200
コクヨ	6,700	2,294.00	15,369,800
ナカバヤシ	1,700	513.00	872,100
グローブライド	1,300	1,905.00	2,476,500
オカムラ	4,700	2,067.00	9,714,900
美津濃	1,500	4,355.00	6,532,500
東京電力ホールディングス	140,600	638.50	89,773,100
中部電力	57,500	1,805.00	103,787,500
関西電力	60,300	1,979.50	119,363,850
中国電力	24,800	951.40	23,594,720

北陸電力	14,700	768.00	11,289,600
東北電力	38,100	957.70	36,488,370
四国電力	13,300	1,032.00	13,725,600
九州電力	36,000	953.10	34,311,600
北海道電力	15,100	647.60	9,778,760
沖縄電力	3,700	1,093.00	4,044,100
電源開発	11,700	2,270.50	26,564,850
エフオン	1,000	473.00	473,000
イーレックス	2,800	725.00	2,030,000
レノバ	4,200	1,046.00	4,393,200
東京瓦斯	33,000	3,383.00	111,639,000
大阪瓦斯	31,600	2,501.00	79,031,600
東邦瓦斯	6,100	2,550.50	15,558,050
北海道瓦斯	900	2,286.00	2,057,400
広島ガス	3,300	386.00	1,273,800
西部ガスホールディングス	1,500	1,942.00	2,913,000
静岡ガス	3,100	1,004.00	3,112,400
メタウォーター	1,800	1,790.00	3,222,000
SBSホールディングス	1,400	2,652.00	3,712,800
東武鉄道	17,100	3,558.00	60,841,800
相鉄ホールディングス	5,100	2,646.50	13,497,150
東急	43,700	1,654.00	72,279,800
京浜急行電鉄	17,700	1,251.00	22,142,700
小田急電鉄	23,600	2,089.00	49,300,400
京王電鉄	8,200	4,422.00	36,260,400
京成電鉄	10,100	5,382.00	54,358,200
富士急行	1,900	4,250.00	8,075,000
東日本旅客鉄道	26,500	7,715.00	204,447,500
西日本旅客鉄道	19,900	5,655.00	112,534,500
東海旅客鉄道	60,100	3,337.00	200,553,700
西武ホールディングス	18,900	1,447.00	27,348,300
鴻池運輸	2,700	1,899.00	5,127,300
西日本鉄道	4,100	2,387.50	9,788,750
ハマキョウレックス	1,200	3,705.00	4,446,000
サカイ引越センター	1,500	2,509.00	3,763,500
近鉄グループホールディングス	15,600	4,156.00	64,833,600

阪急阪神ホールディングス	20,800	4,596.00	95,596,800
南海電気鉄道	7,400	2,834.00	20,971,600
京阪ホールディングス	8,600	3,564.00	30,650,400
神戸電鉄	400	2,681.00	1,072,400
名古屋鉄道	17,200	2,073.50	35,664,200
山陽電気鉄道	1,200	2,056.00	2,467,200
アルプス物流	1,200	1,658.00	1,989,600
ヤマトホールディングス	19,900	2,394.50	47,650,550
山九	4,000	5,033.00	20,132,000
丸運	500	242.00	121,000
丸全昭和運輸	1,000	3,665.00	3,665,000
センコーグループホールディングス	8,200	1,028.00	8,429,600
トナミホールディングス	300	4,265.00	1,279,500
ニッコンホールディングス	5,000	3,195.00	15,975,000
日本石油輸送	100	2,819.00	281,900
福山通運	1,200	3,955.00	4,746,000
セイノーホールディングス	8,700	2,108.00	18,339,600
エスライングループ本社	300	877.00	263,100
神奈川中央交通	400	3,025.00	1,210,000
AZ-COM丸和ホールディングス	3,800	2,040.00	7,752,000
C&Fロジホールディングス	1,500	1,349.00	2,023,500
九州旅客鉄道	11,000	3,020.00	33,220,000
SGホールディングス	29,900	2,001.00	59,829,900
NIPPON EXPRESSホールディングス	5,300	7,533.00	39,924,900
日本郵船	41,700	3,763.00	156,917,100
商船三井	27,500	3,969.00	109,147,500
川崎汽船	11,700	5,057.00	59,166,900
NSユニテッド海運	900	4,175.00	3,757,500
飯野海運	5,800	1,027.00	5,956,600
乾汽船	2,100	1,174.00	2,465,400
日本航空	38,300	2,698.50	103,352,550
ANAホールディングス	42,400	2,894.00	122,705,600
パスコ	200	1,586.00	317,200
トランコム	400	7,180.00	2,872,000
日新	1,200	2,514.00	3,016,800

三菱倉庫	3,300	3,849.00	12,701,700
三井倉庫ホールディングス	1,500	4,165.00	6,247,500
住友倉庫	4,200	2,363.00	9,924,600
澁澤倉庫	600	2,889.00	1,733,400
東陽倉庫	200	1,380.00	276,000
日本トランスシティ	3,100	641.00	1,987,100
ケイヒン	200	1,829.00	365,800
中央倉庫	800	1,072.00	857,600
川西倉庫	200	1,029.00	205,800
安田倉庫	1,100	1,074.00	1,181,400
ファイズホールディングス	200	999.00	199,800
東洋埠頭	300	1,368.00	410,400
上組	7,500	3,009.00	22,567,500
サンリツ	300	719.00	215,700
キムラユニティー	500	1,214.00	607,000
キューソー流通システム	500	948.00	474,000
東海運	700	280.00	196,000
エーアイテイー	1,000	1,600.00	1,600,000
内外トランスライン	600	2,323.00	1,393,800
日本コンセプト	600	1,693.00	1,015,800
NEC ネットエスアイ	5,200	1,937.00	10,072,400
クロスキャット	900	986.00	887,400
システナ	26,400	246.00	6,494,400
デジタルアーツ	1,000	4,100.00	4,100,000
日鉄ソリューションズ	2,700	4,110.00	11,097,000
キューブシステム	1,000	1,043.00	1,043,000
コア	700	1,617.00	1,131,900
手間いらず	300	1,967.00	590,100
ラクーンホールディングス	1,400	697.00	975,800
ソリトンシステムズ	800	1,058.00	846,400
ソフトクリエイトホールディングス	1,300	1,666.00	2,165,800
T I S	17,100	3,085.00	52,753,500
テクミラホールディングス	500	412.00	206,000
グリー	4,300	566.00	2,433,800
GMOペパボ	200	1,184.00	236,800
コーエーテクモホールディングス	9,800	1,938.00	18,992,400

三菱総合研究所	800	4,720.00	3,776,000
ボルテージ	400	266.00	106,400
電算	100	1,578.00	157,800
AGS	500	671.00	335,500
ファインデックス	1,300	779.00	1,012,700
KL a b	3,000	268.00	804,000
ポールトゥウィンホールディングス	2,800	454.00	1,271,200
ネクソン	34,900	2,468.00	86,133,200
アイスタイル	4,700	416.00	1,955,200
エムアップホールディングス	1,900	1,172.00	2,226,800
エイチーム	1,000	588.00	588,000
エニグモ	2,100	309.00	648,900
テクノスジャパン	900	697.00	627,300
e n i s h	900	165.00	148,500
コロプラ	6,100	577.00	3,519,700
ブロードリーフ	7,400	520.00	3,848,000
クロス・マーケティンググループ	700	655.00	458,500
デジタルハーツホールディングス	1,000	882.00	882,000
システム情報	1,300	929.00	1,207,700
メディアドゥ	700	1,261.00	882,700
じげん	4,600	474.00	2,180,400
ブイキューブ	2,000	343.00	686,000
エンカレッジ・テクノロジー	300	485.00	145,500
サイバーリンクス	400	725.00	290,000
フィックスターズ	1,800	977.00	1,758,600
CARTA HOLDINGS	800	1,165.00	932,000
オブティム	1,300	798.00	1,037,400
セレス	700	909.00	636,300
SHIFT	1,000	25,050.00	25,050,000
ティーガイア	1,700	1,747.00	2,969,900
セック	200	3,440.00	688,000
テクマトリックス	2,900	1,435.00	4,161,500
プロシップ	700	1,299.00	909,300
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,100	2,279.00	9,343,900
GMOペイメントゲートウェイ	3,100	6,155.00	19,080,500
ザッパラス	300	424.00	127,200

システムリサーチ	500	3,030.00	1,515,000
インターネットイニシアティブ	8,500	2,364.50	20,098,250
さくらインターネット	1,800	1,009.00	1,816,200
ヴィンクス	300	1,177.00	353,100
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	2,469.00	1,234,500
SRAホールディングス	800	3,250.00	2,600,000
システムインテグレータ	400	402.00	160,800
朝日ネット	1,700	599.00	1,018,300
eBASE	2,200	625.00	1,375,000
アバントグループ	2,000	1,190.00	2,380,000
アドソル日進	700	1,525.00	1,067,500
ODKソリューションズ	300	558.00	167,400
フリービット	900	1,001.00	900,900
コムチュア	2,100	2,055.00	4,315,500
サイバーコム	200	1,219.00	243,800
アステリア	1,300	663.00	861,900
アイル	800	3,595.00	2,876,000
マークライنز	900	2,720.00	2,448,000
メディカル・データ・ビジョン	1,900	652.00	1,238,800
gumi	2,400	422.00	1,012,800
ショーケース	300	302.00	90,600
モバイルファクトリー	300	704.00	211,200
テラスカイ	700	1,462.00	1,023,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	900	1,551.00	1,395,900
PCIホールディングス	400	1,011.00	404,400
アイビーシー	200	508.00	101,600
ネオジャパン	600	947.00	568,200
PR TIMES	400	1,552.00	620,800
ラクス	7,400	1,789.50	13,242,300
ランドコンピュータ	300	1,338.00	401,400
ダブルスタンダード	600	1,411.00	846,600
オーブンドア	1,100	726.00	798,600
マイネット	400	310.00	124,000
アカツキ	800	2,035.00	1,628,000
ベネフィットジャパン	100	1,148.00	114,800
Ubicomホールディングス	500	1,069.00	534,500

カナミックネットワーク	1,800	453.00	815,400
ノムラシステムコーポレーション	1,400	105.00	147,000
チェンジホールディングス	3,800	1,443.00	5,483,400
シンクロ・フード	700	519.00	363,300
オークネット	600	1,676.00	1,005,600
キャピタル・アセット・プランニング	200	748.00	149,600
エイトレッド	200	1,266.00	253,200
マクロミル	3,100	655.00	2,030,500
ビーグリー	200	1,066.00	213,200
オロ	600	2,017.00	1,210,200
ユーザーローカル	600	1,522.00	913,200
デモナ	300	248.00	74,400
マネーフォワード	3,500	3,425.00	11,987,500
サインポスト	500	458.00	229,000
Sun Asterisk	1,100	1,139.00	1,252,900
プラスアルファ・コンサルティング	600	2,353.00	1,411,800
電算システムホールディングス	700	2,636.00	1,845,200
Appier Group	5,300	1,250.00	6,625,000
ソルクシーズ	900	406.00	365,400
フェイス	300	485.00	145,500
プロトコーポレーション	2,000	1,122.00	2,244,000
ハイマックス	500	1,346.00	673,000
野村総合研究所	31,200	3,669.00	114,472,800
サイバネットシステム	1,200	764.00	916,800
CEホールディングス	600	530.00	318,000
日本システム技術	500	2,116.00	1,058,000
インテージホールディングス	1,800	1,651.00	2,971,800
東邦システムサイエンス	500	1,216.00	608,000
ソースネクスト	8,000	176.00	1,408,000
インフォコム	2,000	2,515.00	5,030,000
シンプレクス・ホールディングス	2,700	2,580.00	6,966,000
HEROZ	600	1,370.00	822,000
ラクスル	3,800	1,178.00	4,476,400
メルカリ	9,500	2,958.50	28,105,750
I P S	500	2,331.00	1,165,500
F I G	1,300	322.00	418,600

システムサポート	600	1,851.00	1,110,600
イーソル	1,200	661.00	793,200
東海ソフト	200	1,088.00	217,600
ウイングアーク1st	1,600	2,692.00	4,307,200
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	500	1,196.00	598,000
サーバーワークス	300	3,035.00	910,500
東名	100	1,532.00	153,200
ヴィッツ	100	947.00	94,700
トピラシステムズ	300	878.00	263,400
Sansan	5,100	1,135.50	5,791,050
Link-U	300	711.00	213,300
ギフトィ	1,400	1,276.00	1,786,400
メドレー	2,100	4,215.00	8,851,500
ベース	500	4,100.00	2,050,000
JMDC	2,600	4,262.00	11,081,200
フォーカスシステムズ	1,200	950.00	1,140,000
クレスコ	1,200	1,587.00	1,904,400
フジ・メディア・ホールディングス	15,000	1,490.00	22,350,000
オービック	5,200	21,020.00	109,304,000
ジャストシステム	2,300	2,652.00	6,099,600
TDCソフト	1,300	1,500.00	1,950,000
LINEヤフー	222,600	376.70	83,853,420
トレンドマイクロ	7,400	5,519.00	40,840,600
IDホールディングス	1,100	1,446.00	1,590,600
日本オラクル	3,000	10,220.00	30,660,000
アルファシステムズ	500	2,684.00	1,342,000
フューチャー	3,400	1,616.00	5,494,400
CAC Holdings	800	1,728.00	1,382,400
SBテクノロジー	700	2,094.00	1,465,800
トーセ	300	701.00	210,300
オービックビジネスコンサルタント	3,100	6,110.00	18,941,000
伊藤忠テクノソリューションズ	4,200	4,323.00	18,156,600
アイティフォー	2,100	1,040.00	2,184,000
東計電算	200	6,040.00	1,208,000
エクスネット	200	1,031.00	206,200

大塚商会	7,800	5,816.00	45,364,800
サイボウズ	2,200	1,742.00	3,832,400
電通国際情報サービス	1,900	4,965.00	9,433,500
ACCESS	1,900	730.00	1,387,000
デジタルガレージ	2,800	2,961.00	8,290,800
EMシステムズ	2,600	703.00	1,827,800
ウェザーニューズ	500	5,690.00	2,845,000
C I J	2,600	517.00	1,344,200
ビジネスエンジニアリング	200	3,275.00	655,000
日本エンタープライズ	1,300	117.00	152,100
WOWOW	1,200	1,085.00	1,302,000
スカラ	1,500	746.00	1,119,000
インテリジェント ウェイブ	600	886.00	531,600
ANYCOLOR	500	3,210.00	1,605,000
IMAGICA GROUP	1,400	570.00	798,000
ネットワンシステムズ	5,800	2,605.00	15,109,000
システムソフト	5,900	63.00	371,700
アルゴグラフィックス	1,400	3,025.00	4,235,000
マーベラス	2,500	683.00	1,707,500
エイベックス	2,700	1,331.00	3,593,700
B I P R O G Y	5,700	3,575.00	20,377,500
都築電気	800	2,104.00	1,683,200
TBSホールディングス	8,000	2,405.00	19,240,000
日本テレビホールディングス	13,800	1,459.00	20,134,200
朝日放送グループホールディングス	1,500	657.00	985,500
テレビ朝日ホールディングス	3,800	1,591.00	6,045,800
スカパーJ SATホールディングス	13,800	679.00	9,370,200
テレビ東京ホールディングス	1,100	2,785.00	3,063,500
日本BS放送	400	884.00	353,600
ビジョン	2,400	1,296.00	3,110,400
スマートバリュー	300	372.00	111,600
USEN-NEXT HOLDINGS	1,800	3,300.00	5,940,000
日本通信	14,800	198.00	2,930,400
クロップス	200	972.00	194,400
日本電信電話	5,011,800	173.50	869,547,300
KDDI	120,900	4,456.00	538,730,400

ソフトバンク	251,600	1,681.50	423,065,400	
光通信	1,800	20,495.00	36,891,000	
エムティーアイ	1,100	566.00	622,600	
GMOインターネットグループ	5,800	2,147.00	12,452,600	
ファイバーゲート	700	1,095.00	766,500	
アイドママーケティングコミュニケーション	300	235.00	70,500	
KADOKAWA	8,300	2,896.50	24,040,950	
学研ホールディングス	2,600	821.00	2,134,600	
ゼンリン	2,700	907.00	2,448,900	
昭文社ホールディングス	500	364.00	182,000	
インプレスホールディングス	1,100	176.00	193,600	
アイネット	1,000	1,645.00	1,645,000	
松竹	900	9,012.00	8,110,800	
東宝	9,800	4,902.00	48,039,600	
東映	400	17,360.00	6,944,000	
NTTデータグループ	49,100	1,763.00	86,563,300	
ピー・シー・エー	900	1,045.00	940,500	
ビジネスブレイン太田昭和	700	2,015.00	1,410,500	
D T S	3,300	3,025.00	9,982,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,900	5,021.00	39,665,900	
シーイーシー	2,200	1,520.00	3,344,000	
カプコン	15,500	5,283.00	81,886,500	
アイ・エス・ビー	800	1,284.00	1,027,200	
ジャステック	1,000	1,510.00	1,510,000	
S C S K	12,800	2,439.50	31,225,600	
N S W	600	2,656.00	1,593,600	
アイネス	1,100	1,583.00	1,741,300	
T K C	2,500	3,435.00	8,587,500	
富士ソフト	3,100	5,400.00	16,740,000	
N S D	5,600	2,605.00	14,588,000	
コナミグループ	6,700	7,949.00	53,258,300	
福井コンピュータホールディングス	1,100	2,539.00	2,792,900	
J B C Cホールディングス	1,200	2,819.00	3,382,800	
ミロク情報サービス	1,400	1,517.00	2,123,800	
ソフトバンクグループ	77,200	6,044.00	466,596,800	
高千穂交易	400	3,140.00	1,256,000	

オルバヘルスケアホールディングス	200	1,893.00	378,600
伊藤忠食品	400	6,570.00	2,628,000
エレマテック	1,500	1,714.00	2,571,000
あらた	1,300	5,380.00	6,994,000
トーメンデバイス	200	4,780.00	956,000
東京エレクトロン デバイス	1,800	3,895.00	7,011,000
円谷フィールドホールディングス	2,900	1,616.00	4,686,400
双日	16,500	3,086.00	50,919,000
アルフレッサ ホールディングス	16,600	2,359.50	39,167,700
横浜冷凍	4,500	1,147.00	5,161,500
神栄	200	1,522.00	304,400
ラサ商事	500	1,690.00	845,000
アルコニックス	2,200	1,342.00	2,952,400
神戸物産	12,800	3,642.00	46,617,600
ハイパー	300	320.00	96,000
あい ホールディングス	2,700	2,265.00	6,115,500
ディーブイエックス	300	1,045.00	313,500
ダイワボウホールディングス	6,800	2,767.00	18,815,600
マクニカホールディングス	3,900	6,940.00	27,066,000
ラクト・ジャパン	600	1,930.00	1,158,000
グリムス	700	1,969.00	1,378,300
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,100	983.00	2,064,300
八洲電機	1,300	1,224.00	1,591,200
メディアスホールディングス	1,100	737.00	810,700
レスターホールディングス	1,600	2,464.00	3,942,400
ジオリーブグループ	300	1,183.00	354,900
大光	500	664.00	332,000
OCHIホールディングス	300	1,375.00	412,500
TOKAIホールディングス	8,200	946.00	7,757,200
黒谷	400	578.00	231,200
C o m i n i x	300	809.00	242,700
三洋貿易	1,900	1,283.00	2,437,700
ビューティガレージ	300	4,385.00	1,315,500
ウイン・パートナーズ	1,200	1,082.00	1,298,400
ミタチ産業	300	987.00	296,100
シップヘルスケアホールディングス	5,900	2,200.50	12,982,950

明治電機工業	600	1,356.00	813,600
デリカフーズホールディングス	500	609.00	304,500
スターティアホールディングス	200	1,453.00	290,600
コメダホールディングス	4,100	2,667.00	10,934,700
ピーバンドットコム	200	393.00	78,600
アセンテック	600	497.00	298,200
富士興産	300	1,685.00	505,500
協栄産業	100	2,338.00	233,800
フルサト・マルカホールディングス	1,500	2,672.00	4,008,000
ヤマエグループホールディングス	1,000	3,310.00	3,310,000
小野建	1,700	1,634.00	2,777,800
南陽	200	2,034.00	406,800
佐島電機	700	1,835.00	1,284,500
エコートレーディング	200	1,342.00	268,400
伯東	1,000	4,995.00	4,995,000
コンドーテック	1,300	1,112.00	1,445,600
中山福	700	353.00	247,100
ナガイレーベン	2,100	2,024.00	4,250,400
三菱食品	1,500	3,930.00	5,895,000
松田産業	1,300	2,520.00	3,276,000
第一興商	6,400	2,190.00	14,016,000
メディパルホールディングス	15,800	2,469.50	39,018,100
S P K	700	1,840.00	1,288,000
萩原電気ホールディングス	700	4,130.00	2,891,000
アズワン	2,400	4,723.00	11,335,200
スズデン	600	2,107.00	1,264,200
シモジマ	1,200	1,116.00	1,339,200
ドウシシャ	1,700	2,146.00	3,648,200
小津産業	300	1,570.00	471,000
高速	900	2,019.00	1,817,100
たけびし	700	1,780.00	1,246,000
リックス	200	3,125.00	625,000
丸文	1,500	1,096.00	1,644,000
ハピネット	1,400	2,554.00	3,575,600
橋本総業ホールディングス	700	1,169.00	818,300
日本ライフライン	4,900	1,100.00	5,390,000

タカショー	1,500	605.00	907,500
I DOM	5,000	889.00	4,445,000
進和	1,000	2,389.00	2,389,000
エステイジャパン	300	739.00	221,700
ダイترون	700	2,844.00	1,990,800
シークス	2,400	1,360.00	3,264,000
田中商事	400	655.00	262,000
オーハシテクニカ	800	1,669.00	1,335,200
白銅	600	2,108.00	1,264,800
ダイコー通産	100	1,114.00	111,400
伊藤忠商事	100,100	5,343.00	534,834,300
丸紅	127,800	2,185.00	279,243,000
高島	800	890.00	712,000
長瀬産業	7,600	2,250.00	17,100,000
蝶理	900	2,844.00	2,559,600
豊田通商	14,500	7,893.00	114,448,500
三共生興	2,300	792.00	1,821,600
兼松	6,400	1,954.00	12,505,600
ツカモトコーポレーション	200	1,219.00	243,800
三井物産	115,500	5,328.00	615,384,000
日本紙パルプ商事	900	4,570.00	4,113,000
カメイ	1,800	1,455.00	2,619,000
東都水産	100	6,530.00	653,000
OUGホールディングス	200	2,338.00	467,600
スターゼン	1,300	2,480.00	3,224,000
山善	4,500	1,192.00	5,364,000
椿本興業	300	4,665.00	1,399,500
住友商事	99,900	2,935.50	293,256,450
内田洋行	700	6,630.00	4,641,000
三菱商事	100,600	6,908.00	694,944,800
第一実業	1,800	1,900.00	3,420,000
キヤノンマーケティングジャパン	3,800	3,649.00	13,866,200
西華産業	700	2,115.00	1,480,500
佐藤商事	1,200	1,425.00	1,710,000
菱洋エレクトロ	1,400	3,520.00	4,928,000
東京産業	1,500	808.00	1,212,000

ユアサ商事	1,400	3,995.00	5,593,000
神鋼商事	400	5,320.00	2,128,000
トルク	600	272.00	163,200
阪和興業	3,000	4,415.00	13,245,000
正栄食品工業	1,100	4,355.00	4,790,500
カナデン	1,100	1,465.00	1,611,500
RYODEN	1,400	2,305.00	3,227,000
岩谷産業	3,800	7,049.00	26,786,200
ナイス	300	1,418.00	425,400
ニチモウ	100	3,845.00	384,500
極東貿易	1,000	1,739.00	1,739,000
アステナホールディングス	3,100	525.00	1,627,500
三愛オブリ	4,400	1,584.00	6,969,600
稲畑産業	3,300	3,020.00	9,966,000
G S I クレオス	1,000	1,986.00	1,986,000
明和産業	2,200	638.00	1,403,600
クワザワホールディングス	400	524.00	209,600
ワキタ	3,100	1,477.00	4,578,700
東邦ホールディングス	4,100	3,264.00	13,382,400
サンゲツ	4,200	2,820.00	11,844,000
ミツウロコグループホールディングス	2,200	1,239.00	2,725,800
シナネンホールディングス	500	4,020.00	2,010,000
伊藤忠エネクス	4,100	1,464.00	6,002,400
サンリオ	4,700	6,434.00	30,239,800
サンワテクノス	800	2,034.00	1,627,200
リョーサン	1,800	4,740.00	8,532,000
新光商事	2,300	1,146.00	2,635,800
トーヨー	700	2,847.00	1,992,900
三信電気	700	2,190.00	1,533,000
東陽テクニカ	1,700	1,262.00	2,145,400
モスフードサービス	2,400	3,235.00	7,764,000
加賀電子	1,300	5,970.00	7,761,000
ソーダニッカ	800	972.00	777,600
立花エレテック	1,200	2,637.00	3,164,400
フォーバル	700	1,091.00	763,700
PAL TAC	2,600	4,548.00	11,824,800

三谷産業	3,000	319.00	957,000
太平洋興発	400	757.00	302,800
西本Wismettacホールディングス	400	5,810.00	2,324,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	2,096.00	209,600
コア商事ホールディングス	1,000	720.00	720,000
KPPグループホールディングス	3,900	622.00	2,425,800
ヤマタネ	700	2,196.00	1,537,200
丸紅建材リース	100	2,512.00	251,200
泉州電業	800	3,185.00	2,548,000
トラスコ中山	3,500	2,267.00	7,934,500
オートバックスセブン	5,800	1,514.00	8,781,200
モリト	1,200	1,279.00	1,534,800
加藤産業	2,100	4,040.00	8,484,000
北恵	300	916.00	274,800
イエローハット	3,000	1,783.00	5,349,000
JKホールディングス	1,300	928.00	1,206,400
日伝	1,000	2,526.00	2,526,000
北沢産業	700	259.00	181,300
杉本商事	700	2,111.00	1,477,700
因幡電機産業	4,300	3,065.00	13,179,500
東テク	600	4,785.00	2,871,000
ミスミグループ本社	24,900	2,270.50	56,535,450
アルテック	600	262.00	157,200
タキヒヨー	300	1,012.00	303,600
蔵王産業	200	2,401.00	480,200
スズケン	4,800	4,479.00	21,499,200
ジェコス	1,000	943.00	943,000
グローセル	1,400	468.00	655,200
ローソン	4,100	7,029.00	28,818,900
サンエー	1,300	4,675.00	6,077,500
カワチ薬品	1,300	2,462.00	3,200,600
エービーシー・マート	7,200	2,353.50	16,945,200
ハードオフコーポレーション	500	1,438.00	719,000
アスクル	3,400	2,022.00	6,874,800
ゲオホールディングス	1,600	2,228.00	3,564,800
アダストリア	2,000	3,155.00	6,310,000

ジーフット	900	275.00	247,500
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	674.00	134,800
くら寿司	1,900	3,375.00	6,412,500
キャンドウ	600	2,456.00	1,473,600
I Kホールディングス	400	363.00	145,200
パルグループホールディングス	3,300	1,885.00	6,220,500
エディオン	6,500	1,473.00	9,574,500
サーラコーポレーション	3,500	721.00	2,523,500
ワッツ	600	562.00	337,200
ハローズ	800	4,010.00	3,208,000
フジオフードグループ本社	1,900	1,386.00	2,633,400
あみやき亭	400	3,580.00	1,432,000
ひらまつ	2,500	245.00	612,500
大黒天物産	500	6,280.00	3,140,000
ハニーズホールディングス	1,300	1,513.00	1,966,900
ファーマライズホールディングス	300	648.00	194,400
アルペン	1,400	1,931.00	2,703,400
ハブ	400	722.00	288,800
クオールホールディングス	2,300	1,687.00	3,880,100
ジーンズホールディングス	1,000	4,235.00	4,235,000
ビックカメラ	8,800	1,108.00	9,750,400
DCMホールディングス	9,600	1,155.00	11,088,000
ペッパーフードサービス	3,700	109.00	403,300
MonotaRO	23,400	1,204.00	28,173,600
東京一番フーズ	300	501.00	150,300
J. フロント リテイリング	20,500	1,398.00	28,659,000
ドトール・日レスホールディングス	3,000	2,184.00	6,552,000
マツキヨココカラ&カンパニー	30,000	2,583.00	77,490,000
ブロンコビリー	1,000	3,020.00	3,020,000
ZOZO	10,900	2,714.00	29,582,600
トレジャー・ファクトリー	700	1,117.00	781,900
物語コーポレーション	2,800	3,875.00	10,850,000
三越伊勢丹ホールディングス	27,800	1,627.00	45,230,600
Hamee	600	922.00	553,200
マーケットエンタープライズ	100	1,400.00	140,000
ウエルシアホールディングス	8,600	2,459.50	21,151,700

クリエイトSDホールディングス	2,700	3,185.00	8,599,500
丸善CHIホールディングス	1,400	323.00	452,200
ミサワ	200	617.00	123,400
ティーライフ	200	1,354.00	270,800
チムニー	400	1,400.00	560,000
シュッピン	1,300	984.00	1,279,200
オイシックス・ラ・大地	2,300	1,169.00	2,688,700
ネクステージ	3,800	2,140.00	8,132,000
ジョイフル本田	4,800	1,740.00	8,352,000
鳥貴族ホールディングス	600	2,906.00	1,743,600
ホットランド	1,300	1,939.00	2,520,700
すかいらーくホールディングス	22,600	2,145.00	48,477,000
SFPホールディングス	900	2,219.00	1,997,100
綿半ホールディングス	1,300	1,310.00	1,703,000
ヨシックスホールディングス	200	2,772.00	554,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,400	1,057.00	5,707,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	670.00	536,000
B E E N O S	700	1,381.00	966,700
あさひ	1,400	1,261.00	1,765,400
日本調剤	1,100	1,364.00	1,500,400
コスモス薬品	1,600	15,010.00	24,016,000
トーエル	500	728.00	364,000
セブン&アイ・ホールディングス	56,900	5,414.00	308,056,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	12,400	992.00	12,300,800
ツルハホールディングス	3,500	10,620.00	37,170,000
サンマルクホールディングス	1,400	1,878.00	2,629,200
フェリシモ	300	929.00	278,700
トリドールホールディングス	4,100	3,520.00	14,432,000
TOKYO BASE	1,800	284.00	511,200
ウイルプラスホールディングス	200	1,168.00	233,600
JMホールディングス	1,300	1,981.00	2,575,300
サツドラホールディングス	500	763.00	381,500
アレンザホールディングス	1,300	990.00	1,287,000
串カツ田中ホールディングス	500	1,659.00	829,500
パロックジャパンリミテッド	1,100	777.00	854,700

クスリのアオキホールディングス	1,500	9,485.00	14,227,500
力の源ホールディングス	600	1,813.00	1,087,800
FOOD & LIFE COMPANIE	8,800	2,442.50	21,494,000
メディカルシステムネットワーク	1,500	438.00	657,000
一家ホールディングス	300	668.00	200,400
ジャパクラフトホールディングス	800	211.00	168,800
はるやまホールディングス	500	538.00	269,000
ノジマ	5,400	1,314.00	7,095,600
カップ・クリエイト	2,600	1,547.00	4,022,200
ライトオン	900	446.00	401,400
良品計画	18,000	2,006.50	36,117,000
パリティホールディングス	1,400	338.00	473,200
アドヴァングループ	1,600	1,002.00	1,603,200
アルビス	600	2,406.00	1,443,600
コナカ	1,300	386.00	501,800
ハウス オブ ローゼ	200	1,607.00	321,400
G-7ホールディングス	2,100	1,158.00	2,431,800
イオン北海道	2,500	854.00	2,135,000
コジマ	2,800	645.00	1,806,000
ヒマラヤ	400	923.00	369,200
コーナン商事	2,200	3,745.00	8,239,000
エコス	600	2,113.00	1,267,800
ワタミ	2,000	1,148.00	2,296,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	33,400	2,831.50	94,572,100
西松屋チェーン	3,700	1,891.00	6,996,700
ゼンショーホールディングス	9,000	7,557.00	68,013,000
ハークスレイ	400	685.00	274,000
サイゼリヤ	2,400	6,070.00	14,568,000
VTホールディングス	6,400	501.00	3,206,400
魚力	500	2,119.00	1,059,500
フジ・コーポレーション	800	1,654.00	1,323,200
ユナイテッドアローズ	1,800	1,891.00	3,403,800
ハイデイ日高	2,500	2,635.00	6,587,500
YU-WA Creation Holdings	800	162.00	129,600
コロワイド	7,600	2,284.00	17,358,400

老番屋	1,300	5,250.00	6,825,000
P L A N T	300	1,271.00	381,300
スギホールディングス	3,300	5,745.00	18,958,500
薬王堂ホールディングス	900	2,699.00	2,429,100
スクロール	2,500	1,057.00	2,642,500
ヨンドシーホールディングス	1,500	1,880.00	2,820,000
木曾路	2,500	2,550.00	6,375,000
S R S ホールディングス	2,800	1,034.00	2,895,200
千趣会	3,100	398.00	1,233,800
リテールパートナーズ	2,500	1,710.00	4,275,000
ケーヨー	2,700	1,298.00	3,504,600
上新電機	1,500	2,360.00	3,540,000
日本瓦斯	8,800	2,227.50	19,602,000
ロイヤルホールディングス	2,900	2,470.00	7,163,000
東天紅	100	818.00	81,800
いなげや	1,600	1,596.00	2,553,600
チヨダ	1,600	825.00	1,320,000
ライフコーポレーション	1,500	3,505.00	5,257,500
リンガーハット	2,100	2,273.00	4,773,300
M r M a x H D	2,400	606.00	1,454,400
A O K I ホールディングス	3,100	958.00	2,969,800
オークワ	2,700	838.00	2,262,600
コメリ	2,600	2,989.00	7,771,400
青山商事	3,600	1,475.00	5,310,000
しまむら	1,900	14,795.00	28,110,500
はせがわ	600	331.00	198,600
高島屋	12,500	2,002.50	25,031,250
松屋	2,800	876.00	2,452,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,000	1,592.00	12,736,000
近鉄百貨店	700	2,801.00	1,960,700
丸井グループ	12,200	2,332.00	28,450,400
アクシアル リテイリング	1,100	3,725.00	4,097,500
イオン	56,000	3,096.00	173,376,000
イズミ	2,500	3,804.00	9,510,000
平和堂	2,800	2,409.00	6,745,200
フジ	2,600	1,833.00	4,765,800

ヤオコー	1,900	7,571.00	14,384,900
ゼビオホールディングス	2,300	953.00	2,191,900
ケーズホールディングス	11,700	1,382.50	16,175,250
O l y m p i c グループ	500	505.00	252,500
日産東京販売ホールディングス	1,500	448.00	672,000
シルバーライフ	300	1,029.00	308,700
Genky Drug Stores	700	5,270.00	3,689,000
ナルミヤ・インターナショナル	200	1,162.00	232,400
ブックオフグループホールディングス	800	1,021.00	816,800
ギフトホールディングス	700	2,128.00	1,489,600
アインホールディングス	2,300	4,182.00	9,618,600
元気寿司	500	5,070.00	2,535,000
ヤマダホールディングス	67,700	462.90	31,338,330
アー克蘭ズ	5,000	1,560.00	7,800,000
ニトリホールディングス	6,700	15,990.00	107,133,000
愛眼	1,000	167.00	167,000
ケーユーホールディングス	1,000	1,079.00	1,079,000
吉野家ホールディングス	6,500	3,361.00	21,846,500
松屋フーズホールディングス	800	4,190.00	3,352,000
サガミホールディングス	2,700	1,315.00	3,550,500
関西フードマーケット	1,500	1,329.00	1,993,500
王将フードサービス	1,100	6,860.00	7,546,000
ミニストップ	1,200	1,491.00	1,789,200
アークス	3,000	2,791.00	8,373,000
バローホールディングス	3,200	2,250.00	7,200,000
ベルク	800	6,980.00	5,584,000
大庄	600	1,226.00	735,600
ファーストリテイリング	7,400	33,140.00	245,236,000
サンドラッグ	6,300	4,015.00	25,294,500
サックスパー ホールディングス	1,600	847.00	1,355,200
ヤマザワ	200	1,250.00	250,000
やまや	200	2,865.00	573,000
ベルーナ	4,000	618.00	2,472,000
いよぎんホールディングス	18,300	1,043.00	19,086,900
しずおかフィナンシャルグループ	34,100	1,236.00	42,147,600
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	12,900	1,133.00	14,615,700

楽天銀行	5,300	2,435.00	12,905,500	
京都フィナンシャルグループ	4,900	8,650.00	42,385,000	
島根銀行	400	514.00	205,600	
じもとホールディングス	900	402.00	361,800	
めぶきフィナンシャルグループ	76,200	434.20	33,086,040	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	4,205.00	8,410,000	
九州フィナンシャルグループ	27,000	888.80	23,997,600	
ゆうちょ銀行	42,200	1,337.50	56,442,500	
富山第一銀行	4,900	943.00	4,620,700	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	82,400	683.30	56,303,920	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,500	1,701.00	16,159,500	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,835.00	2,569,000	
第四北越フィナンシャルグループ	2,400	3,745.00	8,988,000	
ひろぎんホールディングス	20,000	937.70	18,754,000	
おきなわフィナンシャルグループ	1,400	2,402.00	3,362,800	
十六フィナンシャルグループ	2,000	3,865.00	7,730,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,600	5,080.00	8,128,000	
プロクレアホールディングス	1,900	1,908.00	3,625,200	
あいちフィナンシャルグループ	2,200	2,308.00	5,077,600	
あおぞら銀行	9,700	2,914.50	28,270,650	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	962,200	1,226.50	1,180,138,300	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	193,100	781.20	150,849,720	
三井住友トラスト・ホールディングス	27,400	5,558.00	152,289,200	
三井住友フィナンシャルグループ	109,200	7,117.00	777,176,400	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	42,800	1,079.00	46,181,200	
群馬銀行	29,800	686.10	20,445,780	
武蔵野銀行	2,000	2,711.00	5,422,000	
千葉興業銀行	2,400	909.00	2,181,600	
筑波銀行	6,700	278.00	1,862,600	
七十七銀行	4,900	3,235.00	15,851,500	
秋田銀行	1,000	2,018.00	2,018,000	
山形銀行	1,700	1,139.00	1,936,300	
岩手銀行	1,100	2,702.00	2,972,200	
東邦銀行	12,000	274.00	3,288,000	
東北銀行	500	1,112.00	556,000	

ふくおかフィナンシャルグループ	12,300	3,788.00	46,592,400
スルガ銀行	13,500	624.00	8,424,000
八十二銀行	32,400	829.90	26,888,760
山梨中央銀行	1,600	1,771.00	2,833,600
大垣共立銀行	2,900	1,995.00	5,785,500
福井銀行	1,400	1,539.00	2,154,600
清水銀行	600	1,612.00	967,200
富山銀行	200	1,730.00	346,000
滋賀銀行	2,600	3,690.00	9,594,000
南都銀行	2,300	2,576.00	5,924,800
百五銀行	14,500	537.00	7,786,500
紀陽銀行	5,500	1,468.00	8,074,000
ほくほくフィナンシャルグループ	9,800	1,624.50	15,920,100
山陰合同銀行	9,600	991.00	9,513,600
鳥取銀行	300	1,308.00	392,400
百十四銀行	1,400	2,699.00	3,778,600
四国銀行	2,400	1,019.00	2,445,600
阿波銀行	2,200	2,353.00	5,176,600
大分銀行	900	2,664.00	2,397,600
宮崎銀行	1,000	2,760.00	2,760,000
佐賀銀行	900	1,943.00	1,748,700
琉球銀行	3,500	1,184.00	4,144,000
セブン銀行	55,000	292.60	16,093,000
みずほフィナンシャルグループ	222,200	2,502.00	555,944,400
高知銀行	300	1,009.00	302,700
山口フィナンシャルグループ	15,000	1,309.50	19,642,500
名古屋銀行	1,000	5,540.00	5,540,000
北洋銀行	23,300	370.00	8,621,000
大光銀行	300	1,408.00	422,400
愛媛銀行	2,000	1,068.00	2,136,000
トマト銀行	300	1,142.00	342,600
京葉銀行	7,000	653.00	4,571,000
栃木銀行	7,000	330.00	2,310,000
北日本銀行	500	2,197.00	1,098,500
東和銀行	2,800	645.00	1,806,000
福島銀行	1,100	252.00	277,200

大東銀行	400	760.00	304,000
トモニホールディングス	12,500	468.00	5,850,000
フィデアホールディングス	1,600	1,559.00	2,494,400
池田泉州ホールディングス	19,800	331.00	6,553,800
F P G	5,200	1,291.00	6,713,200
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,300	1,578.00	2,051,400
マーキュリアホールディングス	500	747.00	373,500
S B I ホールディングス	22,400	3,078.00	68,947,200
ジャフコ グループ	5,100	1,559.00	7,950,900
大和証券グループ本社	109,800	839.60	92,188,080
野村ホールディングス	277,000	563.60	156,117,200
岡三証券グループ	13,500	685.00	9,247,500
丸三証券	5,100	795.00	4,054,500
東洋証券	5,100	306.00	1,560,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	16,700	487.00	8,132,900
光世証券	200	493.00	98,600
水戸証券	4,100	440.00	1,804,000
いちよし証券	2,800	696.00	1,948,800
松井証券	9,100	747.00	6,797,700
マネックスグループ	16,500	660.00	10,890,000
極東証券	1,900	1,000.00	1,900,000
岩井コスモホールディングス	1,800	1,698.00	3,056,400
アイザワ証券グループ	2,200	1,113.00	2,448,600
マネーパートナーズグループ	1,100	284.00	312,400
スパークス・グループ	1,700	1,397.00	2,374,900
かんぽ生命保険	17,800	2,759.00	49,110,200
S O M P O ホールディングス	26,400	6,379.00	168,405,600
アニコム ホールディングス	5,200	545.00	2,834,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	31,300	5,421.00	169,677,300
第一生命ホールディングス	75,100	3,057.00	229,580,700
東京海上ホールディングス	151,800	3,336.00	506,404,800
T & D ホールディングス	41,200	2,497.50	102,897,000
アドバンスクリエイト	800	948.00	758,400
全国保証	4,000	4,782.00	19,128,000
あんしん保証	400	275.00	110,000

ジェイリース	300	1,823.00	546,900
イントラスト	400	858.00	343,200
日本モーゲージサービス	500	518.00	259,000
C a s a	400	815.00	326,000
アルヒ	1,900	817.00	1,552,300
プレミアグループ	2,600	1,422.00	3,697,200
ネットプロテクションズホールディングス	5,100	265.00	1,351,500
クレディセゾン	9,700	2,164.00	20,990,800
芙蓉総合リース	1,400	11,670.00	16,338,000
みずほリース	2,300	4,590.00	10,557,000
東京センチュリー	2,900	5,645.00	16,370,500
日本証券金融	5,700	1,418.00	8,082,600
アイフル	25,500	372.00	9,486,000
リコーリース	1,500	4,360.00	6,540,000
イオンフィナンシャルサービス	8,800	1,220.00	10,736,000
アコム	27,500	349.30	9,605,750
ジャックス	1,600	5,050.00	8,080,000
オリエントコーポレーション	4,000	1,094.00	4,376,000
オリックス	100,900	2,657.00	268,091,300
三菱HCキャピタル	59,900	962.70	57,665,730
九州リースサービス	500	919.00	459,500
日本取引所グループ	43,200	2,897.00	125,150,400
イー・ギャランティ	2,500	1,710.00	4,275,000
アサックス	400	657.00	262,800
NECキャピタルソリューション	700	3,110.00	2,177,000
大東建託	5,600	15,240.00	85,344,000
いちご	18,200	329.00	5,987,800
日本駐車場開発	16,800	209.00	3,511,200
スター・マイカ・ホールディングス	2,100	591.00	1,241,100
SREホールディングス	800	2,095.00	1,676,000
ADワークスグループ	3,300	249.00	821,700
ヒューリック	35,900	1,321.00	47,423,900
野村不動産ホールディングス	9,600	3,630.00	34,848,000
三重交通グループホールディングス	3,400	539.00	1,832,600
サムティ	2,500	2,416.00	6,040,000
ディア・ライフ	2,700	727.00	1,962,900

コーセーアールイー	400	948.00	379,200
地主	1,200	1,966.00	2,359,200
プレサンスコーポレーション	2,500	1,585.00	3,962,500
THEグローバル社	800	359.00	287,200
ハウスコム	300	845.00	253,500
JPMC	1,000	1,121.00	1,121,000
サンセイランディック	400	1,000.00	400,000
エストラスト	400	628.00	251,200
フージャースホールディングス	2,400	1,033.00	2,479,200
オープンハウスグループ	5,700	4,763.00	27,149,100
東急不動産ホールディングス	46,300	860.20	39,827,260
飯田グループホールディングス	13,100	2,262.50	29,638,750
イーグランド	200	1,450.00	290,000
ムゲンエステート	900	974.00	876,600
ビーロッド	900	780.00	702,000
ファーストブラザーズ	300	1,086.00	325,800
And Doホールディングス	1,000	956.00	956,000
シーアールイー	1,000	1,522.00	1,522,000
ケイアイスター不動産	800	4,220.00	3,376,000
アグレ都市デザイン	200	1,468.00	293,600
グッドコムアセット	1,500	923.00	1,384,500
ジェイ・エス・ビー	400	4,485.00	1,794,000
ロードスターキャピタル	1,000	1,813.00	1,813,000
テンポイノベーション	400	1,106.00	442,400
グローバル・リンク・マネジメント	300	1,775.00	532,500
フェイスネットワーク	400	1,285.00	514,000
パーク24	10,000	1,712.00	17,120,000
パラカ	600	1,922.00	1,153,200
ミガロホールディングス	200	1,140.00	228,000
三井不動産	65,600	3,197.00	209,723,200
三菱地所	92,800	1,895.50	175,902,400
平和不動産	2,500	3,845.00	9,612,500
東京建物	13,500	1,963.50	26,507,250
京阪神ビルディング	2,700	1,372.00	3,704,400
住友不動産	27,800	3,637.00	101,108,600
テーオーシー	2,900	624.00	1,809,600

東京楽天地	300	4,130.00	1,239,000
スターツコーポレーション	2,300	2,759.00	6,345,700
フジ住宅	2,300	703.00	1,616,900
空港施設	2,100	566.00	1,188,600
明和地所	600	1,122.00	673,200
ゴールドクレスト	1,500	2,222.00	3,333,000
エスリード	800	2,922.00	2,337,600
日神グループホールディングス	2,800	506.00	1,416,800
日本エスコン	3,100	870.00	2,697,000
MIRARTHホールディングス	8,000	459.00	3,672,000
AVANTIA	800	831.00	664,800
イオンモール	8,000	1,699.00	13,592,000
毎日コムネット	500	722.00	361,000
ファースト住建	500	1,153.00	576,500
カチタス	4,200	1,975.00	8,295,000
トーセイ	2,600	1,718.00	4,466,800
サンフロンティア不動産	2,600	1,408.00	3,660,800
FJネクストホールディングス	1,700	1,029.00	1,749,300
インテリックス	500	508.00	254,000
ランドビジネス	900	282.00	253,800
グランディハウス	1,100	615.00	676,500
日本空港ビルデング	5,500	6,168.00	33,924,000
明豊ファシリティワークス	500	766.00	383,000
LIFULL	5,500	217.00	1,193,500
MIXI	3,700	2,255.00	8,343,500
ジェイエイシーリクルートメント	1,400	2,344.00	3,281,600
日本M&Aセンターホールディングス	27,500	650.30	17,883,250
メンバーズ	500	1,119.00	559,500
中広	100	403.00	40,300
UTグループ	2,400	1,891.00	4,538,400
アイティメディア	600	1,015.00	609,000
E・Jホールディングス	900	1,543.00	1,388,700
オープンアップグループ	4,800	1,778.00	8,534,400
コシダカホールディングス	4,800	1,055.00	5,064,000
アルトナー	300	1,686.00	505,800
パソナグループ	2,000	1,354.00	2,708,000

CDS	300	1,692.00	507,600
リンクアンドモチベーション	4,600	390.00	1,794,000
エス・エム・エス	6,100	2,264.50	13,813,450
サニーサイドアップグループ	300	781.00	234,300
パーソルホールディングス	176,800	217.00	38,365,600
リニカル	600	564.00	338,400
クックパッド	4,500	110.00	495,000
エスクリ	500	284.00	142,000
アイ・ケイ・ケイホールディングス	500	691.00	345,500
学情	800	1,639.00	1,311,200
スタジオアリス	800	2,039.00	1,631,200
シミックホールディングス	800	1,668.00	1,334,400
エプコ	300	780.00	234,000
N J S	400	2,742.00	1,096,800
総合警備保障	29,800	860.60	25,645,880
カカコム	11,800	1,412.50	16,667,500
アイロムグループ	600	1,676.00	1,005,600
セントケア・ホールディング	1,000	819.00	819,000
サイネックス	200	867.00	173,400
ルネサンス	1,200	856.00	1,027,200
ディップ	2,800	2,934.00	8,215,200
デジタルホールディングス	900	1,019.00	917,100
新日本科学	1,700	1,596.00	2,713,200
キャリアデザインセンター	200	1,817.00	363,400
ベネフィット・ワン	7,400	1,040.00	7,696,000
エムスリー	31,700	2,279.00	72,244,300
ツカダ・グローバルホールディング	700	388.00	271,600
ブラス	100	600.00	60,000
アウトソーシング	10,300	1,075.00	11,072,500
ウェルネット	800	541.00	432,800
ワールドホールディングス	700	2,254.00	1,577,800
ディー・エヌ・エー	6,400	1,455.50	9,315,200
博報堂DYホールディングス	20,400	1,183.00	24,133,200
ぐるなび	3,000	260.00	780,000
タカミヤ	2,200	468.00	1,029,600
ジャパンベストレスキューシステム	800	593.00	474,400

ファンコミュニケーションズ	2,300	399.00	917,700
ライク	600	1,340.00	804,000
A o b a - B B T	400	384.00	153,600
エスプール	4,600	337.00	1,550,200
W D B ホールディングス	800	2,076.00	1,660,800
ティア	600	453.00	271,800
C D G	100	1,188.00	118,800
アドウェイズ	2,200	525.00	1,155,000
バリューコマース	1,400	1,177.00	1,647,800
インフォマート	16,700	354.00	5,911,800
J P ホールディングス	4,600	340.00	1,564,000
エコナックホールディングス	1,000	135.00	135,000
C L ホールディングス	400	800.00	320,000
プレステージ・インターナショナル	6,800	600.00	4,080,000
アミューズ	900	1,464.00	1,317,600
ドリームインキュベータ	500	2,925.00	1,462,500
クイック	1,200	1,996.00	2,395,200
T A C	500	199.00	99,500
電通グループ	15,800	4,248.00	67,118,400
テイクアンドギヴ・ニーズ	400	899.00	359,600
ぴあ	500	3,395.00	1,697,500
イオンファンタジー	700	2,574.00	1,801,800
シーティーエス	1,800	654.00	1,177,200
ネクシィーズグループ	300	836.00	250,800
H. U. グループホールディングス	4,700	2,457.00	11,547,900
アルプス技研	1,500	2,492.00	3,738,000
日本空調サービス	1,700	757.00	1,286,900
オリエンタルランド	84,900	4,660.00	395,634,000
ダスキン	3,600	3,252.00	11,707,200
明光ネットワークジャパン	2,000	708.00	1,416,000
ファルコホールディングス	700	1,954.00	1,367,800
秀英予備校	200	401.00	80,200
ラウンドワン	13,400	529.00	7,088,600
リゾートトラスト	6,300	2,108.00	13,280,400
ビー・エム・エル	2,000	2,814.00	5,628,000
リソー教育	7,200	254.00	1,828,800

早稲田アカデミー	900	1,381.00	1,242,900
ユー・エス・エス	16,500	2,516.50	41,522,250
東京個別指導学院	2,000	498.00	996,000
サイバーエージェント	35,400	768.70	27,211,980
楽天グループ	137,300	555.50	76,270,150
クリーク・アンド・リバー社	900	1,800.00	1,620,000
SBIグローバルアセットマネジメント	2,600	520.00	1,352,000
テー・オー・ダブリュー	3,200	309.00	988,800
山田コンサルティンググループ	800	1,519.00	1,215,200
セントラルスポーツ	600	2,364.00	1,418,400
フルキャストホールディングス	1,600	1,698.00	2,716,800
エン・ジャパン	2,900	2,084.00	6,043,600
リソルホールディングス	100	4,945.00	494,500
テクノプロ・ホールディングス	9,500	2,859.00	27,160,500
アトラグループ	300	205.00	61,500
アイ・アールジャパンホールディングス	800	1,338.00	1,070,400
Keep 技研	1,000	5,560.00	5,560,000
ファーストロジック	200	483.00	96,600
三機サービス	200	1,120.00	224,000
Gunosy	1,300	687.00	893,100
デザインワン・ジャパン	200	156.00	31,200
イー・ガーディアン	600	1,654.00	992,400
リブセンス	500	281.00	140,500
ジャパンマテリアル	4,900	2,177.00	10,667,300
ベクトル	2,500	1,076.00	2,690,000
ウチヤマホールディングス	400	341.00	136,400
チャーム・ケア・コーポレーション	1,300	1,062.00	1,380,600
キャリアリンク	600	2,379.00	1,427,400
IBJ	1,200	625.00	750,000
アサンテ	800	1,579.00	1,263,200
バリューHR	1,400	1,212.00	1,696,800
M&Aキャピタルパートナーズ	1,300	2,438.00	3,169,400
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,016.00	609,600
ERIホールディングス	300	1,618.00	485,400
アビスト	200	3,060.00	612,000
シグマクシス・ホールディングス	2,400	1,386.00	3,326,400

ウィルグループ	1,300	1,068.00	1,388,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,100	138.00	151,800
メドピア	1,400	864.00	1,209,600
レアジョブ	200	919.00	183,800
リクルートホールディングス	118,700	4,220.00	500,914,000
エラン	2,100	729.00	1,530,900
土木管理総合試験所	500	325.00	162,500
日本郵政	193,000	1,295.50	250,031,500
ベルシステム24ホールディングス	2,200	1,484.00	3,264,800
鎌倉新書	1,800	575.00	1,035,000
SMN	200	367.00	73,400
一蔵	100	575.00	57,500
グローバルキッズCOMPANY	200	629.00	125,800
エアトリ	1,200	1,772.00	2,126,400
アトラエ	1,000	976.00	976,000
ストライク	700	3,080.00	2,156,000
ソラスト	4,500	553.00	2,488,500
セラク	500	1,154.00	577,000
インソース	3,400	840.00	2,856,000
ベイカレント・コンサルティング	12,700	3,860.00	49,022,000
Orchestra Holdings	300	908.00	272,400
アイモバイル	700	1,351.00	945,700
キャリアインデックス	300	254.00	76,200
MS-Japan	300	1,107.00	332,100
船場	200	901.00	180,200
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,700	1,952.00	11,126,400
フルテック	200	1,158.00	231,600
グリーンズ	400	1,469.00	587,600
ツナググループ・ホールディングス	300	710.00	213,000
GameWith	300	289.00	86,700
MS&Consulting	100	648.00	64,800
ウェルビー	1,100	615.00	676,500
エル・ティー・エス	200	3,065.00	613,000
ミダックホールディングス	1,000	1,636.00	1,636,000
キュービーネットホールディングス	800	1,617.00	1,293,600

R P Aホールディングス	2,200	289.00	635,800
スプリックス	300	793.00	237,900
マネジメントソリューションズ	700	2,359.00	1,651,300
プロレド・パートナーズ	400	405.00	162,000
a n d f a c t o r y	300	363.00	108,900
テノ.ホールディングス	100	505.00	50,500
フロンティア・マネジメント	400	1,531.00	612,400
ピアラ	200	385.00	77,000
コプロ・ホールディングス	400	1,092.00	436,800
ギークス	100	624.00	62,400
アンビスホールディングス	1,700	2,400.00	4,080,000
カーブスホールディングス	4,400	622.00	2,736,800
フォーラムエンジニアリング	900	1,284.00	1,155,600
F a s t F i t n e s s J a p a n	600	1,164.00	698,400
ダイレクトマーケティングミックス	1,700	363.00	617,100
ポピンズ	200	1,186.00	237,200
L I T A L I C O	1,300	1,845.00	2,398,500
アドバンテッジリスクマネジメント	500	408.00	204,000
リログループ	8,900	1,456.50	12,962,850
東祥	1,100	968.00	1,064,800
I D & Eホールディングス	1,000	3,305.00	3,305,000
ビーウィズ	400	1,860.00	744,000
T R Eホールディングス	3,400	1,129.00	3,838,600
人・夢・技術グループ	600	1,604.00	962,400
N I S S Oホールディングス	1,200	728.00	873,600
大栄環境	4,100	2,086.00	8,552,600
日本管財ホールディングス	1,700	2,484.00	4,222,800
M & A総研ホールディングス	800	2,768.00	2,214,400
エイチ・アイ・エス	4,700	1,652.00	7,764,400
ラックランド	700	2,836.00	1,985,200
共立メンテナンス	2,700	5,636.00	15,217,200
イチネンホールディングス	1,700	1,339.00	2,276,300
建設技術研究所	800	4,380.00	3,504,000
スペース	1,100	889.00	977,900
燦ホールディングス	1,400	1,016.00	1,422,400
スバル興業	100	12,460.00	1,246,000

東京テアトル	400	1,058.00	423,200	
タナベコンサルティンググループ	400	1,070.00	428,000	
ナガワ	400	6,370.00	2,548,000	
東京都競馬	1,300	3,805.00	4,946,500	
常磐興産	400	1,255.00	502,000	
カナモト	2,500	2,388.00	5,970,000	
ニシオホールディングス	1,500	3,220.00	4,830,000	
トランス・コスモス	2,000	3,055.00	6,110,000	
乃村工藝社	7,000	834.00	5,838,000	
藤田観光	600	4,025.00	2,415,000	
KNT-CTホールディングス	1,000	1,239.00	1,239,000	
トーカイ	1,400	1,859.00	2,602,600	
白洋舎	200	2,454.00	490,800	
セコム	16,300	10,130.00	165,119,000	
セントラル警備保障	900	2,547.00	2,292,300	
丹青社	3,100	816.00	2,529,600	
メイテックグループホールディングス	6,200	2,523.50	15,645,700	
応用地質	1,500	2,215.00	3,322,500	
船井総研ホールディングス	3,300	2,415.00	7,969,500	
進学会ホールディングス	300	283.00	84,900	
オオバ	700	887.00	620,900	
いであ	300	1,610.00	483,000	
学究社	600	1,997.00	1,198,200	
ベネッセホールディングス	6,000	1,752.00	10,512,000	
イオンディライト	1,800	3,260.00	5,868,000	
ナック	700	948.00	663,600	
ダイセキ	3,300	3,985.00	13,150,500	
ステップ	600	1,720.00	1,032,000	
合 計	23,776,000		49,297,077,010	

(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)

	2022年10月26日現在	2023年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	128,867,914	286,898,610
コール・ローン	1,593,648,861	3,860,179,962
株式	248,313,230,169	292,245,103,382
投資証券	5,675,069,108	5,687,435,505
派生商品評価勘定	142,436,979	59,273,744
未収入金	64,092,962	81,153,485
未収配当金	187,388,237	214,263,884
差入委託証拠金	2,133,240,976	414,214,306
流動資産合計	258,237,975,206	302,848,522,878
資産合計	258,237,975,206	302,848,522,878
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,718,761	83,210,703
未払金	67,885,745	-
未払解約金	115,966,485	1,877,026,677
未払利息	2,591	1,375
流動負債合計	188,573,582	1,960,238,755
負債合計	188,573,582	1,960,238,755
純資産の部		
元本等		
元本	58,419,890,528	60,617,205,489
剰余金		
剰余金又は欠損金(△)	199,629,511,096	240,271,078,634
元本等合計	258,049,401,624	300,888,284,123
純資産合計	258,049,401,624	300,888,284,123
負債純資産合計	258,237,975,206	302,848,522,878

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)

		2022 年 10 月 26 日現在	2023 年 10 月 26 日現在
1.	期首	2021 年 10 月 27 日	2022 年 10 月 27 日
	期首元本額	61,697,952,086 円	58,419,890,528 円
	期首からの追加設定元本額	10,737,486,481 円	10,020,807,446 円
	期首からの一部解約元本額	14,015,548,039 円	7,823,492,485 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）	29,264,146,292 円	33,033,504,086 円
	DC インデックスバランス（株式 20）	122,426,648 円	113,435,960 円
	DC インデックスバランス（株式 40）	324,451,133 円	313,862,875 円
	DC インデックスバランス（株式 60）	642,259,230 円	674,344,956 円
	DC インデックスバランス（株式 80）	699,491,289 円	811,294,314 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	1,452,645,742 円	1,254,888,146 円
	日興五大陸株式ファンド	3,657,320,915 円	3,477,499,117 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）	14,318,011 円	13,258,596 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）	90,192,400 円	75,144,450 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）	5,927,380,507 円	5,869,865,622 円
グローバル 3 倍 3 分法ファンド（適格機関投資家向け）	10,069,193,942 円	8,685,455,095 円	
Tracers グローバル 3 分法（おとなのバランス）	— 円	7,448,649 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）	— 円	233,610,327 円	
Tracers MSCI オール・カンントリー・インデックス（全世界株式）	— 円	300,017,123 円	
Ni つみインデックスラップ世界 10 指数（均等型）	— 円	263,039 円	
Ni つみインデックスラップ世界 10 指数（安定成長型）	— 円	148,330 円	

国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,821,226,129円	1,338,394,962円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	18,154,493円	15,811,296円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	51,457,152円	46,137,440円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	78,434,511円	73,311,676円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	76,968,989円	73,782,515円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,109,823,145円	4,205,726,915円
計	58,419,890,528円	60,617,205,489円
2. 受益権の総数	58,419,890,528口	60,617,205,489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 2021年10月27日 至 2022年10月26日	自 2022年10月27日 至 2023年10月26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

	2022年10月26日現在	2023年10月26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)

(2022年10月26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	△44,792,393,104
投資証券	△1,779,397,198
合計	△46,571,790,302

(2023年10月26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	20,078,428,575
投資証券	△670,055,296
合計	19,408,373,279

(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)

(2022年10月26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	4,791,256,524	—	4,904,733,499	113,476,975
合計		4,791,256,524	—	4,904,733,499	113,476,975

(2023年10月26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	3,105,221,913	—	3,022,281,000	△82,940,913
合計		3,105,221,913	—	3,022,281,000	△82,940,913

(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)

(2022年10月26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	2,493,474,647	—	2,517,715,890	24,241,243
	米ドル	1,876,457,070	—	1,892,892,070	16,435,000
	ユーロ	617,017,577	—	624,823,820	7,806,243
合計		2,493,474,647	—	2,517,715,890	24,241,243

(2023年10月26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	2,398,406,226	—	2,456,192,930	57,786,704
	米ドル	2,007,327,400	—	2,061,665,290	54,337,890
	ユーロ	391,078,826	—	394,527,640	3,448,814
	売建	86,125,500	—	84,908,250	1,217,250
	豪ドル	86,125,500	—	84,908,250	1,217,250
合計		2,484,531,726	—	2,541,101,180	59,003,954

(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)

2022年10月26日現在	2023年10月26日現在
---------------	---------------

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.4171円 (44,171円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.9637円 (49,637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	41.02	523,005.00	
	BAKER HUGHES CO	40,615	34.02	1,381,722.30	
	CHENIERE ENERGY INC	9,500	167.95	1,595,525.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	3,750	86.65	324,937.50	
	CHEVRON CORP	72,391	155.87	11,283,585.17	
	CONOCOPHILLIPS	48,126	120.41	5,794,851.66	
	COTERRA ENERGY INC	32,460	28.23	916,345.80	
	DEVON ENERGY CORPORATION	25,260	47.85	1,208,691.00	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	6,540	164.68	1,077,007.20	
	EOG RESOURCES INC	23,472	129.73	3,045,022.56	
	EQT CORP	12,660	42.02	531,973.20	
	EXXON MOBIL CORP	161,521	108.59	17,539,565.39	
	HALLIBURTON CO	37,607	40.38	1,518,570.66	
	HESS CORP	10,870	154.40	1,678,328.00	
	HF SINCLAIR CORP	5,940	53.81	319,631.40	
	KINDER MORGAN INC	81,490	16.79	1,368,217.10	
	MARATHON OIL CORP	28,380	28.12	798,045.60	
	MARATHON PETROLEUM CORP	17,692	147.35	2,606,916.20	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	28,351	63.27	1,793,767.77	
	ONEOK INC	22,440	66.27	1,487,098.80	
	OVINTIV INC	9,400	48.73	458,062.00	
	PHILLIPS 66	18,855	110.74	2,088,002.70	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,130	245.16	2,238,310.80	
	SCHLUMBERGER LTD	56,921	56.62	3,222,867.02	
	TARGA RESOURCES CORP	8,180	85.35	698,163.00	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	245	1,859.01	455,457.45	
VALERO ENERGY CORP	14,682	126.86	1,862,558.52		
WILLIAMS COS INC	47,324	34.46	1,630,785.04		
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,115	274.48	2,501,885.20		

ALBEMARLE CORP	4,750	135.32	642,770.00
AMCOR PLC	65,600	8.56	561,536.00
AVERY DENNISON CORP	3,040	168.33	511,723.20
BALL CORP	12,500	45.46	568,250.00
CELANESE CORP	4,090	112.94	461,924.60
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,820	80.88	632,481.60
CLEVELAND-CLIFFS INC	21,150	15.83	334,804.50
CORTEVA INC	28,172	48.63	1,370,004.36
CROWN HOLDINGS INC	4,565	79.27	361,867.55
DOW INC	28,025	47.54	1,332,308.50
DUPONT DE NEMOURS INC	19,162	71.64	1,372,765.68
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,815	69.03	332,379.45
ECOLAB INC	10,200	158.67	1,618,434.00
FMC CORP	4,840	55.77	269,926.80
FREEMPORT-MCMORAN INC	56,338	33.84	1,906,477.92
INTERNATIONAL PAPER CO	13,670	33.12	452,750.40
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,675	66.10	705,617.50
LINDE PLC	19,590	364.38	7,138,204.20
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,570	89.24	943,266.80
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,720	410.34	1,116,124.80
MOSAIC CO/THE	13,580	33.36	453,028.80
NEWMONT CORP	45,872	36.76	1,686,254.72
NUCOR CORP	9,959	144.60	1,440,071.40
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	148.88	532,990.40
PPG INDUSTRIES INC	9,394	121.48	1,141,183.12
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	2,210	247.17	546,245.70
RPM INTERNATIONAL INC	4,960	89.86	445,705.60
SEALED AIR CORP	5,746	30.81	177,034.26
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,626	238.61	2,296,859.86
STEEL DYNAMICS INC	6,010	99.84	600,038.40
VULCAN MATERIALS CO	5,563	203.37	1,131,347.31
WESTLAKE CORP	1,360	113.19	153,938.40
WESTROCK CO	9,989	34.63	345,919.07
3M CO	21,546	89.39	1,925,996.94
AECOM	4,930	76.22	375,764.60
AERCAP HOLDINGS NV	6,970	58.70	409,139.00

ALLEGION PLC	3,340	96.52	322,376.80
AMETEK INC	9,033	139.66	1,261,548.78
AXON ENTERPRISE INC	2,540	207.87	527,989.80
BOEING CO/THE	22,962	177.73	4,081,036.26
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	5,240	106.22	556,592.80
CARLISLE COS INC	2,250	237.15	533,587.50
CARRIER GLOBAL CORP	33,088	47.04	1,556,459.52
CATERPILLAR INC	20,576	244.94	5,039,885.44
CUMMINS INC	5,535	218.58	1,209,840.30
DEERE & CO	11,095	371.91	4,126,341.45
DOVER CORP	5,350	130.08	695,928.00
EATON CORP PLC	15,996	195.23	3,122,899.08
EMERSON ELECTRIC CO	22,490	88.83	1,997,786.70
FASTENAL CO	22,796	57.08	1,301,195.68
FERGUSON PLC	8,440	152.19	1,284,483.60
FORTIVE CORP	14,854	64.60	959,568.40
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	5,050	55.23	278,911.50
GENERAC HOLDINGS INC	2,440	85.12	207,692.80
GENERAL DYNAMICS CORP	9,397	242.40	2,277,832.80
GENERAL ELECTRIC CO	43,327	111.20	4,817,962.40
GRACO INC	6,310	69.80	440,438.00
HEICO CORP	1,800	160.45	288,810.00
HEICO CORP-CLASS A	3,120	128.43	400,701.60
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	26,766	178.09	4,766,756.94
HOWMET AEROSPACE INC	17,943	43.23	775,675.89
HUBBELL INC	2,320	279.89	649,344.80
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,530	215.06	329,041.80
IDEX CORP	2,880	187.00	538,560.00
ILLINOIS TOOL WORKS	12,175	225.97	2,751,184.75
INGERSOLL-RAND INC	16,398	59.36	973,385.28
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,570	40.25	264,442.50
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	27,484	48.10	1,321,980.40
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,750	175.74	1,361,985.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,385	339.30	469,930.50
LOCKHEED MARTIN CORP	9,156	447.69	4,099,049.64
MASCO CORP	9,849	48.33	476,002.17

NORDSON CORP	2,345	210.71	494,114.95
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,784	483.26	2,795,175.84
OTIS WORLDWIDE CORP	17,124	75.47	1,292,348.28
OWENS CORNING	3,550	110.60	392,630.00
PACCAR INC	20,706	84.53	1,750,278.18
PARKER HANNIFIN CORP	5,265	367.52	1,934,992.80
PENTAIR PLC	6,918	57.38	396,954.84
QUANTA SERVICES INC	5,710	168.23	960,593.30
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,618	263.32	1,216,011.76
RTX CORP	58,756	78.41	4,607,057.96
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,420	34.44	221,104.80
SMITH (A.O.) CORP	5,020	65.19	327,253.80
SNAP-ON INC	1,975	250.20	494,145.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,806	77.25	448,513.50
TEXTRON INC	7,956	74.36	591,608.16
TORO CO	3,890	80.35	312,561.50
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,066	184.42	1,671,951.72
TRANSDIGM GROUP INC	2,180	818.28	1,783,850.40
UNITED RENTALS INC	2,805	399.15	1,119,615.75
WABTEC CORP	7,130	104.06	741,947.80
WATSCO INC	1,240	340.51	422,232.40
WW GRAINGER INC	1,847	677.41	1,251,176.27
XYLEM INC	9,468	87.76	830,911.68
AUTOMATIC DATA PROCESSING	16,521	218.33	3,607,029.93
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,070	119.41	605,408.70
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,400	169.99	747,956.00
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,280	65.16	344,044.80
CINTAS CORP	3,592	501.51	1,801,423.92
CLARIVATE PLC	14,250	6.49	92,482.50
COPART INC	35,140	43.63	1,533,158.20
EQUIFAX INC	5,024	164.17	824,790.08
JACOBS SOLUTIONS INC	4,880	132.80	648,064.00
LEIDOS HOLDINGS INC	4,960	91.32	452,947.20
PAYCHEX INC	13,072	112.19	1,466,547.68
PAYCOM SOFTWARE INC	1,945	248.08	482,515.60
PAYLOCITY HOLDING CORP	1,730	177.59	307,230.70

REPUBLIC SERVICES INC	8,920	147.58	1,316,413.60
ROBERT HALF INC	4,415	73.56	324,767.40
ROLLINS INC	8,265	34.33	283,737.45
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	49.36	418,079.20
TRANSUNION	7,940	46.23	367,066.20
VERALTO CORP	9,343	70.79	661,390.97
VERISK ANALYTICS INC	5,810	228.13	1,325,435.30
WASTE CONNECTIONS INC	10,606	137.41	1,457,370.46
WASTE MANAGEMENT INC	16,514	164.07	2,709,451.98
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,930	82.73	407,858.90
CSX CORP	81,669	29.60	2,417,402.40
DELTA AIR LINES INC	5,705	31.41	179,194.05
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,467	108.88	704,126.96
FEDEX CORP	9,448	235.21	2,222,264.08
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	77,000	3.20	246,400.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,140	170.04	533,925.60
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,140	49.45	303,623.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,915	185.79	1,656,317.85
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,955	371.01	1,467,344.55
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	23.60	129,092.00
U-HAUL HOLDING CO	3,375	48.73	164,463.75
UBER TECHNOLOGIES INC	72,550	42.35	3,072,492.50
UNION PACIFIC CORP	24,426	205.22	5,012,703.72
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	29,147	146.93	4,282,568.71
APTIV PLC	11,080	89.37	990,219.60
BORGWARNER INC	9,120	38.13	347,745.60
FORD MOTOR COMPANY	159,205	11.54	1,837,225.70
GENERAL MOTORS CORP	52,765	29.01	1,530,712.65
LEAR CORP	2,290	129.68	296,967.20
LUCID GROUP INC	36,360	4.17	151,621.20
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	27,210	17.02	463,114.20
TESLA INC	114,285	212.42	24,276,419.70
DECKERS OUTDOOR CORP	990	492.40	487,476.00
DR HORTON INC	12,896	100.66	1,298,111.36
GARMIN LTD	5,865	101.74	596,705.10
HASBRO INC	5,188	54.75	284,043.00

LENNAR CORP-CL A	10,040	103.07	1,034,822.80
LULULEMON ATHLETICA INC	4,710	396.70	1,868,457.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,878	78.21	146,878.38
NIKE INC -CL B	49,228	103.54	5,097,067.12
NVR INC	148	5,377.29	795,838.92
PULTE GROUP INC	8,850	71.02	628,527.00
VF CORP	12,170	17.95	218,451.50
WHIRLPOOL CORP	2,079	125.61	261,143.19
AIRBNB INC-CLASS A	16,340	118.50	1,936,290.00
ARAMARK	8,880	26.31	233,632.80
BOOKING HOLDINGS INC	1,498	2,812.92	4,213,754.16
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,970	38.54	307,163.80
CARNIVAL CORP	38,787	11.27	437,129.49
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,065	1,841.87	1,961,591.55
DARDEN RESTAURANTS INC	4,853	142.20	690,096.60
DOMINO'S PIZZA INC	1,375	349.91	481,126.25
DOORDASH INC - A	10,020	72.28	724,245.60
DRAFTKINGS INC-CL A	15,800	27.35	432,130.00
EXPEDIA GROUP INC	6,032	95.97	578,891.04
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,650	150.75	1,605,487.50
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,680	101.36	170,284.80
LAS VEGAS SANDS CORP	14,390	47.20	679,208.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,673	188.43	2,011,113.39
MCDONALD'S CORP	29,251	258.03	7,547,635.53
MGM RESORTS INTERNATIONAL	12,900	34.63	446,727.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,358	82.22	769,414.76
STARBUCKS CORP	46,124	94.00	4,335,656.00
VAIL RESORTS INC	1,520	209.81	318,911.20
WYNN RESORTS LTD	4,180	88.94	371,769.20
YUM! BRANDS INC	11,394	120.31	1,370,812.14
ALPHABET INC-CL A	238,020	125.61	29,897,692.20
ALPHABET INC-CL C	211,550	126.67	26,797,038.50
CHARTER COMMUNICATION-A	3,926	423.73	1,663,563.98
COMCAST CORP-CLASS A	166,584	42.75	7,121,466.00
ELECTRONIC ARTS INC	10,834	125.72	1,362,050.48
FOX CORP - CLASS A	13,084	30.25	395,791.00

FOX CORP- CLASS B	5,466	27.83	152,118.78
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,096	27.69	418,008.24
LIBERTY BROADBAND-C	4,850	87.23	423,065.50
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	7,780	65.32	508,189.60
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW C	5,726	24.45	140,000.70
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,420	77.70	498,834.00
MATCH GROUP INC	10,912	34.94	381,265.28
META PLATFORMS INC-CLASS A	88,560	299.53	26,526,376.80
NETFLIX INC	17,800	411.25	7,320,250.00
NEWS CORP - CLASS A	14,750	20.55	303,112.50
OMNICOM GROUP	7,477	74.39	556,214.03
PARAMOUNT GLOBAL	22,823	10.94	249,683.62
PINTEREST INC- CLASS A	22,100	25.56	564,876.00
ROBLOX CORP -CLASS A	19,130	31.10	594,943.00
ROKU INC	4,700	58.50	274,950.00
SEA LTD-ADR	14,470	43.97	636,245.90
SIRIUS XM HOLDINGS INC	30,280	4.36	132,020.80
SNAP INC - A	45,300	9.19	416,307.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	7,240	137.07	992,386.80
THE WALT DISNEY CO.	73,422	80.59	5,917,078.98
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	17,500	71.67	1,254,225.00
WARNER BROS DISCOVERY INC	94,890	9.73	923,279.70
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	9,840	15.72	154,684.80
AMAZON.COM INC	369,750	121.39	44,883,952.50
AUTOZONE INC	722	2,436.12	1,758,878.64
BATH & BODY WORKS INC	9,270	28.12	260,672.40
BEST BUY CO INC	7,814	67.59	528,148.26
BURLINGTON STORES INC	2,585	120.09	310,432.65
CARMAX INC	5,949	60.53	360,092.97
CHEWY INC - CLASS A	4,860	16.87	81,988.20
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,270	107.24	243,434.80
EBAY INC	21,897	39.30	860,552.10
ETSY INC	4,800	62.96	302,208.00
GENUINE PARTS CO	5,751	128.43	738,600.93
GLOBAL-E ONLINE LTD	3,050	33.58	102,419.00
HOME DEPOT INC	40,105	280.93	11,266,697.65

LKQ CORP	10,260	46.92	481,399.20
LOWE'S COS INC	23,492	186.09	4,371,626.28
MERCADOLIBRE INC	1,790	1,190.98	2,131,854.20
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,420	874.92	2,117,306.40
POOL CORP	1,540	319.07	491,367.80
ROSS STORES INC	13,762	115.54	1,590,061.48
TJX COMPANIES INC	45,856	88.95	4,078,891.20
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,530	198.07	897,257.10
ULTA BEAUTY INC	2,100	377.98	793,758.00
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	10,260	21.82	223,873.20
COSTCO WHOLESALE CORP	17,664	549.99	9,715,023.36
DOLLAR GENERAL CORP	8,725	119.47	1,042,375.75
DOLLAR TREE INC	8,986	108.30	973,183.80
KROGER CO	26,880	44.29	1,190,515.20
SYSCO CORP	19,996	65.74	1,314,537.04
TARGET CORP	17,980	110.36	1,984,272.80
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	30,782	21.67	667,045.94
WALMART INC	59,162	162.76	9,629,207.12
ALTRIA GROUP INC	71,048	42.82	3,042,275.36
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,143	71.05	1,573,260.15
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,770	55.97	714,736.90
BUNGE LTD	5,847	102.18	597,446.46
CAMPBELL SOUP CO	7,885	40.90	322,496.50
COCA-COLA CO/THE	164,852	56.12	9,251,494.24
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	7,710	58.78	453,193.80
CONAGRA BRANDS INC	20,640	27.75	572,760.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,560	234.02	1,535,171.20
DARLING INGREDIENTS INC	5,880	40.59	238,669.20
GENERAL MILLS INC	23,059	65.65	1,513,823.35
HERSHEY CO/THE	5,945	194.47	1,156,124.15
HORMEL FOODS CORP	11,500	32.12	369,380.00
JM SMUCKER CO/THE	4,100	114.50	469,450.00
KELLANOVA	11,098	50.96	565,554.08
KEURIG DR PEPPER INC	39,700	29.10	1,155,270.00
KRAFT HEINZ CO/THE	32,911	32.08	1,055,784.88
LAMB WESTON HOLDING INC	6,150	88.81	546,181.50

MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,420	64.38	670,839.60
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,570	57.68	436,637.60
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	54,225	65.68	3,561,769.12
MONSTER BEVERAGE CORP	31,880	50.08	1,596,550.40
PEPSICO INC	55,211	162.35	8,963,505.85
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	62,368	90.03	5,614,991.04
TYSON FOODS INC-CL A	10,906	45.37	494,805.22
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,310	92.24	950,994.40
CLOROX COMPANY	5,266	121.97	642,294.02
COLGATE-PALMOLIVE CO	30,440	73.41	2,234,600.40
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,200	134.55	1,237,860.00
KENVUE INC	60,000	19.73	1,183,800.00
KIMBERLY-CLARK CORP	13,663	118.78	1,622,891.14
PROCTER & GAMBLE CO	94,409	150.60	14,217,995.40
ABBOTT LABORATORIES	69,536	93.57	6,506,483.52
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,060	253.69	776,291.40
BAXTER INTERNATIONAL INC	19,439	32.16	625,158.24
BECTON DICKINSON AND CO	11,387	255.57	2,910,175.59
BOSTON SCIENTIFIC CORP	57,708	49.99	2,884,822.92
CARDINAL HEALTH INC	10,305	93.53	963,826.65
CENCORA INC	7,014	189.12	1,326,487.68
CENTENE CORP	22,367	68.71	1,536,836.57
CIGNA GROUP/THE	11,760	303.89	3,573,746.40
COOPER COS INC/THE	2,025	315.22	638,320.50
CVS HEALTH CORP	51,648	68.53	3,539,437.44
DAVITA INC	2,108	78.60	165,688.80
DENTSPLY SIRONA INC	8,222	31.81	261,541.82
DEXCOM INC	15,500	84.35	1,307,425.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	24,120	68.34	1,648,360.80
ELEVANCE HEALTH INC	9,436	450.07	4,246,860.52
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	16,705	64.51	1,077,639.55
HCA HEALTHCARE INC	8,190	225.36	1,845,698.40
HENRY SCHEIN INC	5,280	67.77	357,825.60
HOLOGIC INC	9,858	66.62	656,739.96
HUMANA INC	5,055	522.77	2,642,602.35
IDEXX LABORATORIES INC	3,360	412.68	1,386,604.80

INSULET CORP	2,745	139.64	383,311.80
INTUITIVE SURGICAL INC	14,035	266.61	3,741,871.35
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,415	197.69	675,111.35
MCKESSON CORP	5,439	453.00	2,463,867.00
MEDTRONIC PLC	53,528	71.40	3,821,899.20
MOLINA HEALTHCARE INC	2,655	336.45	893,274.75
QUEST DIAGNOSTICS	4,386	125.47	550,311.42
RESMED INC	5,830	140.50	819,115.00
STERIS PLC	4,240	213.00	903,120.00
STRYKER CORP	13,693	259.06	3,547,308.58
TELEFLEX INC	1,820	185.37	337,373.40
UNITEDHEALTH GROUP INC	37,185	530.21	19,715,858.85
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,920	122.21	234,643.20
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	5,790	194.78	1,127,776.20
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,412	103.64	871,819.68
ABBVIE INC	70,306	145.26	10,212,649.56
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,750	103.40	1,318,350.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,040	159.49	803,829.60
AMGEN INC	21,231	272.16	5,778,228.96
AVANTOR INC	27,110	19.35	524,578.50
BIO-RAD LABORATORIES-A	950	290.07	275,566.50
BIO-TECHNE CORP	6,730	61.28	412,414.40
BIOGEN INC	5,643	246.72	1,392,240.96
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,380	81.77	685,232.60
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	83,555	56.61	4,730,048.55
CATALENT INC	6,520	39.43	257,083.60
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,910	172.69	329,837.90
DANAHER CORP	28,029	192.65	5,399,786.85
ELI LILLY & CO	32,269	586.46	18,924,477.74
EXACT SCIENCES CORP	7,370	61.81	455,539.70
GILEAD SCIENCES INC	49,954	78.39	3,915,894.06
ILLUMINA INC	6,275	113.93	714,910.75
INCYTE CORP	7,670	54.25	416,097.50
IQVIA HOLDINGS INC	7,438	181.22	1,347,914.36
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,450	130.12	318,794.00
JOHNSON & JOHNSON	96,501	151.57	14,626,656.57

MERCK & CO. INC.	101,193	103.63	10,486,630.59
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	890	975.26	867,981.40
MODERNA INC	12,875	76.76	988,285.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,630	108.23	392,874.90
PFIZER INC	226,080	30.73	6,947,438.40
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,310	797.04	3,435,242.40
REPLIGEN CORP	2,250	124.42	279,945.00
REVVITY INC	4,910	99.69	489,477.90
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	14,330	27.30	391,209.00
SEAGEN INC	5,620	216.64	1,217,516.80
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43,590	8.21	357,873.90
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	15,414	433.18	6,677,036.52
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,900	224.50	426,550.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10,330	363.04	3,750,203.20
VIATRIS INC	45,819	8.97	410,996.43
WATERS CORP	2,331	242.30	564,801.30
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,960	358.00	1,059,680.00
ZOETIS INC	18,525	163.67	3,031,986.75
BANK OF AMERICA CORP	287,899	25.55	7,355,819.45
CITIGROUP INC	78,467	38.61	3,029,610.87
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,310	23.47	453,205.70
FIFTH THIRD BANCORP	26,459	23.03	609,350.77
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	450	1,301.67	585,751.50
FIRST HORIZON CORP	19,800	10.39	205,722.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,720	9.47	508,728.40
JPMORGAN CHASE & CO	116,880	140.40	16,409,952.00
KEYCORP	36,108	9.81	354,219.48
M & T BANK CORP	6,913	111.66	771,905.58
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	16,200	111.29	1,802,898.00
REGIONS FINANCIAL CORP	35,844	14.06	503,966.64
TRUIST FINANCIAL CORP	53,220	27.96	1,488,031.20
US BANCORP	59,781	31.29	1,870,547.49
WEBSTER FINANCIAL CORP	6,370	36.96	235,435.20
WELLS FARGO & CO	148,260	39.03	5,786,587.80
ALLY FINANCIAL INC	12,240	23.44	286,905.60
AMERICAN EXPRESS CO	25,314	143.52	3,633,065.28

AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,225	307.14	1,297,666.50
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,800	81.40	1,286,120.00
ARES MANAGEMENT CORP-A	7,150	101.27	724,080.50
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	30,612	41.85	1,281,112.20
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	51,825	336.90	17,459,842.50
BLACKROCK INC	6,025	608.68	3,667,297.00
BLACKSTONE INC	28,460	91.91	2,615,758.60
BLOCK INC	21,450	41.72	894,894.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15,435	88.97	1,373,251.95
CARLYLE GROUP INC/THE	7,650	27.56	210,834.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,940	162.42	639,934.80
CME GROUP INC	14,510	214.08	3,106,300.80
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	6,900	77.79	536,751.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,750	80.60	866,450.00
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,420	26.18	377,515.60
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,590	424.18	674,446.20
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	24,198	48.85	1,182,072.30
FISERV INC	24,884	114.12	2,839,762.08
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,880	230.89	664,963.20
FRANKLIN RESOURCES INC	11,755	22.26	261,666.30
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	56.06	140,150.00
GLOBAL PAYMENTS INC	10,989	105.61	1,160,548.29
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,378	296.76	3,970,055.28
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	22,740	106.73	2,427,040.20
INVESCO LTD	13,527	12.59	170,304.93
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,200	141.96	454,272.00
KKR & CO INC -A	24,780	54.88	1,359,926.40
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,185	216.21	688,628.85
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,545	214.08	330,753.60
MASTERCARD INC - A	33,865	386.31	13,082,388.15
MOODY'S CORP	6,502	314.26	2,043,318.52
MORGAN STANLEY	50,403	71.40	3,598,774.20
MSCI INC	3,175	479.63	1,522,825.25
NASDAQ INC	11,725	49.49	580,270.25
NORTHERN TRUST CORP	7,690	63.06	484,931.40
PAYPAL HOLDINGS INC	42,267	51.49	2,176,327.83

RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,470	91.83	777,800.10
ROBINHOOD MARKETS INC - A	17,810	9.03	160,824.30
S&P GLOBAL INC	13,185	349.13	4,603,279.05
SCHWAB (CHARLES) CORP	60,543	49.37	2,989,007.91
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,375	54.40	238,000.00
STATE STREET CORP	12,947	64.02	828,866.94
SYNCHRONY FINANCIAL	19,010	27.70	526,577.00
T ROWE PRICE GROUP INC	8,675	93.47	810,852.25
TOAST INC-CLASS A	12,760	16.56	211,305.60
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,200	83.39	350,238.00
VISA INC-CLASS A SHARES	64,762	236.85	15,338,879.70
AFLAC INC	23,424	78.26	1,833,162.24
ALLSTATE CORP	10,513	125.19	1,316,122.47
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,660	108.46	288,503.60
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	30,345	60.96	1,849,831.20
AON PLC	8,077	319.65	2,581,813.05
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,535	83.49	1,213,527.15
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,610	231.10	1,989,771.00
ASSURANT INC	1,960	149.00	292,040.00
BROWN & BROWN INC	9,090	69.02	627,391.80
CHUBB LTD	16,685	215.65	3,598,120.25
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,880	98.39	578,533.20
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	940	294.34	276,679.60
EVEREST GROUP LTD	1,469	396.69	582,737.61
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	11,071	37.37	413,723.27
GLOBE LIFE INC	3,586	112.03	401,739.58
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,382	71.89	890,141.98
LOEWS CORP	7,145	63.80	455,851.00
MARKEL GROUP INC	530	1,461.62	774,658.60
MARSH & MCLENNAN COS	19,918	188.88	3,762,111.84
METLIFE INC	26,335	58.96	1,552,711.60
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,520	66.88	636,697.60
PROGRESSIVE CORP	23,340	156.43	3,651,076.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,962	89.31	1,336,256.22
TRAVELERS COS INC/THE	8,889	164.73	1,464,284.97
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,198	207.74	872,092.52

WR BERKLEY CORP	8,091	67.06	542,582.46
ACCENTURE PLC-CL A	25,308	292.68	7,407,145.44
ADOBE INC	18,194	521.14	9,481,621.16
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,030	102.60	618,678.00
ANSYS INC	3,515	270.74	951,651.10
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,300	176.87	229,931.00
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	6,020	178.59	1,075,111.80
AUTODESK INC	8,720	200.21	1,745,831.20
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,530	48.90	368,217.00
BILL HOLDINGS INC	3,910	92.35	361,088.50
CADENCE DESIGN SYS INC	10,570	231.03	2,441,987.10
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,840	133.60	513,024.00
CLOUDFLARE INC-CLASS A	10,740	56.49	606,702.60
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	20,318	64.09	1,302,180.62
CONFLUENT INC-CLASS A	6,870	26.62	182,879.40
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	8,990	175.38	1,576,666.20
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,650	158.68	261,822.00
DATADOG INC-CLASS A	9,910	81.59	808,556.90
DOCUSIGN INC	8,320	39.39	327,724.80
DROPBOX INC-CLASS A	11,660	26.31	306,774.60
DYNATRACE INC	9,850	44.58	439,113.00
EPAM SYSTEMS INC	2,280	214.54	489,151.20
FAIR ISAAC CORP	970	825.10	800,347.00
FORTINET INC	26,965	55.94	1,508,422.10
GARTNER INC	3,050	331.66	1,011,563.00
GEN DIGITAL INC	24,365	16.50	402,022.50
GODADDY INC-CLASS A	6,020	72.88	438,737.60
HUBSPOT INC	1,885	411.69	776,035.65
INTL BUSINESS MACHINES CORP	36,342	137.08	4,981,761.36
INTUIT INC	11,241	483.03	5,429,740.23
MANHATTAN ASSOCIATES INC	2,350	193.06	453,691.00
MICROSOFT CORP	282,814	340.67	96,346,245.38
MONDAY.COM LTD	980	128.66	126,086.80
MONGODB INC	2,820	329.33	928,710.60
OKTA INC	6,340	67.42	427,442.80
ORACLE CORP	65,133	101.43	6,606,440.19

PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	72,800	15.59	1,134,952.00
PALO ALTO NETWORKS INC	12,205	244.79	2,987,661.95
PTC INC	4,160	137.97	573,955.20
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,200	481.21	2,021,082.00
SALESFORCE INC	39,026	197.06	7,690,463.56
SERVICENOW INC	8,125	530.17	4,307,631.25
SNOWFLAKE INC-CLASS A	10,490	142.40	1,493,776.00
SPLUNK INC	6,120	147.49	902,638.80
SYNOPSYS INC	6,082	455.26	2,768,891.32
TWILIO INC - A	7,225	51.21	369,992.25
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,830	366.64	670,951.20
UIPATH INC - CLASS A	17,970	15.14	272,065.80
UNITY SOFTWARE INC	9,650	25.69	247,908.50
VERISIGN INC	3,690	206.47	761,874.30
VMWARE INC-CLASS A	9,517	148.26	1,410,990.42
WIX.COM LTD	2,280	81.76	186,412.80
WORKDAY INC-CLASS A	7,990	207.21	1,655,607.90
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	9,630	60.35	581,170.50
ZSCALER INC	3,630	157.61	572,124.30
AMPHENOL CORP-CL A	23,350	79.66	1,860,061.00
APPLE INC	629,794	171.10	107,757,753.40
ARISTA NETWORKS INC	10,420	186.09	1,939,057.80
ARROW ELECTRONICS INC	2,520	109.86	276,847.20
CDW CORP/DE	5,895	198.70	1,171,336.50
CISCO SYSTEMS INC	162,490	52.40	8,514,476.00
COGNEX CORP	6,480	34.99	226,735.20
CORNING INC	33,518	26.78	897,612.04
DELL TECHNOLOGIES -C	11,022	66.34	731,199.48
F5 INC	2,385	151.68	361,756.80
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	50,105	15.14	758,589.70
HP INC	34,495	26.03	897,904.85
JABIL INC	4,990	121.78	607,682.20
JUNIPER NETWORKS INC	13,453	25.03	336,728.59
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,160	120.47	862,565.20
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,610	280.51	1,854,171.10
NETAPP INC	8,246	72.48	597,670.08

SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,794	67.10	522,977.40
SUPER MICRO COMPUTER INC	1,790	253.99	454,642.10
TE CONNECTIVITY LTD	12,995	116.48	1,513,657.60
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,020	373.28	754,025.60
TRIMBLE INC	9,520	47.24	449,724.80
WESTERN DIGITAL CORP	11,688	42.18	492,999.84
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,075	198.91	412,738.25
AT&T INC	287,257	15.19	4,363,433.83
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	10,361	16.72	173,235.92
T-MOBILE US INC	21,939	140.99	3,093,179.61
VERIZON COMMUNICATIONS INC	168,177	33.69	5,665,883.13
AES CORP	27,958	14.68	410,423.44
ALLIANT ENERGY CORP	12,150	49.54	601,911.00
AMEREN CORPORATION	10,152	76.85	780,181.20
AMERICAN ELECTRIC POWER	20,348	75.36	1,533,425.28
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,705	116.50	897,632.50
ATMOS ENERGY CORP	5,310	108.35	575,338.50
CENTERPOINT ENERGY INC	23,972	27.46	658,271.12
CMS ENERGY CORP	11,090	54.45	603,850.50
CONSOLIDATED EDISON INC	14,236	88.31	1,257,181.16
CONSTELLATION ENERGY	13,168	112.03	1,475,211.04
DOMINION ENERGY INC	33,331	40.54	1,351,238.74
DTE ENERGY COMPANY	8,318	97.94	814,664.92
DUKE ENERGY CORP	30,796	88.15	2,714,667.40
EDISON INTERNATIONAL	16,329	63.30	1,033,625.70
ENTERGY CORP	7,967	92.56	737,425.52
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,210	33.02	370,154.20
EVERGY INC	8,720	48.90	426,408.00
EVERSOURCE ENERGY	14,310	54.22	775,888.20
EXELON CORP	39,706	39.00	1,548,534.00
FIRSTENERGY CORP	23,295	35.76	833,029.20
NEXTERA ENERGY INC	80,990	56.46	4,572,695.40
NISOURCE INC	15,610	25.31	395,089.10
NRG ENERGY INC	8,760	41.83	366,430.80
P G & E CORP	73,270	16.17	1,184,775.90
PPL CORP	30,338	24.38	739,640.44

PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	19,888	60.59	1,205,013.92
SEMPRA	24,864	70.17	1,744,706.88
SOUTHERN CO	43,485	66.61	2,896,535.85
VISTRA CORP	14,720	32.78	482,521.60
WEC ENERGY GROUP INC	12,220	82.32	1,005,950.40
XCEL ENERGY INC	22,174	59.47	1,318,687.78
ADVANCED MICRO DEVICES	64,304	96.05	6,176,720.72
ANALOG DEVICES INC	20,097	159.79	3,211,299.63
APPLIED MATERIALS INC	33,733	130.11	4,389,000.63
BROADCOM INC	16,530	849.63	14,044,383.90
ENPHASE ENERGY INC	5,440	94.35	513,264.00
ENTEGRIS INC	5,660	86.67	490,552.20
FIRST SOLAR INC	4,260	151.36	644,793.60
INTEL CORP	167,432	32.83	5,496,792.56
KLA CORP	5,489	454.84	2,496,616.76
LAM RESEARCH CORP	5,402	583.34	3,151,202.68
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	5,150	68.84	354,526.00
MARVELL TECHNOLOGY INC	33,614	47.55	1,598,345.70
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,028	71.38	1,572,358.64
MICRON TECHNOLOGY INC	44,157	66.50	2,936,440.50
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,820	399.73	727,508.60
NVIDIA CORP	98,880	417.79	41,311,075.20
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,447	175.94	1,838,045.18
ON SEMICONDUCTOR CORP	17,340	81.16	1,407,314.40
QORVO INC	4,240	86.20	365,488.00
QUALCOMM INC	44,802	104.78	4,694,353.56
SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,440	88.57	570,390.80
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	2,310	81.04	187,202.40
TERADYNE INC	6,190	87.91	544,162.90
TEXAS INSTRUMENTS INC	36,472	141.79	5,171,364.88
WOLFSPEED INC	5,080	30.58	155,346.40
CBRE GROUP INC - A	12,560	65.76	825,945.60
COSTAR GROUP INC	16,800	70.91	1,191,288.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,500	3.10	125,550.00
ZILLOW GROUP INC - C	6,370	38.19	243,270.30
米ドル小計	13,671,030		1,449,589,381.61

				(217,844,292,268)
加ドル	ARC RESOURCES LTD	25,510	22.12	564,281.20
	CAMECO CORP	16,352	54.16	885,624.32
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	44,054	88.68	3,906,708.72
	CENOVUS ENERGY INC	57,213	27.33	1,563,631.29
	ENBRIDGE INC	81,027	44.53	3,608,132.31
	IMPERIAL OIL LTD	8,922	80.85	721,343.70
	KEYERA CORP	8,460	32.31	273,342.60
	PARKLAND CORP	6,170	41.29	254,759.30
	PEMBINA PIPELINE CORP	23,552	42.23	994,600.96
	SUNCOR ENERGY INC	53,489	45.80	2,449,796.20
	TC ENERGY CORP	41,663	47.39	1,974,409.57
	TOURMALINE OIL CORP	12,040	71.66	862,786.40
	AGNICO EAGLE MINES LTD	21,496	67.37	1,448,185.52
	BARRICK GOLD CORP	69,624	22.87	1,592,300.88
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	55.08	316,710.00
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	28.72	650,508.00
	FRANCO-NEVADA CORP	8,125	189.64	1,540,825.00
	IVANHOE MINES LTD-CL A	24,510	10.28	251,962.80
	KINROSS GOLD CORP	46,025	7.34	337,823.50
	LUNDIN MINING CORP	25,010	8.63	215,836.30
	NUTRIEN LTD	20,908	77.33	1,616,815.64
	PAN AMERICAN SILVER CORP	12,860	20.69	266,073.40
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,975	48.50	871,787.50
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,450	89.18	218,491.00
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,165	59.94	1,148,750.10
	CAE INC	12,305	28.53	351,061.65
	STANTEC INC	4,100	83.87	343,867.00
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,260	103.75	338,225.00
	WSP GLOBAL INC	4,590	179.32	823,078.80
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,410	40.61	300,920.10
	RB GLOBAL INC	7,560	86.72	655,603.20
	THOMSON REUTERS CORP	6,310	167.91	1,059,512.10
	AIR CANADA	7,190	16.18	116,334.20
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	22,438	146.57	3,288,737.66
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	37,551	96.20	3,612,406.20

TFI INTERNATIONAL INC	3,210	150.00	481,500.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,668	68.86	734,598.48
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,570	94.18	147,862.60
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,040	39.12	275,404.80
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,998	92.83	1,020,944.34
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,250	136.24	306,540.00
DOLLARAMA INC	12,990	96.06	1,247,819.40
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	30,860	73.81	2,277,776.60
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	38.02	264,239.00
LOBLAW COMPANIES LTD	6,339	111.54	707,052.06
METRO INC	9,570	70.22	672,005.40
WESTON (GEORGE) LTD	2,808	146.71	411,961.68
SAPUTO INC	9,620	26.97	259,451.40
BANK OF MONTREAL	27,631	104.77	2,894,899.87
BANK OF NOVA SCOTIA	47,539	55.97	2,660,757.83
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	37,740	48.19	1,818,690.60
NATIONAL BANK OF CANADA	13,750	85.24	1,172,050.00
ROYAL BANK OF CANADA	54,929	109.11	5,993,303.19
TORONTO-DOMINION BANK	73,180	76.92	5,629,005.60
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	13,859	41.11	569,743.49
BROOKFIELD CORP	57,209	41.11	2,351,861.99
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	13,800	18.87	260,406.00
IGM FINANCIAL INC	3,335	30.70	102,384.50
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,250	19.31	43,447.50
ONEX CORPORATION	2,765	76.00	210,140.00
TMX GROUP LTD	10,850	29.29	317,796.50
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	1,122.93	1,010,637.00
GREAT-WEST LIFECO INC	11,324	37.70	426,914.80
IA FINANCIAL CORP INC	4,075	79.28	323,066.00
INTACT FINANCIAL CORP	7,215	193.96	1,399,421.40
MANULIFE FINANCIAL CORP	71,921	23.88	1,717,473.48
POWER CORP OF CANADA	20,479	32.58	667,205.82
SUN LIFE FINANCIAL INC	24,774	62.74	1,554,320.76
CGI INC	8,030	132.09	1,060,682.70
CONSTELLATION SOFTWARE INC	810	2,781.31	2,252,861.10
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,740	98.32	367,716.80

	OPEN TEXT CORP	11,190	45.67	511,047.30	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	47,780	66.90	3,196,482.00	
	BCE INC	3,000	51.22	153,660.00	
	QUEBECOR INC -CL B	6,110	27.56	168,391.60	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	13,875	52.00	721,500.00	
	TELUS CORP	12,662	22.28	282,109.36	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	6.94	187,935.20	
	ALTAGAS LTD	11,170	25.20	281,484.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	33.02	179,793.90	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	28.83	131,464.80	
	EMERA INC	10,460	45.76	478,649.60	
	FORTIS INC	19,055	54.48	1,038,116.40	
	HYDRO ONE LTD	13,230	35.07	463,976.10	
	NORTHLAND POWER INC	8,600	20.86	179,396.00	
	FIRSTSERVICE CORP	1,500	190.12	285,180.00	
加ドル小計		1,610,409		91,296,361.07 (9,935,782,975)	
ユーロ	ENI SPA	89,476	15.42	1,379,719.92	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	18,755	14.35	269,228.02	
	NESTE OYJ	16,380	29.22	478,623.60	
	OMV AG	5,480	40.84	223,803.20	
	REPSOL SA	54,849	14.45	792,568.05	
	TENARIS SA	17,895	15.34	274,509.30	
	TOTALENERGIES SE	90,417	62.20	5,623,937.40	
	AIR LIQUIDE SA	20,889	156.74	3,274,141.86	
	AKZO NOBEL	6,937	61.42	426,070.54	
	ARCELORMITTAL	20,552	20.90	429,536.80	
	ARKEMA	2,215	83.60	185,174.00	
	BASF SE	37,045	40.58	1,503,471.32	
	COVESTRO AG	7,410	48.75	361,237.50	
	DSM-FIRMENICH AG	7,552	76.28	576,066.56	
	EVONIK INDUSTRIES AG	8,230	15.97	131,433.10	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	5,715	67.84	387,705.60	
	OCI NV	4,810	22.36	107,551.60	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,050	29.85	270,142.50	
	SOLVAY SA	2,811	95.98	269,799.78	

STORA ENSO OYJ-R SHS	25,365	11.00	279,015.00
SYMRISE AG	5,790	94.12	544,954.80
UMICORE	7,960	22.23	176,950.80
UPM-KYMMENE OYJ	21,098	31.89	672,815.22
VOESTALPINE AG	4,249	22.90	97,302.10
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,876	32.51	256,048.76
AIRBUS GROUP SE	23,598	125.04	2,950,693.92
ALSTOM	11,635	11.92	138,689.20
BOUYGUES SA	8,460	31.27	264,544.20
BRENTAG SE	6,865	68.22	468,330.30
CNH INDUSTRIAL NV	39,510	10.58	418,015.80
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	19,106	49.90	953,484.93
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	18,186	29.96	544,852.56
DASSAULT AVIATION SA	900	189.80	170,820.00
EIFFAGE	3,250	82.70	268,775.00
FERROVIAL SE	17,825	27.61	492,148.25
GEA GROUP AG	6,020	32.17	193,663.40
IMCD NV	2,120	111.65	236,698.00
KINGSPAN GROUP PLC	5,900	62.04	366,036.00
KNORR-BREMSE AG	2,970	53.82	159,845.40
KONE OYJ-B	13,614	39.50	537,753.00
LEGRAND SA	11,128	81.02	901,590.56
METSO CORPORATION	24,200	8.85	214,363.60
MTU AERO ENGINES AG	2,020	178.40	360,368.00
PRYSMIAN SPA	9,565	33.84	323,679.60
RATIONAL AG	230	544.00	125,120.00
RHEINMETALL AG	1,730	266.70	461,391.00
SAFRAN SA	13,080	148.48	1,942,118.40
SCHNEIDER ELECTRIC SE	21,918	139.98	3,068,081.64
SIEMENS AG-REG	30,576	126.96	3,881,928.96
SIEMENS ENERGY AG	21,343	10.65	227,302.95
THALES SA	4,015	142.05	570,330.75
VINCI SA	20,600	100.76	2,075,656.00
WARTSILA OYJ ABP	18,180	9.67	175,873.32
BUREAU VERITAS SA	10,920	22.62	247,010.40
RANDSTAD NV	4,675	48.76	227,953.00

TELEPERFORMANCE	2,240	108.70	243,488.00
WOLTERS KLUWER	10,027	120.50	1,208,253.50
ADP	1,090	103.30	112,597.00
AENA SA	2,870	135.30	388,311.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	6.75	161,357.16
DEUTSCHE POST AG-REG	39,823	36.78	1,464,689.94
GETLINK	17,310	14.52	251,427.75
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,355	91.38	1,220,379.90
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,210	84.60	186,966.00
CONTINENTAL AG	4,385	59.68	261,696.80
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	4,380	86.52	378,957.60
FERRARI NV	5,019	284.50	1,427,905.50
MERCEDES-BENZ GROUP AG	34,202	61.38	2,099,318.76
MICHELIN (CGDE)	24,706	27.28	673,979.68
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	43.19	244,887.30
RENAULT SA	8,247	32.54	268,398.61
STELLANTIS NV	90,796	17.77	1,614,171.28
VALEO SA	7,420	12.28	91,154.70
VOLKSWAGEN AG	1,151	110.10	126,725.10
VOLKSWAGEN AG-PFD	8,073	100.80	813,758.40
ADIDAS AG	6,571	171.50	1,126,926.50
HERMES INTERNATIONAL	1,272	1,776.40	2,259,580.80
KERING	3,007	393.30	1,182,653.10
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	11,084	679.10	7,527,144.40
MONCLER SPA	8,080	53.28	430,502.40
PUMA SE	4,200	54.92	230,664.00
SEB SA	987	86.70	85,572.90
ACCOR SA	6,056	30.09	182,225.04
AMADEUS IT GROUP SA	18,350	54.04	991,634.00
DELIVERY HERO SE	6,600	23.61	155,859.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,816	148.50	1,012,176.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	30.42	118,638.00
SODEXO	3,240	97.30	315,252.00
BOLLORE SE	33,530	5.14	172,511.85
PUBLICIS GROUPE	9,305	72.76	677,031.80
SCOUT24 SE	2,970	58.34	173,269.80

UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	31,460	25.48	801,600.80
VIVENDI SE	26,070	8.41	219,352.98
D' IETEREN GROUP	1,050	138.00	144,900.00
INDITEX	43,905	34.10	1,497,160.50
PROSUS NV	62,794	26.37	1,655,877.78
ZALANDO SE	8,260	21.80	180,068.00
CARREFOUR SA	22,633	15.61	353,414.29
HELLOFRESH SE	6,070	24.34	147,743.80
JERONIMO MARTINS	10,585	19.97	211,382.45
KESKO OYJ-B SHS	10,930	15.14	165,480.20
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	40,028	27.85	1,114,779.80
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	33,221	51.10	1,697,593.10
DANONE	25,794	54.87	1,415,316.78
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,850	11.06	219,541.00
HEINEKEN HOLDING NV	4,895	72.55	355,132.25
HEINEKEN NV	11,343	85.52	970,053.36
JDE PEET' S NV	6,290	26.08	164,043.20
KERRY GROUP PLC-A	6,460	75.42	487,213.20
PERNOD-RICARD SA	8,296	169.70	1,407,831.20
REMY COINTREAU	810	123.65	100,156.50
BEIERSDORF AG	4,375	124.35	544,031.25
HENKEL AG & CO KGAA	4,520	59.50	268,940.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,793	67.98	461,788.14
L' OREAL	9,651	399.20	3,852,679.20
AMPLIFON SPA	4,830	27.29	131,810.70
BIOMERIEUX	1,690	87.68	148,179.20
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	75.38	121,361.80
DIASORIN ITALIA SPA	930	82.78	76,985.40
ESSILORLUXOTTICA	11,505	168.58	1,939,512.90
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,613	31.80	242,093.40
FRESENIUS SE & CO KGAA	15,695	24.98	392,061.10
KONINKLIJKE PHILIPS NV	36,772	17.38	639,391.53
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,640	47.83	508,911.20
ARGENX SE	2,315	446.40	1,033,416.00
BAYER AG-REG	39,064	41.03	1,602,991.24
EUROFINS SCIENTIFIC	5,050	45.74	230,987.00

GRIFOLS SA	12,050	10.05	121,162.75
IPSEN	1,600	119.60	191,360.00
MERCK KGAA	5,150	144.60	744,690.00
ORION OYJ-CLASS B	4,500	36.33	163,485.00
QIAGEN N. V.	10,384	35.04	363,855.36
RECORDATI SPA	3,720	43.97	163,568.40
SANOFI	45,686	101.02	4,615,199.72
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,230	224.50	276,135.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	166.00	179,280.00
UCB SA	4,928	72.08	355,210.24
ABN AMRO BANK NV-CVA	15,170	12.69	192,583.15
AIB GROUP PLC	51,000	4.02	205,020.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	241,763	7.43	1,796,299.09
BANCO SANTANDER SA	662,389	3.46	2,292,528.32
BANK OF IRELAND GROUP PLC	44,790	8.58	384,477.36
BNP PARIBAS	44,242	56.18	2,485,515.56
CAIXABANK S. A	163,050	3.63	592,197.60
COMMERZBANK AG	40,474	10.06	407,370.81
CREDIT AGRICOLE SA	49,662	11.26	559,293.44
ERSTE GROUP BANK AG	13,018	32.74	426,209.32
FINECOBANK SPA	23,540	10.94	257,527.60
ING GROEP NV-CVA	146,925	12.04	1,769,270.85
INTESA SANPAOLO	658,093	2.35	1,550,467.10
KBC GROEP NV	9,719	51.44	499,945.36
MEDIOBANCA SPA	19,520	11.01	214,915.20
SOCIETE GENERALE	30,909	20.90	646,152.64
UNICREDIT SPA	73,256	22.49	1,647,893.72
ADYEN NV	865	646.20	558,963.00
AMUNDI SA	2,140	49.80	106,572.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	80,935	10.27	831,849.93
DEUTSCHE BOERSE AG	7,600	155.80	1,184,080.00
EDENRED	9,626	50.94	490,348.44
EURAZEO SE	1,487	51.25	76,208.75
EURONEXT NV	3,470	65.50	227,285.00
EXOR NV	4,164	81.20	338,116.80
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,452	68.80	237,497.60

NEXI SPA	21,240	5.45	115,927.92
SOFINA	655	174.70	114,428.50
WENDEL	1,000	71.40	71,400.00
WORLDLINE SA	8,950	9.41	84,273.20
AEGON LTD	69,679	4.49	313,137.42
AGEAS	5,924	36.12	213,974.88
ALLIANZ SE-REG	16,233	220.15	3,573,694.95
ASR NEDERLAND NV	5,880	34.50	202,860.00
ASSICURAZIONI GENERALI	42,248	18.38	776,518.24
AXA SA	75,752	27.59	2,089,997.68
HANNOVER RUECK SE-REG	2,275	211.40	480,935.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,626	382.50	2,151,945.00
NN GROUP NV	10,270	29.50	302,965.00
POSTE ITALIANE SPA	19,560	9.10	177,996.00
SAMPO OYJ-A SHS	19,639	37.94	745,103.66
TALANX AG	2,500	60.70	151,750.00
BECHTLE AG	3,070	41.10	126,177.00
CAP GEMINI SA	6,509	165.05	1,074,310.45
DASSAULT SYSTEMES SE	27,400	37.77	1,034,898.00
NEMETSCHEK SE	2,350	68.50	160,975.00
SAP SE	41,962	125.00	5,245,250.00
NOKIA OYJ	213,336	3.05	650,674.80
CELLNEX TELECOM SA	21,660	26.94	583,520.40
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	128,776	20.48	2,637,976.36
ELISA OYJ	6,005	40.20	241,401.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	10.24	155,416.65
KONINKLIJKE KPN NV	122,956	3.15	388,172.09
ORANGE S. A.	72,804	10.87	791,961.91
TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.23	95,722.60
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	46,470	1.58	73,492.30
TELEFONICA SA	195,629	3.57	699,178.04
ACCIONA SA	830	115.80	96,114.00
E. ON SE	90,999	11.10	1,010,088.90
EDP RENOVAVEIS SA	11,156	14.66	163,602.74
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	126,131	3.80	479,550.06
ELIA GROUP SA/NV	1,356	90.55	122,785.80

	ENAGAS SA	8,610	16.12	138,793.20
	ENDESA SA	12,050	17.94	216,237.25
	ENEL SPA	309,737	5.75	1,781,607.22
	ENGIE	71,874	14.85	1,067,616.39
	FORTUM OYJ	16,755	10.96	183,634.80
	IBERDROLA SA	244,512	10.53	2,574,711.36
	NATURGY ENERGY GROUP SA	4,522	26.76	121,008.72
	REDEIA CORP SA	15,580	15.15	236,114.90
	RWE AG	25,835	35.31	912,233.85
	SNAM SPA	91,120	4.39	400,199.04
	TERNA SPA	53,627	7.27	389,868.29
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	25,530	25.41	648,717.30
	VERBUND AG	2,780	82.85	230,323.00
	ASM INTERNATIONAL NV	1,935	383.60	742,266.00
	ASML HOLDING NV	16,172	560.70	9,067,640.40
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	2,870	88.28	253,363.60
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	51,775	28.76	1,489,307.87
	STMICROELECTRONICS NV	27,283	37.12	1,012,881.37
	LEG IMMOBILIEN SE	3,010	54.86	165,128.60
	VONOVIA SE	27,119	20.22	548,346.18
	ユーロ小計	7,196,360		174,073,482.29 (27,625,461,639)
英ポンド	BP PLC	703,648	5.34	3,762,405.85
	SHELL PLC-NEW	270,927	27.18	7,363,795.86
	ANGLO AMERICAN PLC	54,004	20.78	1,122,473.14
	ANTOFAGASTA PLC	14,330	13.46	192,953.45
	CRH PLC	30,060	44.58	1,340,074.80
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,131	41.41	253,884.71
	ENDEAVOUR MINING PLC	6,490	17.17	111,433.30
	GLENORE PLC	417,803	4.39	1,837,497.59
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,339	14.46	106,158.63
	MONDI PLC	18,370	12.74	234,033.80
	RIO TINTO PLC	44,725	51.57	2,306,468.25
	ASHTAD GROUP PLC	17,770	47.13	837,500.10
	BAE SYSTEMS PLC ORD	124,235	10.95	1,360,994.42
	BUNZL PLC	12,896	28.50	367,536.00

DCC PLC	3,820	44.26	169,073.20
MELROSE INDUSTRIES PLC	50,400	4.67	235,468.80
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	353,031	2.03	716,652.93
SMITHS GROUP PLC	13,603	15.58	212,002.75
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,890	80.58	232,876.20
EXPERIAN PLC	37,408	24.26	907,518.08
INTERTEK GROUP PLC	6,025	39.89	240,337.25
RELX PLC	76,445	28.61	2,187,091.45
RENTOKIL INITIAL PLC	115,300	4.54	524,153.80
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	4.01	163,368.64
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,515	39.57	178,658.55
BURBERRY GROUP PLC	15,504	17.20	266,746.32
PERSIMMON PLC	12,440	9.60	119,473.76
TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.06	132,031.76
COMPASS GROUP PLC	72,268	20.46	1,478,603.28
ENTAIN PLC	24,860	9.25	230,104.16
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,473	59.20	442,401.60
PEARSON PLC	26,089	9.22	240,540.58
WHITBREAD PLC	8,110	32.96	267,305.60
AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	6.08	221,944.32
INFORMA PLC	56,580	7.05	399,228.48
WPP PLC	41,144	6.91	284,305.04
JD SPORTS FASHION PLC	97,350	1.26	122,855.70
KINGFISHER PLC	78,137	2.01	157,602.32
NEXT PLC	5,667	68.64	388,982.88
OCADO GROUP PLC	22,670	4.60	104,282.00
SAINSBURY (J) PLC	70,601	2.52	178,126.32
TESCO PLC	288,058	2.72	784,381.93
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,125	19.66	258,103.12
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	84,677	24.63	2,085,594.51
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	21.57	165,873.30
DIAGEO PLC	90,492	31.43	2,844,616.02
IMPERIAL BRANDS PLC	38,792	17.36	673,623.08
HALEON PLC	218,251	3.34	730,158.72
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	28,605	56.78	1,624,191.90
UNILEVER PLC	100,772	40.13	4,044,484.22

	NMC HEALTH PLC	8,090	—	—
	SMITH & NEPHEW PLC	33,906	9.17	311,189.26
	ASTRAZENECA PLC	61,752	105.46	6,512,365.92
	GSK PLC	163,260	14.83	2,421,472.32
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,740	19.63	112,676.20
	BARCLAYS PLC	639,751	1.33	852,276.28
	HSBC HOLDINGS PLC	789,061	6.15	4,853,514.21
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,649,936	0.41	1,098,663.46
	NATWEST GROUP PLC	204,035	2.06	421,536.31
	STANDARD CHARTERED PLC	95,420	7.14	681,298.80
	3I GROUP PLC	40,649	19.96	811,354.04
	ABRDN PLC	88,515	1.52	134,587.05
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	6.92	90,202.56
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	16,267	82.84	1,347,558.28
	M&G PLC	99,522	1.92	191,380.80
	SCHRODERS PLC	30,300	3.61	109,504.20
	ST JAMES' S PLACE PLC	20,540	6.10	125,458.32
	WISE PLC - A	21,400	6.70	143,380.00
	ADMIRAL GROUP PLC	6,795	24.74	168,108.30
	AVIVA PLC	94,524	3.95	373,653.37
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	225,651	2.06	466,420.61
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,230	4.44	134,463.04
	PRUDENTIAL PLC	110,702	8.32	921,704.85
	SAGE GROUP PLC/THE	38,840	9.64	374,728.32
	HALMA PLC	14,690	18.30	268,900.45
	BT GROUP PLC	267,752	1.11	298,945.10
	VODAFONE GROUP PLC	996,528	0.73	736,434.19
	CENTRICA PLC	209,200	1.57	329,280.80
	NATIONAL GRID PLC	140,528	9.76	1,372,115.39
	SEVERN TRENT PLC	9,023	25.73	232,161.79
	SSE PLC	43,667	16.08	702,165.36
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	10.45	272,927.77
英債券小計		11,198,209		72,080,399.82 (13,098,450,255)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,990	12.34	98,596.60
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	600.00	162,000.00

GIVAUDAN-REG	378	2,852.00	1,078,056.00
HOLCIM LTD	22,219	55.78	1,239,375.82
SIG GROUP AG	10,900	19.46	212,114.00
SIKA AG-REG	5,675	212.00	1,203,100.00
ABB LTD-REG	61,275	29.80	1,825,995.00
GEBERIT AG-REG	1,490	416.40	620,436.00
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,070	174.70	186,929.00
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	181.40	268,472.00
VAT GROUP AG	1,015	324.70	329,570.50
ADECCO GROUP AG-REG	6,817	33.70	229,732.90
SGS SA-REG	5,950	74.56	443,632.00
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,160	240.40	519,264.00
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	20,559	107.00	2,199,813.00
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,125	229.50	258,187.50
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,950	43.60	85,020.00
DUFREY AG-REG	3,460	31.24	108,090.40
BARRY CALLEBAUT AG-REG	130	1,347.00	175,110.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	40	10,010.00	400,400.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	99,800.00	499,000.00
NESTLE SA-REG	107,170	98.55	10,561,603.50
ALCON INC	19,554	64.62	1,263,579.48
SONOVA HOLDING AG-REG	2,051	212.30	435,427.30
STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,370	112.45	491,406.50
BACHEM HOLDING AG	1,400	64.05	89,670.00
LONZA GROUP AG-REG	2,973	315.00	936,495.00
NOVARTIS AG-REG	82,243	85.82	7,058,094.26
ROCHE HOLDING AG-BR	1,280	253.40	324,352.00
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	28,203	237.55	6,699,622.65
SANDOZ GROUP AG	16,448	25.76	423,782.72
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,510	101.00	152,510.00
JULIUS BAER GROUP LTD	8,420	53.44	449,964.80
PARTNERS GROUP HOLDING AG	900	955.20	859,680.00
UBS GROUP AG-REG	132,512	21.44	2,841,057.28
BALOISE HOLDING AG - REG	1,740	128.30	223,242.00
HELVETIA HOLDING AG-REG	1,320	119.90	158,268.00
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,285	568.60	730,651.00

	SWISS RE AG	12,289	97.68	1,200,389.52	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,011	426.40	2,563,090.40	
	TEMENOS AG	2,280	64.12	146,193.60	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	69.80	464,868.00	
	SWISSCOM AG-REG	1,024	534.00	546,816.00	
	BKW AG	840	154.50	129,780.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,441	82.75	284,742.75	
スイスフラン小計		601,882		51,178,181.48 (8,570,298,270)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	10,290	278.80	2,868,852.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,520	409.10	1,440,032.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	22,680	148.70	3,372,516.00	
	ALFA LAVAL AB	10,710	351.50	3,764,565.00	
	ASSA ABLOY AB-B	42,940	233.20	10,013,608.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	111,390	143.30	15,962,187.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	56,870	124.65	7,088,845.50	
	BEIJER REF AB	15,480	101.40	1,569,672.00	
	EPIROC AB-A	31,565	192.35	6,071,527.75	
	EPIROC AB-B	15,450	162.80	2,515,260.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	71.26	1,068,900.00	
	INDUTRADE AB	10,180	187.45	1,908,241.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	185.50	1,261,400.00	
	LIFCO AB-B SHS	8,470	192.90	1,633,863.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	63,000	63.04	3,971,520.00	
	SAAB AB-B	2,780	573.40	1,594,052.00	
	SANDVIK AB	40,890	187.65	7,673,008.50	
	SKANSKA AB-B SHS	14,390	159.45	2,294,485.50	
	SKF AB-B SHARES-B	14,079	175.55	2,471,568.45	
	VOLVO AB-A SHS	9,530	222.40	2,119,472.00	
	VOLVO AB-B SHS-B	58,430	218.40	12,761,112.00	
	SECURITAS AB-B SHS	17,788	90.92	1,617,284.96	
	VOLVO CAR AB-B	20,400	42.27	862,308.00	
	EVOLUTION AB	7,140	1,053.60	7,522,704.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,848	149.00	4,149,352.00		
ESSITY AKTIEBOLAG-B	23,695	237.60	5,629,932.00		
GETINGE AB-B SHS	9,470	197.20	1,867,484.00		

	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	8, 148	215. 60	1, 756, 708. 80	
	NORDEA BANK ABP	131, 132	117. 50	15, 408, 010. 00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	62, 450	123. 35	7, 703, 207. 50	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60, 120	96. 04	5, 773, 924. 80	
	SWEDBANK AB - A SHARES	34, 550	191. 60	6, 619, 780. 00	
	EQT AB	14, 450	201. 80	2, 916, 010. 00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4, 984	281. 00	1, 400, 504. 00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5, 980	279. 70	1, 672, 606. 00	
	INVESTOR AB-B SHS	69, 350	202. 00	14, 008, 700. 00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3, 590	446. 50	1, 602, 935. 00	
	ERICSSON LM-B SHS	114, 915	49. 54	5, 693, 463. 67	
	HEXAGON AB-B SHS	80, 990	94. 54	7, 656, 794. 60	
	TELE2 AB-B SHS	23, 245	78. 26	1, 819, 153. 70	
	TELIA CO AB	118, 530	23. 84	2, 825, 755. 20	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	23, 220	43. 72	1, 015, 178. 40	
	SAGAX AB-B	7, 910	190. 60	1, 507, 646. 00	
スウェーデンクローナ小計		1, 434, 349		194, 454, 130. 33 (2, 617, 352, 594)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	12, 100	310. 70	3, 759, 470. 00	
	EQUINOR ASA	39, 014	370. 05	14, 437, 130. 70	
	NORSK HYDRO A S	50, 660	59. 94	3, 036, 560. 40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6, 670	360. 20	2, 402, 534. 00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3, 900	477. 80	1, 863, 420. 00	
	ADEVINTA ASA	11, 400	95. 40	1, 087, 560. 00	
	MOWI ASA	16, 360	176. 95	2, 894, 902. 00	
	ORKLA ASA	32, 290	81. 16	2, 620, 656. 40	
	SALMAR ASA	3, 590	506. 80	1, 819, 412. 00	
	DNB BANK ASA	35, 845	200. 00	7, 169, 000. 00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7, 410	163. 70	1, 213, 017. 00	
	TELENOR ASA	23, 915	115. 95	2, 772, 944. 25	
ノルウェークローネ小計		243, 154		45, 076, 606. 75 (603, 575, 764)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3, 840	423. 30	1, 625, 472. 00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	8, 165	277. 80	2, 268, 237. 00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	315	1, 533. 00	482, 895. 00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	41, 480	147. 72	6, 127, 425. 60	

	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	115	11,330.00	1,302,950.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	195	11,550.00	2,252,250.00	
	DSV A/S	7,890	974.80	7,691,172.00	
	PANDORA A/S	3,310	813.40	2,692,354.00	
	CARLSBERG AS-B	3,910	869.20	3,398,572.00	
	COLOPLAST-B	5,015	731.60	3,668,974.00	
	DEMANT A/S	3,640	264.10	961,324.00	
	GENMAB A/S	2,580	2,036.00	5,252,880.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	131,150	692.40	90,808,260.00	
	DANSKE BANK A/S	26,635	155.55	4,143,074.25	
	TRYG A/S	13,945	137.25	1,913,951.25	
	ORSTED A/S	7,570	332.50	2,517,025.00	
デンマーククローネ小計		259,755		137,106,816.10 (2,914,890,910)	
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	32.94	289,048.50	
	SANTOS LTD	121,660	7.77	945,298.20	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	75,946	34.89	2,649,755.94	
	BHP GROUP LTD	203,587	44.72	9,104,410.64	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	18.49	338,551.90	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	65,915	22.02	1,451,448.30	
	IGO LTD	24,300	10.85	263,655.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	16,955	39.11	663,110.05	
	MINERAL RESOURCES LTD	7,320	60.09	439,858.80	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42,190	12.10	510,499.00	
	ORICA LIMITED	17,675	14.74	260,529.50	
	PILBARA MINERALS LTD	114,530	3.88	444,376.40	
	RIO TINTO LTD	14,858	116.27	1,727,539.66	
	SOUTH32 LTD	207,787	3.25	675,307.75	
	REECE LTD	10,200	17.56	179,112.00	
	BRAMBLES LTD	54,798	14.30	783,611.40	
	COMPUTERSHARE LTD	20,910	25.19	526,722.90	
	AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	3.44	253,080.80	
	QANTAS AIRWAYS LTD	35,030	4.83	169,194.90	
	TRANSURBAN GROUP	129,996	11.96	1,554,752.16	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,520	40.37	949,502.40	
	IDP EDUCATION LTD	10,150	21.10	214,165.00	

	LOTTERY CORP LTD/THE	85,554	4.47	382,426.38	
	REA GROUP LTD	1,820	153.20	278,824.00	
	SEEK LTD	12,860	21.30	273,918.00	
	WESFARMERS LTD	47,855	50.82	2,431,991.10	
	COLES GROUP LTD	57,925	14.95	865,978.75	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	50,462	4.98	251,300.76	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	49,102	35.63	1,749,504.26	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	27,906	11.95	333,476.70	
	COCHLEAR LTD	2,947	244.48	720,482.56	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,105	49.51	351,768.55	
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	28.77	508,078.20	
	CSL LTD	19,212	236.05	4,534,992.60	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	120,799	24.85	3,001,855.15	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	67,117	97.35	6,533,839.95	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	124,183	28.32	3,516,862.56	
	WESTPAC BANKING CORP	140,651	20.80	2,925,540.80	
	ASX LTD	7,105	55.60	395,038.00	
	MACQUARIE GROUP LTD	14,604	163.46	2,387,169.84	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,370	34.06	285,082.20	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	5.66	538,407.50	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	108,430	3.49	378,420.70	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	55,210	15.39	849,681.90	
	SUNCORP GROUP LTD	44,036	13.50	594,486.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	5,920	59.95	354,904.00	
	XERO LTD	5,960	108.45	646,362.00	
	TELSTRA GROUP LTD	164,284	3.87	635,779.08	
	APA GROUP	45,818	8.07	369,751.26	
	ORIGIN ENERGY LTD	68,320	9.10	621,712.00	
豪ドル小計		2,754,322		61,111,166.00 (5,768,282,958)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,165	7.57	357,039.05	
	EBOS GROUP LTD	5,630	34.97	196,881.10	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,130	20.60	476,478.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	4.98	381,736.34	
	MERCURY NZ LTD	34,100	5.87	200,167.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	57,830	4.85	280,764.65	

ニュージーランドドル小計		244,432		1,893,066.14 (164,488,516)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	103,208	39.25	4,050,914.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	52,500	70.35	3,693,375.00
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	71,000	8.99	638,290.00
	MTR CORP	62,500	29.80	1,862,500.00
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	11.92	619,840.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	91,000	43.95	3,999,450.00
	SANDS CHINA LTD	96,600	21.30	2,057,580.00
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	14.62	992,698.00
	WH GROUP LTD	299,894	4.34	1,301,539.96
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	148,000	20.60	3,048,800.00
	HANG SENG BANK LTD	29,100	89.00	2,589,900.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	48,300	278.20	13,437,060.00
	AIA GROUP LTD	460,390	67.00	30,846,130.00
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	8.10	1,215,000.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	36.40	910,000.00
	CLP HOLDINGS LTD	63,000	56.25	3,543,750.00
	HONG KONG & CHINA GAS	456,237	5.47	2,495,616.39
	POWER ASSETS HOLDINGS	58,000	37.25	2,160,500.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	80,538	38.90	3,132,928.20
	ESR GROUP LTD	75,800	10.62	804,996.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	10.28	801,840.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	20.45	1,184,075.45
	NEW WORLD DEVELOPMENT	61,666	14.22	876,890.52
	SINO LAND CO	123,050	8.71	1,071,765.50
SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,480	79.50	4,808,160.00	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	17,517	48.95	857,457.15	
SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	14.76	614,016.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	27.65	1,764,070.00	
香港ドル小計		2,994,981		95,379,142.17 (1,832,233,321)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	68,560	6.21	425,757.60
	SEATRUM LTD	1,488,177	0.11	169,652.17
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	63,300	3.76	238,008.00
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	6.18	333,102.00

	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.85	180,490.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	3.45	255,162.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	71,195	33.15	2,360,114.25	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	134,240	12.84	1,723,641.60	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	49,900	27.72	1,383,228.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	9.48	402,900.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	354,480	2.38	843,662.40	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	30,200	4.59	138,618.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	105,000	3.01	316,050.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	6.23	107,779.00	
	UOL GROUP LTD	15,550	5.73	89,101.50	
シンガポールドル小計		2,779,362		8,967,267.02	(982,005,411)
イスラエルシ ケル	ICL GROUP LTD	26,090	19.79	516,321.10	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,010	762.70	770,327.00	
	BANK HAPOALIM BM	50,495	28.41	1,434,562.95	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	62,565	24.97	1,562,248.05	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	48,330	17.13	827,892.90	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,900	117.40	810,060.00	
	NICE LTD	2,440	641.50	1,565,260.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,780	172.60	307,228.00	
イスラエルシケル小計		199,610		7,793,900.00	(287,988,501)
合 計		45,187,855		292,245,103,382	(292,245,103,382)

(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	635,650.90	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	12,110	395,997.00	
		AMERICAN TOWER CORP	18,549	3,003,639.57	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	18,847	284,024.29	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,790	956,392.20	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,717	298,198.72	

		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,810	440,066.90	
		CROWN CASTLE INC	16,330	1,424,955.80	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,695	1,367,847.20	
		EQUINIX INC	3,728	2,543,390.72	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,550	422,016.50	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	15,450	861,337.50	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	521,444.80	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,800	907,104.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,340	511,547.40	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	14,810	214,448.80	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	334,150.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	27,179	423,992.40	
		INVITATION HOMES INC	25,700	779,224.00	
		IRON MOUNTAIN INC	13,365	780,115.05	
		KIMCO REALTY CORP	23,760	389,188.80	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,300	547,734.00	
		PROLOGIS INC	37,145	3,667,697.30	
		PUBLIC STORAGE	6,319	1,503,858.81	
		REALTY INCOME CORP	28,201	1,389,745.28	
		REGENCY CENTERS CORP	6,005	347,209.10	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,175	817,089.25	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	13,394	1,406,102.12	
		SUN COMMUNITIES INC	4,640	477,780.80	
		UDR INC	12,100	411,279.00	
		VENTAS INC	17,025	703,473.00	
		VICI PROPERTIES INC	39,120	1,078,147.20	
		WELLTOWER INC	20,360	1,683,161.20	
		WEYERHAEUSER CO	29,998	858,242.78	
		WP CAREY INC	8,610	452,111.10	
米ドル小計			505,687	32,838,363.49	(4,934,949,265)
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	116,200.00	
加ドル小計			2,800	116,200.00	(12,646,046)
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	71,687.00	
		GECINA SA	1,950	173,745.00	

		KLEPIERRE	8,402	185,348.12	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,990	212,274.60	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,730	175,161.80	
ユーロ小計			24,997	818,216.52 (129,850,961)	
英ポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	148,934.65	
		SEGRO PLC	45,033	308,656.18	
英ポンド小計			71,657	457,590.83 (83,153,405)	
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	42,067	281,848.90	
		GOODMAN GROUP	70,642	1,464,408.66	
		GPT GROUP	71,335	258,946.05	
		LENDLEASE GROUP	23,367	147,445.77	
		MIRVAC GROUP	159,875	310,956.87	
		SCENTRE GROUP	198,271	481,798.53	
		STOCKLAND	102,400	373,760.00	
		VICINITY CENTRES	154,902	266,431.44	
豪ドル小計			822,859	3,585,596.22 (338,444,427)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	104,160	3,739,344.00	
香港ドル小計			104,160	3,739,344.00 (71,832,798)	
シンガポ ールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,243	346,989.93	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	356,245.20	
		KEPPEL REIT(N)	13,712	10,832.48	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	144,556	212,497.32	
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	106,000	137,800.00	
シンガポールドル小計			612,067	1,064,364.93 (116,558,603)	
合計				5,687,435,505 (5,687,435,505)	

(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	組入投資証券	合計金額に
----	-----	------	--------	-------

			時価比率	時価比率	対する比率
米ドル	株式	604 銘柄	97.8%	—	73.2%
	投資証券	35 銘柄	—	2.2%	1.7%
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%	—	9.3%
	投資証券	5 銘柄	—	0.5%	0.0%
英ポンド	株式	82 銘柄	99.4%	—	4.4%
	投資証券	2 銘柄	—	0.6%	0.0%
スイスフラン	株式	45 銘柄	100.0%	—	2.9%
スウェーデンクローナ	株式	43 銘柄	100.0%	—	0.9%
ノルウェークローネ	株式	12 銘柄	100.0%	—	0.2%
デンマーククローネ	株式	16 銘柄	100.0%	—	1.0%
豪ドル	株式	50 銘柄	94.5%	—	1.9%
	投資証券	8 銘柄	—	5.5%	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	28 銘柄	96.2%	—	0.6%
	投資証券	1 銘柄	—	3.8%	0.0%
シンガポールドル	株式	15 銘柄	89.4%	—	0.3%
	投資証券	5 銘柄	—	10.6%	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。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2022年10月26日現在	2023年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	68,117,184	104,846,891
コール・ローン	1,167,168,322	604,845,106
株式	16,378,481,161	18,864,148,524
投資証券	376,675,031	365,107,258
派生商品評価勘定	42,304,567	8,604,707
未収入金	4,150,883	5,135,967
未収配当金	12,390,369	13,823,892
差入委託証拠金	385,736,522	342,727,613
流動資産合計	18,435,024,039	20,309,239,958
資産合計	18,435,024,039	20,309,239,958
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	465,964,195	375,702,990
未払金	361,524,014	17,481,332
未払解約金	31,761,566	3,268,722
未払利息	1,898	215
流動負債合計	859,251,673	396,453,259
負債合計	859,251,673	396,453,259
純資産の部		
元本等		
元本	8,061,313,419	8,773,758,808
剰余金		
剰余金又は欠損金(△)	9,514,458,947	11,139,027,891
元本等合計	17,575,772,366	19,912,786,699
純資産合計	17,575,772,366	19,912,786,699
負債純資産合計	18,435,024,039	20,309,239,958

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)

		2022 年 10 月 26 日現在	2023 年 10 月 26 日現在
1.	期首	2021 年 10 月 27 日	2022 年 10 月 27 日
	期首元本額	6,831,162,629 円	8,061,313,419 円
	期首からの追加設定元本額	1,837,477,067 円	1,273,602,778 円
	期首からの一部解約元本額	607,326,277 円	561,157,389 円
	元本の内訳 ※		
	インデックスファンド海外株式ヘッジあり (DC 専用)	6,553,093,225 円	7,331,730,031 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)	353,402,483 円	311,113,933 円
	N i つみインデックスラップ世界 10 指数 (均等型)	— 円	570,911 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	321,600 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 20)	36,886,955 円	34,386,093 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 40)	103,003,896 円	100,071,776 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 60)	155,066,780 円	158,576,513 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 80)	155,257,338 円	159,949,483 円
	インデックスファンド海外株式 (ヘッジあり)	704,602,742 円	677,038,468 円
計	8,061,313,419 円	8,773,758,808 円	
2.	受益権の総数	8,061,313,419 口	8,773,758,808 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 2021 年 10 月 27 日 至 2022 年 10 月 26 日	自 2022 年 10 月 27 日 至 2023 年 10 月 26 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

	2022年10月26日現在	2023年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2022年10月26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	△2,999,946,385
投資証券	△118,265,811
合計	△3,118,212,196

(2023年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
----	-------------------

株式	1,333,910,881
投資証券	△45,196,394
合計	1,288,714,487

(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)

(2022年10月26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	935,552,532	—	947,120,951	11,568,419
合計		935,552,532	—	947,120,951	11,568,419

(2023年10月26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	724,550,405	—	680,013,225	△44,537,180
合計		724,550,405	—	680,013,225	△44,537,180

(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)

(2022年10月26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	16,648,919,002	—	17,084,147,049	△435,228,047
	米ドル	12,465,226,169	—	12,786,033,348	△320,807,179
	加ドル	597,933,013	—	610,981,665	△13,048,652
	ユーロ	1,507,050,964	—	1,559,577,519	△52,526,555

	英ポンド	697,749,185	—	721,896,836	△24,147,651
	スイスフラン	488,239,847	—	497,278,664	△9,038,817
	スウェーデンクローナ	159,512,748	—	162,456,634	△2,943,886
	ノルウェークローネ	36,378,395	—	36,992,831	△614,436
	デンマーククローネ	125,812,707	—	129,859,985	△4,047,278
	豪ドル	372,019,375	—	375,132,165	△3,112,790
	ニュージーランドドル	6,765,143	—	6,893,513	△128,370
	香港ドル	111,683,012	—	113,846,601	△2,163,589
	シンガポールドル	58,073,572	—	60,350,056	△2,276,484
	イスラエルシェケル	22,474,872	—	22,847,232	△372,360
	合計	16,648,919,002	—	17,084,147,049	△435,228,047

(2023年10月26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	19,185,693,266	—	19,508,254,369	△322,561,103
	米ドル	14,254,594,644	—	14,534,472,941	△279,878,297
	加ドル	635,959,583	—	642,321,661	△6,362,078
	ユーロ	1,887,857,390	—	1,910,407,179	△22,549,789
	英ポンド	852,580,027	—	853,038,008	△457,981
	スイスフラン	540,708,856	—	551,078,320	△10,369,464
	スウェーデンクローナ	167,204,291	—	167,022,962	181,329
	ノルウェークローネ	39,768,693	—	38,544,864	1,223,829
	デンマーククローネ	186,277,322	—	188,428,489	△2,151,167
	豪ドル	407,120,601	—	405,776,904	1,343,697
	ニュージーランドドル	7,653,601	—	7,597,111	56,490
	香港ドル	121,010,535	—	123,985,901	△2,975,366
	シンガポールドル	67,089,127	—	68,277,805	△1,188,678
	イスラエルシェケル	17,868,596	—	17,302,224	566,372
	合計	19,185,693,266	—	19,508,254,369	△322,561,103

(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)

2022年10月26日現在		2023年10月26日現在	
1口当たり純資産額	2,1803円	1口当たり純資産額	2,2696円
(1万口当たり純資産額)	(21,803円)	(1万口当たり純資産額)	(22,696円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	APA CORP	890	41.02	36,507.80	
	BAKER HUGHES CO	2,840	34.02	96,616.80	
	CHENIERE ENERGY INC	606	167.95	101,777.70	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	270	86.65	23,395.50	
	CHEVRON CORP	4,660	155.87	726,354.20	
	CONOCOPHILLIPS	3,060	120.41	368,454.60	
	COTERRA ENERGY INC	2,100	28.23	59,283.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	1,690	47.85	80,866.50	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	480	164.68	79,046.40	
	EOG RESOURCES INC	1,460	129.73	189,405.80	
	EQT CORP	870	42.02	36,557.40	
	EXXON MOBIL CORP	10,400	108.59	1,129,336.00	
	HALLIBURTON CO	2,436	40.38	98,365.68	
	HESS CORP	670	154.40	103,448.00	
	HF SINCLAIR CORP	420	53.81	22,600.20	
KINDER MORGAN INC	4,810	16.79	80,759.90		

MARATHON OIL CORP	1,840	28.12	51,740.80
MARATHON PETROLEUM CORP	1,030	147.35	151,770.50
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,660	63.27	105,028.20
ONEOK INC	1,510	66.27	100,067.70
OVINTIV INC	660	48.73	32,161.80
PHILLIPS 66	1,230	110.74	136,210.20
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	630	245.16	154,450.80
SCHLUMBERGER LTD	3,560	56.62	201,567.20
TARGA RESOURCES CORP	550	85.35	46,942.50
TEXAS PACIFIC LAND CORP	20	1,859.01	37,180.20
VALERO ENERGY CORP	980	126.86	124,322.80
WILLIAMS COS INC	3,360	34.46	115,785.60
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	590	274.48	161,943.20
ALBEMARLE CORP	307	135.32	41,543.24
AMCOR PLC	4,230	8.56	36,208.80
AVERY DENNISON CORP	196	168.33	32,992.68
BALL CORP	855	45.46	38,868.30
CELANESE CORP	190	112.94	21,458.60
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	420	80.88	33,969.60
CLEVELAND-CLIFFS INC	1,340	15.83	21,212.20
CORTEVA INC	2,010	48.63	97,746.30
CROWN HOLDINGS INC	298	79.27	23,622.46
DOW INC	2,030	47.54	96,506.20
DUPONT DE NEMOURS INC	1,130	71.64	80,953.20
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	180	69.03	12,425.40
ECOLAB INC	700	158.67	111,069.00
FMC CORP	326	55.77	18,181.02
FREEMONT-MCMORAN INC	3,530	33.84	119,455.20
INTERNATIONAL PAPER CO	874	33.12	28,946.88
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	750	66.10	49,575.00
LINDE PLC	1,260	364.38	459,118.80
LYONDELLBASELL INDU-CL A	670	89.24	59,790.80
MARTIN MARIETTA MATERIALS	150	410.34	61,551.00
MOSAIC CO/THE	882	33.36	29,423.52
NEWMONT CORP	3,130	36.76	115,058.80
NUCOR CORP	640	144.60	92,544.00

PACKAGING CORP OF AMERICA	240	148.88	35,731.20
PPG INDUSTRIES INC	660	121.48	80,176.80
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	170	247.17	42,018.90
RPM INTERNATIONAL INC	385	89.86	34,596.10
SEALED AIR CORP	300	30.81	9,243.00
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	640	238.61	152,710.40
STEEL DYNAMICS INC	390	99.84	38,937.60
VULCAN MATERIALS CO	380	203.37	77,280.60
WESTROCK CO	562	34.63	19,462.06
3M CO	1,410	89.39	126,039.90
AECOM	380	76.22	28,963.60
AERCAP HOLDINGS NV	450	58.70	26,415.00
ALLEGION PLC	231	96.52	22,296.12
AMETEK INC	630	139.66	87,985.80
AXON ENTERPRISE INC	190	207.87	39,495.30
BOEING CO/THE	1,480	177.73	263,040.40
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	300	106.22	31,866.00
CARLISLE COS INC	130	237.15	30,829.50
CARRIER GLOBAL CORP	2,090	47.04	98,313.60
CATERPILLAR INC	1,310	244.94	320,871.40
CUMMINS INC	420	218.58	91,803.60
DEERE & CO	710	371.91	264,056.10
DOVER CORP	354	130.08	46,048.32
EATON CORP PLC	1,000	195.23	195,230.00
EMERSON ELECTRIC CO	1,460	88.83	129,691.80
FASTENAL CO	1,550	57.08	88,474.00
FERGUSON PLC	530	152.19	80,660.70
FORTIVE CORP	950	64.60	61,370.00
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	347	55.23	19,164.81
GENERAC HOLDINGS INC	147	85.12	12,512.64
GENERAL DYNAMICS CORP	600	242.40	145,440.00
GENERAL ELECTRIC CO	2,790	111.20	310,248.00
GRACO INC	490	69.80	34,202.00
HEICO CORP	80	160.45	12,836.00
HEICO CORP-CLASS A	253	128.43	32,492.79
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,680	178.09	299,191.20

HOWMET AEROSPACE INC	1,146	43.23	49,541.58
HUBBELL INC	140	279.89	39,184.60
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	117	215.06	25,162.02
IDEX CORP	206	187.00	38,522.00
ILLINOIS TOOL WORKS	760	225.97	171,737.20
INGERSOLL-RAND INC	1,003	59.36	59,538.08
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	500	40.25	20,125.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	1,710	48.10	82,251.00
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	530	175.74	93,142.20
LENNOX INTERNATIONAL INC	80	339.30	27,144.00
LOCKHEED MARTIN CORP	590	447.69	264,137.10
MASCO CORP	450	48.33	21,748.50
NORDSON CORP	120	210.71	25,285.20
NORTHROP GRUMMAN CORP	390	483.26	188,471.40
OTIS WORLDWIDE CORP	1,110	75.47	83,771.70
OWENS CORNING	242	110.60	26,765.20
PACCAR INC	1,440	84.53	121,723.20
PARKER HANNIFIN CORP	360	367.52	132,307.20
PENTAIR PLC	520	57.38	29,837.60
QUANTA SERVICES INC	370	168.23	62,245.10
ROCKWELL AUTOMATION INC	330	263.32	86,895.60
RTX CORP	3,810	78.41	298,742.10
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	358	34.44	12,329.52
SMITH (A. O.) CORP	270	65.19	17,601.30
SNAP-ON INC	152	250.20	38,030.40
STANLEY BLACK & DECKER INC	421	77.25	32,522.25
TEXTRON INC	508	74.36	37,774.88
TORO CO	300	80.35	24,105.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	630	184.42	116,184.60
TRANSDIGM GROUP INC	140	818.28	114,559.20
UNITED RENTALS INC	180	399.15	71,847.00
WABTEC CORP	460	104.06	47,867.60
WATSCO INC	90	340.51	30,645.90
WW GRAINGER INC	110	677.41	74,515.10
XYLEM INC	520	87.76	45,635.20
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,040	218.33	227,063.20

BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	365	119.41	43,584.65
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	280	169.99	47,597.20
CERIDIAN HCM HOLDING INC	300	65.16	19,548.00
CINTAS CORP	210	501.51	105,317.10
CLARIVATE PLC	1,013	6.49	6,574.37
COPART INC	2,460	43.63	107,329.80
EQUIFAX INC	290	164.17	47,609.30
JACOBS SOLUTIONS INC	290	132.80	38,512.00
LEIDOS HOLDINGS INC	309	91.32	28,217.88
PAYCHEX INC	790	112.19	88,630.10
PAYCOM SOFTWARE INC	160	248.08	39,692.80
PAYLOCITY HOLDING CORP	140	177.59	24,862.60
REPUBLIC SERVICES INC	580	147.58	85,596.40
ROBERT HALF INC	290	73.56	21,332.40
ROLLINS INC	540	34.33	18,538.20
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	603	49.36	29,764.08
TRANSUNION	455	46.23	21,034.65
VERALTO CORP	596	70.79	42,190.84
VERISK ANALYTICS INC	360	228.13	82,126.80
WASTE CONNECTIONS INC	630	137.41	86,568.30
WASTE MANAGEMENT INC	1,060	164.07	173,914.20
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	300	82.73	24,819.00
CSX CORP	5,030	29.60	148,888.00
DELTA AIR LINES INC	276	31.41	8,669.16
EXPEDITORS INTL WASH INC	427	108.88	46,491.76
FEDEX CORP	620	235.21	145,830.20
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	3,920	3.20	12,544.00
HUNT (JB) TRANSPORT SVCS INC	219	170.04	37,238.76
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	463	49.45	22,895.35
NORFOLK SOUTHERN CORP	560	185.79	104,042.40
OLD DOMINION FREIGHT LINE	250	371.01	92,752.50
SOUTHWEST AIRLINES CO	466	23.60	10,997.60
U-HAUL HOLDING CO	230	48.73	11,207.90
UBER TECHNOLOGIES INC	4,660	42.35	197,351.00
UNION PACIFIC CORP	1,560	205.22	320,143.20
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,840	146.93	270,351.20

APTIV PLC	720	89.37	64,346.40
BORGWARNER INC	614	38.13	23,411.82
FORD MOTOR COMPANY	10,460	11.54	120,708.40
GENERAL MOTORS CORP	3,590	29.01	104,145.90
LEAR CORP	167	129.68	21,656.56
LUCID GROUP INC	1,261	4.17	5,258.37
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	1,840	17.02	31,316.80
TESLA INC	7,360	212.42	1,563,411.20
DECKERS OUTDOOR CORP	70	492.40	34,468.00
DR HORTON INC	790	100.66	79,521.40
GARMIN LTD	490	101.74	49,852.60
HASBRO INC	290	54.75	15,877.50
LENNAR CORP-CL A	610	103.07	62,872.70
LULULEMON ATHLETICA INC	310	396.70	122,977.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	125	78.21	9,776.25
NIKE INC -CL B	3,140	103.54	325,115.60
NVR INC	10	5,377.29	53,772.90
PULTE GROUP INC	610	71.02	43,322.20
VF CORP	800	17.95	14,360.00
WHIRLPOOL CORP	176	125.61	22,107.36
AIRBNB INC-CLASS A	1,110	118.50	131,535.00
ARAMARK	646	26.31	16,996.26
BOOKING HOLDINGS INC	90	2,812.92	253,162.80
CAESARS ENTERTAINMENT INC	521	38.54	20,079.34
CARNIVAL CORP	2,298	11.27	25,898.46
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	70	1,841.87	128,930.90
DARDEN RESTAURANTS INC	311	142.20	44,224.20
DOMINO'S PIZZA INC	93	349.91	32,541.63
DOORDASH INC - A	730	72.28	52,764.40
DRAFTKINGS INC-CL A	1,130	27.35	30,905.50
EXPEDIA GROUP INC	397	95.97	38,100.09
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	700	150.75	105,525.00
HYATT HOTELS CORP - CL A	130	101.36	13,176.80
LAS VEGAS SANDS CORP	909	47.20	42,904.80
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	690	188.43	130,016.70
MCDONALD'S CORP	1,870	258.03	482,516.10

MGM RESORTS INTERNATIONAL	761	34.63	26,353.43
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	550	82.22	45,221.00
STARBUCKS CORP	2,890	94.00	271,660.00
VAIL RESORTS INC	122	209.81	25,596.82
WYNN RESORTS LTD	210	88.94	18,677.40
YUM! BRANDS INC	730	120.31	87,826.30
ALPHABET INC-CL A	15,300	125.61	1,921,833.00
ALPHABET INC-CL C	13,690	126.67	1,734,112.30
CHARTER COMMUNICATION-A	250	423.73	105,932.50
COMCAST CORP-CLASS A	10,610	42.75	453,577.50
ELECTRONIC ARTS INC	730	125.72	91,775.60
FOX CORP - CLASS A	730	30.25	22,082.50
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	932	27.69	25,807.08
LIBERTY BROADBAND-C	240	87.23	20,935.20
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	514	65.32	33,574.48
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW C	623	24.45	15,232.35
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	440	77.70	34,188.00
MATCH GROUP INC	682	34.94	23,829.08
META PLATFORMS INC-CLASS A	5,710	299.53	1,710,316.30
NETFLIX INC	1,140	411.25	468,825.00
NEWS CORP - CLASS A	1,331	20.55	27,352.05
OMNICOM GROUP	510	74.39	37,938.90
PARAMOUNT GLOBAL	1,604	10.94	17,547.76
PINTEREST INC- CLASS A	1,820	25.56	46,519.20
ROBLOX CORP -CLASS A	1,150	31.10	35,765.00
ROKU INC	306	58.50	17,901.00
SEA LTD-ADR	950	43.97	41,771.50
SNAP INC - A	2,685	9.19	24,675.15
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	417	137.07	57,158.19
THE WALT DISNEY CO.	4,650	80.59	374,743.50
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1,200	71.67	86,004.00
WARNER BROS DISCOVERY INC	6,490	9.73	63,147.70
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	594	15.72	9,337.68
AMAZON.COM INC	23,840	121.39	2,893,937.60
AUTOZONE INC	50	2,436.12	121,806.00
BATH & BODY WORKS INC	593	28.12	16,675.16

BEST BUY CO INC	559	67.59	37,782.81
BURLINGTON STORES INC	158	120.09	18,974.22
CARMAX INC	443	60.53	26,814.79
CHEWY INC - CLASS A	225	16.87	3,795.75
DICK'S SPORTING GOODS INC	160	107.24	17,158.40
EBAY INC	1,170	39.30	45,981.00
ETSY INC	348	62.96	21,910.08
GENUINE PARTS CO	390	128.43	50,087.70
HOME DEPOT INC	2,580	280.93	724,799.40
LKQ CORP	715	46.92	33,547.80
LOWE'S COS INC	1,490	186.09	277,274.10
MERCADOLIBRE INC	120	1,190.98	142,917.60
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	160	874.92	139,987.20
POOL CORP	94	319.07	29,992.58
ROSS STORES INC	960	115.54	110,918.40
TJX COMPANIES INC	2,910	88.95	258,844.50
TRACTOR SUPPLY COMPANY	288	198.07	57,044.16
ULTA BEAUTY INC	130	377.98	49,137.40
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	730	21.82	15,928.60
COSTCO WHOLESALE CORP	1,140	549.99	626,988.60
DOLLAR GENERAL CORP	550	119.47	65,708.50
DOLLAR TREE INC	590	108.30	63,897.00
KROGER CO	1,730	44.29	76,621.70
SYSCO CORP	1,390	65.74	91,378.60
TARGET CORP	1,170	110.36	129,121.20
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,830	21.67	39,656.10
WALMART INC	3,860	162.76	628,253.60
ALTRIA GROUP INC	4,560	42.82	195,259.20
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,370	71.05	97,338.50
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	770	55.97	43,096.90
BUNGE LTD	384	102.18	39,237.12
CAMPBELL SOUP CO	618	40.90	25,276.20
COCA-COLA CO/THE	10,640	56.12	597,116.80
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	578	58.78	33,974.84
CONAGRA BRANDS INC	1,363	27.75	37,823.25
CONSTELLATION BRANDS INC-A	420	234.02	98,288.40

DARLING INGREDIENTS INC	410	40.59	16,641.90
GENERAL MILLS INC	1,480	65.65	97,162.00
HERSHEY CO/THE	373	194.47	72,537.31
HORMEL FOODS CORP	990	32.12	31,798.80
JM SMUCKER CO/THE	281	114.50	32,174.50
KELLANOVA	840	50.96	42,806.40
KEURIG DR PEPPER INC	2,199	29.10	63,990.90
KRAFT HEINZ CO/THE	2,120	32.08	68,009.60
LAMB WESTON HOLDING INC	370	88.81	32,859.70
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	670	64.38	43,134.60
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	620	57.68	35,761.60
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	3,490	65.68	229,240.65
MONSTER BEVERAGE CORP	1,990	50.08	99,659.20
PEPSICO INC	3,540	162.35	574,719.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	4,000	90.03	360,120.00
TYSON FOODS INC-CL A	731	45.37	33,165.47
CHURCH & DWIGHT CO INC	624	92.24	57,557.76
CLOROX COMPANY	311	121.97	37,932.67
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,980	73.41	145,351.80
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	610	134.55	82,075.50
KENVUE INC	4,000	19.73	78,920.00
KIMBERLY-CLARK CORP	840	118.78	99,775.20
PROCTER & GAMBLE CO	6,100	150.60	918,660.00
ABBOTT LABORATORIES	4,450	93.57	416,386.50
ALIGN TECHNOLOGY INC	189	253.69	47,947.41
BAXTER INTERNATIONAL INC	1,380	32.16	44,380.80
BECTON DICKINSON AND CO	720	255.57	184,010.40
BOSTON SCIENTIFIC CORP	3,580	49.99	178,964.20
CARDINAL HEALTH INC	600	93.53	56,118.00
CENCORA INC	460	189.12	86,995.20
CENTENE CORP	1,490	68.71	102,377.90
CIGNA GROUP/THE	760	303.89	230,956.40
COOPER COS INC/THE	138	315.22	43,500.36
CVS HEALTH CORP	3,270	68.53	224,093.10
DAVITA INC	130	78.60	10,218.00
DENTSPLY SIRONA INC	651	31.81	20,708.31

DEXCOM INC	1,050	84.35	88,567.50
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,620	68.34	110,710.80
ELEVANCE HEALTH INC	610	450.07	274,542.70
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	963	64.51	62,123.13
HCA HEALTHCARE INC	520	225.36	117,187.20
HENRY SCHEIN INC	310	67.77	21,008.70
HOLOGIC INC	640	66.62	42,636.80
HUMANA INC	320	522.77	167,286.40
IDEXX LABORATORIES INC	200	412.68	82,536.00
INSULET CORP	183	139.64	25,554.12
INTUITIVE SURGICAL INC	880	266.61	234,616.80
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	230	197.69	45,468.70
MCKESSON CORP	340	453.00	154,020.00
MEDTRONIC PLC	3,380	71.40	241,332.00
MOLINA HEALTHCARE INC	160	336.45	53,832.00
QUEST DIAGNOSTICS	309	125.47	38,770.23
RESMED INC	410	140.50	57,605.00
STERIS PLC	310	213.00	66,030.00
STRYKER CORP	860	259.06	222,791.60
TELEFLEX INC	138	185.37	25,581.06
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,400	530.21	1,272,504.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	184	122.21	22,486.64
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	380	194.78	74,016.40
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	540	103.64	55,965.60
ABBVIE INC	4,550	145.26	660,933.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	760	103.40	78,584.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	340	159.49	54,226.60
AMGEN INC	1,370	272.16	372,859.20
AVANTOR INC	2,120	19.35	41,022.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	64	290.07	18,564.48
BIO-TECHNE CORP	388	61.28	23,776.64
BIOGEN INC	350	246.72	86,352.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	488	81.77	39,903.76
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	5,340	56.61	302,297.40
CATALENT INC	429	39.43	16,915.47
CHARLES RIVER LABORATORIES	125	172.69	21,586.25

DANAHER CORP	1,790	192.65	344,843.50
ELI LILLY & CO	2,090	586.46	1,225,701.40
EXACT SCIENCES CORP	426	61.81	26,331.06
GILEAD SCIENCES INC	3,180	78.39	249,280.20
ILLUMINA INC	440	113.93	50,129.20
INCYTE CORP	600	54.25	32,550.00
IQVIA HOLDINGS INC	510	181.22	92,422.20
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	140	130.12	18,216.80
JOHNSON & JOHNSON	6,200	151.57	939,734.00
MERCK & CO. INC.	6,550	103.63	678,776.50
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	60	975.26	58,515.60
MODERNA INC	880	76.76	67,548.80
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	220	108.23	23,810.60
PFIZER INC	14,490	30.73	445,277.70
REGENERON PHARMACEUTICALS	280	797.04	223,171.20
REPLIGEN CORP	170	124.42	21,151.40
REVVITY INC	380	99.69	37,882.20
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	845	27.30	23,068.50
SEAGEN INC	380	216.64	82,323.20
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	3,353	8.21	27,528.13
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	990	433.18	428,848.20
UNITED THERAPEUTICS CORP	130	224.50	29,185.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	660	363.04	239,606.40
VIATRIS INC	3,111	8.97	27,905.67
WATERS CORP	130	242.30	31,499.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	199	358.00	71,242.00
ZOETIS INC	1,220	163.67	199,677.40
BANK OF AMERICA CORP	18,290	25.55	467,309.50
CITIGROUP INC	4,870	38.61	188,030.70
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,470	23.47	34,500.90
FIFTH THIRD BANCORP	1,160	23.03	26,714.80
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	30	1,301.67	39,050.10
FIRST HORIZON CORP	1,390	10.39	14,442.10
HUNTINGTON BANCSHARES INC	4,310	9.47	40,815.70
JPMORGAN CHASE & CO	7,510	140.40	1,054,404.00
KEYCORP	2,531	9.81	24,829.11

M & T BANK CORP	360	111.66	40,197.60
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	950	111.29	105,725.50
REGIONS FINANCIAL CORP	2,407	14.06	33,842.42
TRUIST FINANCIAL CORP	3,630	27.96	101,494.80
US BANCORP	3,830	31.29	119,840.70
WEBSTER FINANCIAL CORP	500	36.96	18,480.00
WELLS FARGO & CO	9,310	39.03	363,369.30
ALLY FINANCIAL INC	600	23.44	14,064.00
AMERICAN EXPRESS CO	1,600	143.52	229,632.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	240	307.14	73,713.60
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	1,130	81.40	91,982.00
ARES MANAGEMENT CORP-A	400	101.27	40,508.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	2,120	41.85	88,722.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	3,350	336.90	1,128,615.00
BLACKROCK INC	380	608.68	231,298.40
BLACKSTONE INC	1,790	91.91	164,518.90
BLOCK INC	1,540	41.72	64,248.80
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	920	88.97	81,852.40
CARLYLE GROUP INC/THE	590	27.56	16,260.40
CBOE GLOBAL MARKETS INC	306	162.42	49,700.52
CME GROUP INC	920	214.08	196,953.60
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	410	77.79	31,893.90
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	728	80.60	58,676.80
EQUITABLE HOLDINGS INC	960	26.18	25,132.80
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	120	424.18	50,901.60
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	1,480	48.85	72,298.00
FISERV INC	1,560	114.12	178,027.20
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	192	230.89	44,330.88
FRANKLIN RESOURCES INC	780	22.26	17,362.80
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	139	56.06	7,792.34
GLOBAL PAYMENTS INC	700	105.61	73,927.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	840	296.76	249,278.40
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,540	106.73	164,364.20
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	201	141.96	28,533.96
KKR & CO INC -A	1,463	54.88	80,289.44
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	200	216.21	43,242.00

MARKETAXESS HOLDINGS INC	94	214.08	20,123.52
MASTERCARD INC - A	2,180	386.31	842,155.80
MOODY'S CORP	410	314.26	128,846.60
MORGAN STANLEY	3,310	71.40	236,334.00
MSCI INC	200	479.63	95,926.00
NASDAQ INC	867	49.49	42,907.83
NORTHERN TRUST CORP	508	63.06	32,034.48
PAYPAL HOLDINGS INC	2,660	51.49	136,963.40
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	600	91.83	55,098.00
S&P GLOBAL INC	840	349.13	293,269.20
SCHWAB (CHARLES) CORP	3,840	49.37	189,580.80
SEI INVESTMENTS COMPANY	347	54.40	18,876.80
STATE STREET CORP	790	64.02	50,575.80
SYNCHRONY FINANCIAL	1,226	27.70	33,960.20
T ROWE PRICE GROUP INC	630	93.47	58,886.10
TOAST INC-CLASS A	990	16.56	16,394.40
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	333	83.39	27,768.87
VISA INC-CLASS A SHARES	4,160	236.85	985,296.00
AFLAC INC	1,600	78.26	125,216.00
ALLSTATE CORP	740	125.19	92,640.60
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	204	108.46	22,125.84
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	2,070	60.96	126,187.20
AON PLC	520	319.65	166,218.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	955	83.49	79,732.95
ARTHUR J GALLAGHER & CO	540	231.10	124,794.00
ASSURANT INC	167	149.00	24,883.00
BROWN & BROWN INC	595	69.02	41,066.90
CHUBB LTD	1,040	215.65	224,276.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	382	98.39	37,584.98
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	70	294.34	20,603.80
EVEREST GROUP LTD	105	396.69	41,652.45
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	870	37.37	32,511.90
GLOBE LIFE INC	215	112.03	24,086.45
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	827	71.89	59,453.03
LOEWS CORP	575	63.80	36,685.00
MARKEL GROUP INC	34	1,461.62	49,695.08

MARSH & MCLENNAN COS	1,250	188.88	236,100.00
METLIFE INC	1,790	58.96	105,538.40
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	658	66.88	44,007.04
PROGRESSIVE CORP	1,480	156.43	231,516.40
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,020	89.31	91,096.20
TRAVELERS COS INC/THE	540	164.73	88,954.20
WILLIS TOWERS WATSON PLC	290	207.74	60,244.60
WR BERKLEY CORP	600	67.06	40,236.00
ACCENTURE PLC-CL A	1,620	292.68	474,141.60
ADOBE INC	1,170	521.14	609,733.80
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	510	102.60	52,326.00
ANSYS INC	210	270.74	56,855.40
ASPEN TECHNOLOGY INC	100	176.87	17,687.00
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	430	178.59	76,793.70
AUTODESK INC	520	200.21	104,109.20
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	519	48.90	25,379.10
BILL HOLDINGS INC	260	92.35	24,011.00
CADENCE DESIGN SYS INC	760	231.03	175,582.80
CHECK POINT SOFTWARE TECH	291	133.60	38,877.60
CLOUDFLARE INC-CLASS A	590	56.49	33,329.10
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	1,490	64.09	95,494.10
CONFLUENT INC-CLASS A	350	26.62	9,317.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	590	175.38	103,474.20
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	121	158.68	19,200.28
DATADOG INC-CLASS A	630	81.59	51,401.70
DOCUSIGN INC	501	39.39	19,734.39
DYNATRACE INC	565	44.58	25,187.70
EPAM SYSTEMS INC	180	214.54	38,617.20
FAIR ISAAC CORP	62	825.10	51,156.20
FORTINET INC	1,800	55.94	100,692.00
GARTNER INC	240	331.66	79,598.40
GEN DIGITAL INC	1,407	16.50	23,215.50
GODADDY INC-CLASS A	443	72.88	32,285.84
HUBSPOT INC	123	411.69	50,637.87
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,330	137.08	319,396.40
INTUIT INC	710	483.03	342,951.30

MANHATTAN ASSOCIATES INC	170	193.06	32,820.20
MICROSOFT CORP	18,240	340.67	6,213,820.80
MONDAY.COM LTD	50	128.66	6,433.00
MONGODB INC	180	329.33	59,279.40
OKTA INC	349	67.42	23,529.58
ORACLE CORP	4,200	101.43	426,006.00
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	4,890	15.59	76,235.10
PALO ALTO NETWORKS INC	780	244.79	190,936.20
PTC INC	270	137.97	37,251.90
ROPER TECHNOLOGIES INC	290	481.21	139,550.90
SALESFORCE INC	2,500	197.06	492,650.00
SERVICENOW INC	520	530.17	275,688.40
SNOWFLAKE INC-CLASS A	720	142.40	102,528.00
SPLUNK INC	370	147.49	54,571.30
SYNOPSYS INC	380	455.26	172,998.80
TWILIO INC - A	437	51.21	22,378.77
TYLER TECHNOLOGIES INC	100	366.64	36,664.00
UIPATH INC - CLASS A	1,050	15.14	15,897.00
UNITY SOFTWARE INC	790	25.69	20,295.10
VERISIGN INC	250	206.47	51,617.50
VMWARE INC-CLASS A	630	148.26	93,403.80
WIX.COM LTD	150	81.76	12,264.00
WORKDAY INC-CLASS A	510	207.21	105,677.10
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	567	60.35	34,218.45
ZSCALER INC	227	157.61	35,777.47
AMPHENOL CORP-CL A	1,480	79.66	117,896.80
APPLE INC	40,620	171.10	6,950,082.00
ARISTA NETWORKS INC	670	186.09	124,680.30
ARROW ELECTRONICS INC	170	109.86	18,676.20
CDW CORP/DE	330	198.70	65,571.00
CISCO SYSTEMS INC	10,440	52.40	547,056.00
COGNEX CORP	423	34.99	14,800.77
CORNING INC	2,060	26.78	55,166.80
DELL TECHNOLOGIES -C	750	66.34	49,755.00
F5 INC	167	151.68	25,330.56
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	3,350	15.14	50,719.00

HP INC	2,240	26.03	58,307.20
JABIL INC	360	121.78	43,840.80
JUNIPER NETWORKS INC	802	25.03	20,074.06
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	530	120.47	63,849.10
MOTOROLA SOLUTIONS INC	460	280.51	129,034.60
NETAPP INC	510	72.48	36,964.80
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	463	67.10	31,067.30
SUPER MICRO COMPUTER INC	130	253.99	33,018.70
TE CONNECTIVITY LTD	770	116.48	89,689.60
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	120	373.28	44,793.60
TRIMBLE INC	530	47.24	25,037.20
WESTERN DIGITAL CORP	807	42.18	34,039.26
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	120	198.91	23,869.20
AT&T INC	18,370	15.19	279,040.30
T-MOBILE US INC	1,360	140.99	191,746.40
VERIZON COMMUNICATIONS INC	10,740	33.69	361,830.60
AES CORP	2,110	14.68	30,974.80
ALLIANT ENERGY CORP	780	49.54	38,641.20
AMEREN CORPORATION	560	76.85	43,036.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	1,400	75.36	105,504.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	520	116.50	60,580.00
ATMOS ENERGY CORP	430	108.35	46,590.50
CENTERPOINT ENERGY INC	1,340	27.46	36,796.40
CMS ENERGY CORP	890	54.45	48,460.50
CONSOLIDATED EDISON INC	990	88.31	87,426.90
CONSTELLATION ENERGY	820	112.03	91,864.60
DOMINION ENERGY INC	2,250	40.54	91,215.00
DTE ENERGY COMPANY	510	97.94	49,949.40
DUKE ENERGY CORP	2,030	88.15	178,944.50
EDISON INTERNATIONAL	1,100	63.30	69,630.00
ENTERGY CORP	590	92.56	54,610.40
ESSENTIAL UTILITIES INC	610	33.02	20,142.20
EVERGY INC	730	48.90	35,697.00
EVERSOURCE ENERGY	760	54.22	41,207.20
EXELON CORP	2,730	39.00	106,470.00
FIRSTENERGY CORP	1,610	35.76	57,573.60

NEXTERA ENERGY INC	5,160	56.46	291,333.60
NISOURCE INC	1,151	25.31	29,131.81
NRG ENERGY INC	676	41.83	28,277.08
P G & E CORP	4,760	16.17	76,969.20
PPL CORP	1,630	24.38	39,739.40
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	1,190	60.59	72,102.10
SEMPRA	1,570	70.17	110,166.90
SOUTHERN CO	2,890	66.61	192,502.90
VISTRA CORP	921	32.78	30,190.38
WEC ENERGY GROUP INC	740	82.32	60,916.80
XCEL ENERGY INC	1,520	59.47	90,394.40
ADVANCED MICRO DEVICES	4,140	96.05	397,667.70
ANALOG DEVICES INC	1,290	159.79	206,129.10
APPLIED MATERIALS INC	2,160	130.11	281,037.60
BROADCOM INC	1,070	849.63	909,104.10
ENPHASE ENERGY INC	400	94.35	37,740.00
ENTEGRIS INC	410	86.67	35,534.70
FIRST SOLAR INC	250	151.36	37,840.00
INTEL CORP	10,740	32.83	352,594.20
KLA CORP	350	454.84	159,194.00
LAM RESEARCH CORP	340	583.34	198,335.60
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	380	68.84	26,159.20
MARVELL TECHNOLOGY INC	2,290	47.55	108,889.50
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	1,370	71.38	97,790.60
MICRON TECHNOLOGY INC	2,820	66.50	187,530.00
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	109	399.73	43,570.57
NVIDIA CORP	6,380	417.79	2,665,500.20
NXP SEMICONDUCTORS NV	660	175.94	116,120.40
ON SEMICONDUCTOR CORP	1,100	81.16	89,276.00
QORVO INC	316	86.20	27,239.20
QUALCOMM INC	2,860	104.78	299,670.80
SKYWORKS SOLUTIONS INC	437	88.57	38,705.09
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	180	81.04	14,587.20
TERADYNE INC	403	87.91	35,427.73
TEXAS INSTRUMENTS INC	2,330	141.79	330,370.70
WOLFSPEED INC	320	30.58	9,785.60

	CBRE GROUP INC - A	903	65.76	59,381.28
	COSTAR GROUP INC	1,080	70.91	76,582.80
	ZILLOW GROUP INC - C	478	38.19	18,254.82
米ドル小計		875,868		93,535,788.75 (14,056,558,333)
加ドル	ARC RESOURCES LTD	1,760	22.12	38,931.20
	CAMECO CORP	960	54.16	51,993.60
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	2,670	88.68	236,775.60
	CENOVUS ENERGY INC	3,390	27.33	92,648.70
	ENBRIDGE INC	5,030	44.53	223,985.90
	IMPERIAL OIL LTD	600	80.85	48,510.00
	KEYERA CORP	660	32.31	21,324.60
	PARKLAND CORP	500	41.29	20,645.00
	PEMBINA PIPELINE CORP	1,530	42.23	64,611.90
	SUNCOR ENERGY INC	3,450	45.80	158,010.00
	TC ENERGY CORP	2,840	47.39	134,587.60
	TOURMALINE OIL CORP	870	71.66	62,344.20
	AGNICO EAGLE MINES LTD	1,300	67.37	87,581.00
	BARRICK GOLD CORP	4,090	22.87	93,538.30
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	530	55.08	29,192.40
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	1,389	28.72	39,892.08
	FRANCO-NEVADA CORP	507	189.64	96,147.48
	IVANHOE MINES LTD-CL A	1,881	10.28	19,336.68
	KINROSS GOLD CORP	4,540	7.34	33,323.60
	LUNDIN MINING CORP	1,990	8.63	17,173.70
	NUTRIEN LTD	1,310	77.33	101,302.30
	PAN AMERICAN SILVER CORP	611	20.69	12,641.59
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	1,299	48.50	63,001.50
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	150	89.18	13,377.00
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,240	59.94	74,325.60
	CAE INC	753	28.53	21,483.09
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	150	103.75	15,562.50
	WSP GLOBAL INC	330	179.32	59,175.60
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	503	40.61	20,426.83
	RB GLOBAL INC	520	86.72	45,094.40
	THOMSON REUTERS CORP	523	167.91	87,816.93

AIR CANADA	550	16.18	8,899.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,470	146.57	215,457.90
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	2,370	96.20	227,994.00
TFI INTERNATIONAL INC	260	150.00	39,000.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	590	68.86	40,627.40
GILDAN ACTIVEWEAR INC	660	39.12	25,819.20
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	900	92.83	83,547.00
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	139	136.24	18,937.36
DOLLARAMA INC	650	96.06	62,439.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	2,130	73.81	157,215.30
LOBLAW COMPANIES LTD	480	111.54	53,539.20
METRO INC	776	70.22	54,490.72
WESTON (GEORGE) LTD	220	146.71	32,276.20
SAPUTO INC	748	26.97	20,173.56
BANK OF MONTREAL	1,980	104.77	207,444.60
BANK OF NOVA SCOTIA	3,020	55.97	169,029.40
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	2,540	48.19	122,402.60
NATIONAL BANK OF CANADA	855	85.24	72,880.20
ROYAL BANK OF CANADA	3,500	109.11	381,885.00
TORONTO-DOMINION BANK	4,810	76.92	369,985.20
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	980	41.11	40,287.80
BROOKFIELD CORP	3,460	41.11	142,240.60
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	1,200	18.87	22,644.00
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	150	19.31	2,896.50
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	60	1,122.93	67,375.80
GREAT-WEST LIFECO INC	917	37.70	34,570.90
IA FINANCIAL CORP INC	390	79.28	30,919.20
INTACT FINANCIAL CORP	473	193.96	91,743.08
MANULIFE FINANCIAL CORP	4,570	23.88	109,131.60
POWER CORP OF CANADA	1,536	32.58	50,042.88
SUN LIFE FINANCIAL INC	1,430	62.74	89,718.20
CGI INC	605	132.09	79,914.45
CONSTELLATION SOFTWARE INC	60	2,781.31	166,878.60
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	270	98.32	26,546.40
OPEN TEXT CORP	973	45.67	44,436.91
SHOPIFY INC - CLASS-A	3,050	66.90	204,045.00

	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	971	52.00	50,492.00	
	TELUS CORP	1,220	22.28	27,181.60	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	1,915	6.94	13,290.10	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	411	33.02	13,571.22	
	EMERA INC	675	45.76	30,888.00	
	FORTIS INC	1,170	54.48	63,741.60	
	HYDRO ONE LTD	950	35.07	33,316.50	
	FIRSTSERVICE CORP	137	190.12	26,046.44	
加ドル小計		104,097		5,910,723.10 (643,263,994)	
ユーロ	ENI SPA	6,090	15.42	93,907.80	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,090	14.35	15,646.95	
	NESTE OYJ	1,076	29.22	31,440.72	
	OMV AG	430	40.84	17,561.20	
	REPSOL SA	3,620	14.45	52,309.00	
	TENARIS SA	1,520	15.34	23,316.80	
	TOTALENERGIES SE	5,700	62.20	354,540.00	
	AIR LIQUIDE SA	1,310	156.74	205,329.40	
	AKZO NOBEL	468	61.42	28,744.56	
	ARCELORMITTAL	1,590	20.90	33,231.00	
	ARKEMA	208	83.60	17,388.80	
	BASF SE	2,440	40.58	99,027.40	
	COVESTRO AG	543	48.75	26,471.25	
	DSM-FIRMENICH AG	480	76.28	36,614.40	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	333	67.84	22,590.72	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	739	29.85	22,059.15	
	SOLVAY SA	192	95.98	18,428.16	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	1,558	11.00	17,138.00	
	SYMRISE AG	420	94.12	39,530.40	
	UMICORE	604	22.23	13,426.92	
	UPM-KYMMENE OYJ	1,438	31.89	45,857.82	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	774	32.51	25,162.74	
	AIRBUS GROUP SE	1,520	125.04	190,060.80	
	ALSTOM	875	11.92	10,430.00	
	BOUYGUES SA	730	31.27	22,827.10	
	BRENTAG SE	402	68.22	27,424.44	

CNH INDUSTRIAL NV	2,756	10.58	29,158.48
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	1,050	49.90	52,400.25
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	1,179	29.96	35,322.84
EIFFAGE	260	82.70	21,502.00
FERROVIAL SE	1,472	27.61	40,641.92
IMCD NV	150	111.65	16,747.50
KINGSPAN GROUP PLC	450	62.04	27,918.00
KNORR-BREMSE AG	225	53.82	12,109.50
KONE OYJ-B	899	39.50	35,510.50
LEGRAND SA	680	81.02	55,093.60
METSO CORPORATION	2,350	8.85	20,816.30
MTU AERO ENGINES AG	140	178.40	24,976.00
PRYSMIAN SPA	690	33.84	23,349.60
RATIONAL AG	15	544.00	8,160.00
RHEINMETALL AG	140	266.70	37,338.00
SAFRAN SA	880	148.48	130,662.40
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,370	139.98	191,772.60
SIEMENS AG-REG	1,920	126.96	243,763.20
SIEMENS ENERGY AG	1,430	10.65	15,229.50
THALES SA	278	142.05	39,489.90
VINCI SA	1,500	100.76	151,140.00
WARTSILA OYJ ABP	1,289	9.67	12,469.78
BUREAU VERITAS SA	1,035	22.62	23,411.70
RANDSTAD NV	417	48.76	20,332.92
TELEPERFORMANCE	160	108.70	17,392.00
WOLTERS KLUWER	750	120.50	90,375.00
ADP	93	103.30	9,606.90
AENA SA	247	135.30	33,419.10
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,970	6.75	13,311.29
DEUTSCHE POST AG-REG	2,730	36.78	100,409.40
GETLINK	1,010	14.52	14,670.25
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	820	91.38	74,931.60
CONTINENTAL AG	268	59.68	15,994.24
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	300	86.52	25,956.00
FERRARI NV	380	284.50	108,110.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	2,290	61.38	140,560.20

MICHELIN (CGDE)	2,170	27.28	59,197.60
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	404	43.19	17,448.76
RENAULT SA	700	32.54	22,781.50
STELLANTIS NV	5,240	17.77	93,156.72
VALEO SA	686	12.28	8,427.51
VOLKSWAGEN AG-PFD	580	100.80	58,464.00
ADIDAS AG	390	171.50	66,885.00
HERMES INTERNATIONAL	90	1,776.40	159,876.00
KERING	180	393.30	70,794.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	710	679.10	482,161.00
MONCLER SPA	532	53.28	28,344.96
PUMA SE	260	54.92	14,279.20
ACCOR SA	541	30.09	16,278.69
AMADEUS IT GROUP SA	1,320	54.04	71,332.80
DELIVERY HERO SE	387	23.61	9,139.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	443	148.50	65,785.50
SODEXO	273	97.30	26,562.90
PUBLICIS GROUPE	760	72.76	55,297.60
SCOUT24 SE	240	58.34	14,001.60
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	2,083	25.48	53,074.84
VIVENDI SE	2,083	8.41	17,526.36
D' IETEREN GROUP	80	138.00	11,040.00
INDITEX	2,980	34.10	101,618.00
PROSUS NV	3,879	26.37	102,289.23
ZALANDO SE	601	21.80	13,101.80
CARREFOUR SA	1,713	15.61	26,748.49
HELLOFRESH SE	442	24.34	10,758.28
KESKO OYJ-B SHS	643	15.14	9,735.02
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	2,610	27.85	72,688.50
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	2,320	51.10	118,552.00
DANONE	1,720	54.87	94,376.40
HEINEKEN HOLDING NV	280	72.55	20,314.00
HEINEKEN NV	730	85.52	62,429.60
KERRY GROUP PLC-A	390	75.42	29,413.80
PERNOD-RICARD SA	590	169.70	100,123.00
BEIERSDORF AG	350	124.35	43,522.50

HENKEL AG & CO KGAA	373	59.50	22,193.50
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	404	67.98	27,463.92
L' OREAL	620	399.20	247,504.00
AMPLIFON SPA	380	27.29	10,370.20
BIOMERIEUX	146	87.68	12,801.28
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	135	75.38	10,176.30
ESSILORLUXOTTICA	790	168.58	133,178.20
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	585	31.80	18,603.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	1,254	24.98	31,324.92
KONINKLIJKE PHILIPS NV	2,485	17.38	43,209.18
SIEMENS HEALTHINEERS AG	723	47.83	34,581.09
ARGENX SE	140	446.40	62,496.00
BAYER AG-REG	2,730	41.03	112,025.55
EUROFINS SCIENTIFIC	362	45.74	16,557.88
GRIFOLS SA	713	10.05	7,169.21
IPSEN	120	119.60	14,352.00
MERCK KGAA	370	144.60	53,502.00
QIAGEN N. V.	550	35.04	19,272.00
SANOFI	2,900	101.02	292,958.00
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	60	224.50	13,470.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	76	166.00	12,616.00
UCB SA	450	72.08	32,436.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	809	12.69	10,270.25
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	14,140	7.43	105,060.20
BANCO SANTANDER SA	38,920	3.46	134,702.12
BANK OF IRELAND GROUP PLC	3,690	8.58	31,674.96
BNP PARIBAS	2,490	56.18	139,888.20
CAIXABANK S. A	11,895	3.63	43,202.64
COMMERZBANK AG	2,690	10.06	27,074.85
CREDIT AGRICOLE SA	3,122	11.26	35,159.96
ERSTE GROUP BANK AG	820	32.74	26,846.80
FINECOBANK SPA	1,495	10.94	16,355.30
ING GROEP NV-CVA	9,000	12.04	108,378.00
INTESA SANPAOLO	40,460	2.35	95,323.76
KBC GROEP NV	743	51.44	38,219.92
MEDIOBANCA SPA	1,030	11.01	11,340.30

SOCIETE GENERALE	1,600	20.90	33,448.00
UNICREDIT SPA	5,231	22.49	117,671.34
ADYEN NV	60	646.20	38,772.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	5,491	10.27	56,436.49
DEUTSCHE BOERSE AG	530	155.80	82,574.00
EDENRED	658	50.94	33,518.52
EURONEXT NV	330	65.50	21,615.00
EXOR NV	344	81.20	27,932.80
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	230	68.80	15,824.00
NEXI SPA	1,336	5.45	7,291.88
WORLDLINE SA	704	9.41	6,628.86
AEGON LTD	4,432	4.49	19,917.40
AGEAS	414	36.12	14,953.68
ALLIANZ SE-REG	1,070	220.15	235,560.50
ASSICURAZIONI GENERALI	2,840	18.38	52,199.20
AXA SA	4,660	27.59	128,569.40
HANNOVER RUECK SE-REG	148	211.40	31,287.20
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	380	382.50	145,350.00
NN GROUP NV	906	29.50	26,727.00
SAMPO OYJ-A SHS	1,336	37.94	50,687.84
CAP GEMINI SA	390	165.05	64,369.50
DASSAULT SYSTEMES SE	1,860	37.77	70,252.20
NEMETSCHEK SE	178	68.50	12,193.00
SAP SE	2,650	125.00	331,250.00
NOKIA OYJ	14,570	3.05	44,438.50
CELLNEX TELECOM SA	1,417	26.94	38,173.98
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	7,980	20.48	163,470.30
ELISA OYJ	390	40.20	15,678.00
KONINKLIJKE KPN NV	9,792	3.15	30,913.34
ORANGE S. A.	5,254	10.87	57,153.01
TELECOM ITALIA SPA	22,100	0.23	5,281.90
TELEFONICA SA	16,440	3.57	58,756.56
E. ON SE	5,959	11.10	66,144.90
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	9,250	3.80	35,168.50
ENDESA SA	822	17.94	14,750.79
ENEL SPA	23,420	5.75	134,711.84

	ENGIE	4,990	14.85	74,121.46
	FORTUM OYJ	1,026	10.96	11,244.96
	IBERDROLA SA	15,580	10.53	164,057.40
	REDEIA CORP SA	1,450	15.15	21,974.75
	RWE AG	1,700	35.31	60,027.00
	SNAM SPA	7,266	4.39	31,912.27
	TERNA SPA	4,271	7.27	31,050.17
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	2,070	25.41	52,598.70
	VERBUND AG	152	82.85	12,593.20
	ASM INTERNATIONAL NV	116	383.60	44,497.60
	ASML HOLDING NV	1,040	560.70	583,128.00
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	180	88.28	15,890.40
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	3,220	28.76	92,623.30
	STMICROELECTRONICS NV	1,810	37.12	67,196.25
	LEG IMMOBILIEN SE	250	54.86	13,715.00
	VONOVIA SE	2,310	20.22	46,708.20
ユーロ小計		459,416		11,296,811.74 (1,792,804,023)
英ポンド	BP PLC	43,690	5.34	233,610.43
	SHELL PLC-NEW	17,220	27.18	468,039.60
	ANGLO AMERICAN PLC	3,620	20.78	75,241.70
	ANTOFAGASTA PLC	1,183	13.46	15,929.09
	CRH PLC	1,820	44.58	81,135.60
	CRODA INTERNATIONAL PLC	385	41.41	15,942.85
	GLENCORE PLC	28,610	4.39	125,826.78
	JOHNSON MATTHEY PLC	515	14.46	7,449.47
	MONDI PLC	1,379	12.74	17,568.46
	RIO TINTO PLC	2,710	51.57	139,754.70
	ASHTED GROUP PLC	1,030	47.13	48,543.90
	BAE SYSTEMS PLC ORD	8,010	10.95	87,749.55
	BUNZL PLC	865	28.50	24,652.50
	DCC PLC	217	44.26	9,604.42
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	23,501	2.03	47,707.03
	SMITHS GROUP PLC	845	15.58	13,169.32
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	235	80.58	18,936.30
	EXPERIAN PLC	2,560	24.26	62,105.60

INTERTEK GROUP PLC	590	39.89	23,535.10
RELX PLC	5,400	28.61	154,494.00
RENTOKIL INITIAL PLC	5,870	4.54	26,685.02
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	2,356	4.01	9,452.27
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	290	39.57	11,475.30
BURBERRY GROUP PLC	993	17.20	17,084.56
PERSIMMON PLC	994	9.60	9,546.37
TAYLOR WIMPEY PLC	6,807	1.06	7,242.64
COMPASS GROUP PLC	5,060	20.46	103,527.60
ENTAIN PLC	1,657	9.25	15,337.19
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	510	59.20	30,192.00
PEARSON PLC	1,530	9.22	14,106.60
WHITBREAD PLC	639	32.96	21,061.44
AUTO TRADER GROUP PLC	2,915	6.08	17,734.86
INFORMA PLC	4,393	7.05	30,997.00
WPP PLC	3,319	6.91	22,934.29
JD SPORTS FASHION PLC	8,520	1.26	10,752.24
KINGFISHER PLC	6,190	2.01	12,485.23
NEXT PLC	260	68.64	17,846.40
OCADO GROUP PLC	1,268	4.60	5,832.80
TESCO PLC	20,870	2.72	56,829.01
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	857	19.66	16,852.90
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	5,510	24.63	135,711.30
COCA-COLA HBC AG-CDI	556	21.57	11,992.92
DIAGEO PLC	5,750	31.43	180,751.25
IMPERIAL BRANDS PLC	2,070	17.36	35,945.55
HALEON PLC	14,310	3.34	47,874.10
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,820	56.78	103,339.60
UNILEVER PLC	6,500	40.13	260,877.50
SMITH & NEPHEW PLC	1,973	9.17	18,108.19
ASTRAZENECA PLC	3,990	105.46	420,785.40
GSK PLC	10,270	14.83	152,324.64
BARCLAYS PLC	42,590	1.33	56,738.39
HSBC HOLDINGS PLC	50,700	6.15	311,855.70
LLOYDS BANKING GROUP PLC	182,920	0.41	75,838.63
NATWEST GROUP PLC	16,560	2.06	34,212.96

	STANDARD CHARTERED PLC	6,440	7.14	45,981.60
	3I GROUP PLC	2,819	19.96	56,267.24
	ABRDN PLC	6,446	1.52	9,801.14
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	913	6.92	6,325.26
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	1,020	82.84	84,496.80
	ST JAMES' S PLACE PLC	1,607	6.10	9,815.55
	WISE PLC - A	1,551	6.70	10,391.70
	ADMIRAL GROUP PLC	280	24.74	6,927.20
	AVIVA PLC	7,600	3.95	30,042.80
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	19,020	2.06	39,314.34
	PRUDENTIAL PLC	6,840	8.32	56,949.84
	SAGE GROUP PLC/THE	3,107	9.64	29,976.33
	HALMA PLC	1,095	18.30	20,043.97
	BT GROUP PLC	16,090	1.11	17,964.48
	VODAFONE GROUP PLC	76,320	0.73	56,400.48
	CENTRICA PLC	15,090	1.57	23,751.66
	NATIONAL GRID PLC	9,140	9.76	89,242.96
	SEVERN TRENT PLC	682	25.73	17,547.86
	SSE PLC	2,750	16.08	44,220.00
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,628	10.45	17,020.74
英ボンド小計		745,640		4,647,810.20 (844,600,069)
スイスフラン	GIVAUDAN-REG	20	2,852.00	57,040.00
	HOLCIM LTD	1,260	55.78	70,282.80
	SIG GROUP AG	1,130	19.46	21,989.80
	SIKA AG-REG	410	212.00	86,920.00
	ABB LTD-REG	4,550	29.80	135,590.00
	GEBERIT AG-REG	96	416.40	39,974.40
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	145	181.40	26,303.00
	VAT GROUP AG	70	324.70	22,729.00
	ADECCO GROUP AG-REG	419	33.70	14,120.30
	SGS SA-REG	425	74.56	31,688.00
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	164	240.40	39,425.60
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	1,320	107.00	141,240.00
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	95	229.50	21,802.50
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	10	1,347.00	13,470.00

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	4	10,010.00	40,040.00	
	NESTLE SA-REG	6,900	98.55	679,995.00	
	ALCON INC	1,390	64.62	89,821.80	
	SONOVA HOLDING AG-REG	153	212.30	32,481.90	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	290	112.45	32,610.50	
	BACHEM HOLDING AG	120	64.05	7,686.00	
	LONZA GROUP AG-REG	220	315.00	69,300.00	
	NOVARTIS AG-REG	5,260	85.82	451,413.20	
	ROCHE HOLDING AG-BR	90	253.40	22,806.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,790	237.55	425,214.50	
	SANDOZ GROUP AG	1,052	25.76	27,104.78	
	JULIUS BAER GROUP LTD	579	53.44	30,941.76	
	PARTNERS GROUP HOLDIING AG	63	955.20	60,177.60	
	UBS GROUP AG-REG	8,520	21.44	182,668.80	
	BALOISE HOLDING AG - REG	160	128.30	20,528.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	87	568.60	49,468.20	
	SWISS RE AG	890	97.68	86,935.20	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	370	426.40	157,768.00	
	TEMENOS AG	155	64.12	9,938.60	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	484	69.80	33,783.20	
	SWISSCOM AG-REG	80	534.00	42,720.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	220	82.75	18,205.00	
	スイスフラン小計	38,991		3,294,183.44 (551,643,958)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	620	278.80	172,856.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	1,812	148.70	269,444.40	
	ALFA LAVAL AB	950	351.50	333,925.00	
	ASSA ABLOY AB-B	2,713	233.20	632,671.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	7,240	143.30	1,037,492.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	4,540	124.65	565,911.00	
	EPIROC AB-A	1,540	192.35	296,219.00	
	EPIROC AB-B	1,322	162.80	215,221.60	
	HUSQVARNA AB-B SHS	1,126	71.26	80,238.76	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	349	185.50	64,739.50	
	LIFCO AB-B SHS	830	192.90	160,107.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	3,908	63.04	246,360.32	

	SANDVIK AB	3,052	187.65	572,707.80	
	SKANSKA AB-B SHS	1,056	159.45	168,379.20	
	SKF AB-B SHARES-B	1,125	175.55	197,493.75	
	VOLVO AB-B SHS-B	4,680	218.40	1,022,112.00	
	EVOLUTION AB	458	1,053.60	482,548.80	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	2,248	149.00	334,952.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,708	237.60	405,820.80	
	GETINGE AB-B SHS	650	197.20	128,180.00	
	NORDEA BANK ABP	9,480	117.50	1,113,900.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	4,444	123.35	548,167.40	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	4,361	96.04	418,830.44	
	SWEDBANK AB - A SHARES	2,590	191.60	496,244.00	
	EQT AB	830	201.80	167,494.00	
	INVESTOR AB-B SHS	5,200	202.00	1,050,400.00	
	ERICSSON LM-B SHS	7,741	49.54	383,527.84	
	HEXAGON AB-B SHS	4,850	94.54	458,519.00	
	TELE2 AB-B SHS	1,460	78.26	114,259.60	
	TELIA CO AB	8,145	23.84	194,176.80	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	2,238	43.72	97,845.36	
スウェーデンクローナ小計		93,266		12,430,744.97	(167,317,827)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	1,130	310.70	351,091.00	
	EQUINOR ASA	2,610	370.05	965,830.50	
	NORSK HYDRO A S	4,055	59.94	243,056.70	
	YARA INTERNATIONAL ASA	429	360.20	154,525.80	
	ADEVINTA ASA	778	95.40	74,221.20	
	MOWI ASA	1,466	176.95	259,408.70	
	DNB BANK ASA	2,870	200.00	574,000.00	
	TELENOR ASA	2,000	115.95	231,900.00	
ノルウェークローネ小計		15,338		2,854,033.90	(38,215,513)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	320	423.30	135,456.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	602	277.80	167,235.60	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,706	147.72	399,730.32	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	10	11,330.00	113,300.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	10	11,550.00	115,500.00	

	DSV A/S	490	974.80	477,652.00
	PANDORA A/S	160	813.40	130,144.00
	CARLSBERG AS-B	293	869.20	254,675.60
	COLOPLAST-B	302	731.60	220,943.20
	DEMANT A/S	302	264.10	79,758.20
	GENMAB A/S	200	2,036.00	407,200.00
	NOVO NORDISK A/S-B	8,400	692.40	5,816,160.00
	DANSKE BANK A/S	2,079	155.55	323,388.45
	TRYG A/S	530	137.25	72,742.50
	ORSTED A/S	528	332.50	175,560.00
	デンマーククローネ小計	16,932		8,889,445.87 (188,989,619)
豪ドル	AMPOL LTD	730	32.94	24,046.20
	SANTOS LTD	8,590	7.77	66,744.30
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	5,000	34.89	174,450.00
	BHP GROUP LTD	12,840	44.72	574,204.80
	BLUESCOPE STEEL LTD	1,660	18.49	30,693.40
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	4,520	22.02	99,530.40
	IGO LTD	2,620	10.85	28,427.00
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	1,306	39.11	51,077.66
	MINERAL RESOURCES LTD	530	60.09	31,847.70
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	3,384	12.10	40,946.40
	PILBARA MINERALS LTD	8,230	3.88	31,932.40
	RIO TINTO LTD	710	116.27	82,551.70
	SOUTH32 LTD	12,462	3.25	40,501.50
	BRAMBLES LTD	3,858	14.30	55,169.40
	COMPUTERSHARE LTD	1,410	25.19	35,517.90
	AURIZON HOLDINGS LTD	5,319	3.44	18,297.36
	TRANSURBAN GROUP	8,520	11.96	101,899.20
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,665	40.37	67,216.05
	IDP EDUCATION LTD	750	21.10	15,825.00
	LOTTERY CORP LTD/THE	7,922	4.47	35,411.34
	SEEK LTD	1,090	21.30	23,217.00
	WESFARMERS LTD	3,000	50.82	152,460.00
	COLES GROUP LTD	3,500	14.95	52,325.00
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	5,040	4.98	25,099.20

	WOOLWORTHS GROUP LTD	2,800	35.63	99,764.00	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	2,315	11.95	27,664.25	
	COCHLEAR LTD	160	244.48	39,116.80	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	450	49.51	22,279.50	
	SONIC HEALTHCARE LTD	1,188	28.77	34,178.76	
	CSL LTD	1,210	236.05	285,620.50	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	7,630	24.85	189,605.50	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	4,220	97.35	410,817.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	8,460	28.32	239,587.20	
	WESTPAC BANKING CORP	9,660	20.80	200,928.00	
	ASX LTD	514	55.60	28,578.40	
	MACQUARIE GROUP LTD	1,070	163.46	174,902.20	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	8,157	5.66	46,168.62	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	7,650	3.49	26,698.50	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	3,874	15.39	59,620.86	
	SUNCORP GROUP LTD	4,089	13.50	55,201.50	
	WISETECH GLOBAL LTD	485	59.95	29,075.75	
	XERO LTD	420	108.45	45,549.00	
	TELSTRA GROUP LTD	10,933	3.87	42,310.71	
	APA GROUP	3,040	8.07	24,532.80	
	ORIGIN ENERGY LTD	3,430	9.10	31,213.00	
	豪ドル小計	186,411		3,972,803.76 (374,992,946)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	3,190	7.57	24,148.30	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	1,488	20.60	30,652.80	
	MERCURY NZ LTD	2,262	5.87	13,277.94	
	MERIDIAN ENERGY LTD	3,409	4.85	16,550.69	
	ニュージーランドドル小計	10,349		84,629.73 (7,353,477)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	7,690	39.25	301,832.50	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	4,000	70.35	281,400.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	6,000	8.99	53,940.00	
	MTR CORP	5,500	29.80	163,900.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	3,000	11.92	35,760.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	6,161	43.95	270,775.95	
	SANDS CHINA LTD	7,650	21.30	162,945.00	

	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	5,100	14.62	74,562.00	
	WH GROUP LTD	25,500	4.34	110,670.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	10,731	20.60	221,058.60	
	HANG SENG BANK LTD	2,150	89.00	191,350.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	3,471	278.20	965,632.20	
	AIA GROUP LTD	29,140	67.00	1,952,380.00	
	CLP HOLDINGS LTD	4,694	56.25	264,037.50	
	HONG KONG & CHINA GAS	32,768	5.47	179,240.96	
	POWER ASSETS HOLDINGS	4,000	37.25	149,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	5,073	38.90	197,339.70	
	ESR GROUP LTD	5,400	10.62	57,348.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	4,750	14.22	67,545.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	4,433	79.50	352,423.50	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	5,000	27.65	138,250.00	
香港ドル小計		182,211		6,191,390.91 (118,936,619)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	5,283	6.21	32,807.43	
	SEATRUM LTD	100,826	0.11	11,494.16	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	4,100	6.18	25,338.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	6,300	3.45	21,735.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	5,302	33.15	175,761.30	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	9,508	12.84	122,082.72	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	3,242	27.72	89,868.24	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	26,600	2.38	63,308.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	8,911	3.01	26,822.11	
シンガポールドル小計		170,072		569,216.96 (62,334,949)	
イスラエルシェケル	ICL GROUP LTD	2,760	19.79	54,620.40	
	BANK HAPOALIM BM	4,308	28.41	122,390.28	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	3,780	24.97	94,386.60	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	4,790	17.13	82,052.70	
	NICE LTD	172	641.50	110,338.00	
イスラエルシェケル小計		15,810		463,787.98 (17,137,197)	
合 計		2,914,401		18,864,148,524 (18,864,148,524)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	409	37,623.91	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	800	26,160.00	
		AMERICAN TOWER CORP	1,180	191,077.40	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	1,163	17,526.41	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	410	67,723.80	
		BOSTON PROPERTIES INC	500	26,080.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	291	26,623.59	
		CROWN CASTLE INC	1,060	92,495.60	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	840	98,246.40	
		EQUINIX INC	250	170,560.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	497	32,021.71	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	1,040	57,980.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	175	36,795.50	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	600	61,848.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	640	28,870.40	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1,820	29,848.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	1,967	30,685.20	
		INVITATION HOMES INC	1,640	49,724.80	
		IRON MOUNTAIN INC	818	47,746.66	
		KIMCO REALTY CORP	1,600	26,208.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	300	38,214.00	
		PROLOGIS INC	2,350	232,039.00	
		PUBLIC STORAGE	390	92,816.10	
		REALTY INCOME CORP	1,740	85,747.20	
		REGENCY CENTERS CORP	482	27,869.24	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	310	60,670.10	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	890	93,432.20	
		SUN COMMUNITIES INC	317	32,641.49	
UDR INC	827	28,109.73			
VENTAS INC	1,190	49,170.80			
VICI PROPERTIES INC	2,730	75,238.80			

		WELLTOWER INC	1,250	103,337.50	
		WEYERHAEUSER CO	1,690	48,350.90	
		WP CAREY INC	594	31,190.94	
米ドル小計			32,760	2,154,673.38 (323,804,315)	
ユーロ	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	351	14,931.54	
ユーロ小計			351	14,931.54 (2,369,635)	
英ポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	1,694	9,476.23	
		SEGRO PLC	3,361	23,036.29	
英ポンド小計			5,055	32,512.52 (5,908,175)	
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	2,875	19,262.50	
		GOODMAN GROUP	4,311	89,367.03	
		GPT GROUP	5,900	21,417.00	
		LENDLEASE GROUP	1,550	9,780.50	
		MIRVAC GROUP	11,628	22,616.46	
		SCENTRE GROUP	15,350	37,300.50	
		STOCKLAND	5,114	18,666.10	
		VICINITY CENTRES	10,480	18,025.60	
豪ドル小計			57,208	236,435.69 (22,317,164)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	6,680	239,812.00	
香港ドル小計			6,680	239,812.00 (4,606,788)	
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	10,162	25,506.62	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	17,278	29,372.60	
		KEPPEL REIT(N)	1,056	834.24	
シンガポールドル小計			28,496	55,713.46 (6,101,181)	
合計				365,107,258 (365,107,258)	

(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 595 銘柄	97.7%	—	73.2%
	投資証券 34 銘柄	—	2.3%	1.7%
加ドル	株式 75 銘柄	100.0%	—	3.3%
ユーロ	株式 186 銘柄	99.9%	—	9.3%
	投資証券 1 銘柄	—	0.1%	0.0%
英ポンド	株式 74 銘柄	99.3%	—	4.4%
	投資証券 2 銘柄	—	0.7%	0.0%
スイスフラン	株式 36 銘柄	100.0%	—	2.9%
スウェーデンクローナ	株式 31 銘柄	100.0%	—	0.9%
ノルウェークローネ	株式 8 銘柄	100.0%	—	0.2%
デンマーククローネ	株式 15 銘柄	100.0%	—	1.0%
豪ドル	株式 45 銘柄	94.4%	—	2.0%
	投資証券 8 銘柄	—	5.6%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 4 銘柄	100.0%	—	0.0%
香港ドル	株式 21 銘柄	96.3%	—	0.6%
	投資証券 1 銘柄	—	3.7%	0.0%
シンガポールドル	株式 9 銘柄	91.1%	—	0.3%
	投資証券 3 銘柄	—	8.9%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 5 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)

	2022年10月26日現在	2023年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	38,142,474	35,789,646
国債証券	39,782,689,370	44,169,559,480
地方債証券	3,556,850,650	2,728,710,400
特殊債券	3,528,619,000	2,503,274,000
社債券	603,631,000	1,296,449,000
未収利息	81,611,164	89,566,486
前払費用	737,116	1,975,856
流動資産合計	47,592,280,774	50,825,324,868
資産合計	47,592,280,774	50,825,324,868
負債の部		
流動負債		
未払解約金	14,845,556	39,615,852
未払利息	62	12
流動負債合計	14,845,618	39,615,864
負債合計	14,845,618	39,615,864
純資産の部		
元本等		
元本	35,139,813,158	38,462,644,652
剰余金		
剰余金又は欠損金(△)	12,437,621,998	12,323,064,352
元本等合計	47,577,435,156	50,785,709,004
純資産合計	47,577,435,156	50,785,709,004
負債純資産合計	47,592,280,774	50,825,324,868

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)

		2022年10月26日現在	2023年10月26日現在
1.	期首	2021年10月27日	2022年10月27日
	期首元本額	34,479,945,047円	35,139,813,158円
	期首からの追加設定元本額	4,247,701,412円	4,986,525,327円
	期首からの一部解約元本額	3,587,833,301円	1,663,693,833円
	元本の内訳 ※		
	DCインデックスバランス（株式20）	4,815,944,655円	5,672,585,007円
	DCインデックスバランス（株式40）	4,446,314,480円	5,467,454,315円
	DCインデックスバランス（株式60）	3,280,760,207円	4,301,495,149円
	DCインデックスバランス（株式80）	537,618,854円	771,286,086円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	2,209,280,459円	2,204,907,921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	4,488,925,161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）	1,615,057,133円	1,729,528,043円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	－円	13,139,320円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	－円	1,004,181円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	－円	1,124,075円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	3,381,046,243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）	1,480,910,178円	1,574,305,602円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,423,718,543円	1,578,117,566円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	807,219,661円	932,779,513円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	119,043,599円	141,132,311円
インデックスファンド日本債券（1年決算型）	6,161,581,877円	5,944,219,944円	
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	372,392,108円	408,919,917円	
計	35,139,813,158円	38,462,644,652円	
2.	受益権の総数	35,139,813,158口	38,462,644,652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 2021 年 10 月 27 日 至 2022 年 10 月 26 日	自 2022 年 10 月 27 日 至 2023 年 10 月 26 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

	2022 年 10 月 26 日現在	2023 年 10 月 26 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)

(2022 年 10 月 26 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△2,272,854,520
地方債証券	△23,007,350
特殊債券	△25,283,000
社債券	△3,852,000
合計	△2,324,996,870

(2023 年 10 月 26 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△1,676,287,920
地方債証券	△12,270,600
特殊債券	△17,214,000
社債券	△7,280,000
合計	△1,713,052,520

(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)

2022年10月26日現在		2023年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.3539円	1口当たり純資産額	1.3204円
(1万円当たり純資産額)	(13,539円)	(1万円当たり純資産額)	(13,204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	79,968,000	
	第450回利付国債(2年)	200,000,000	199,882,000	
	第451回利付国債(2年)	50,000,000	49,977,500	
	第149回利付国債(5年)	100,000,000	99,595,000	
	第150回利付国債(5年)	50,000,000	49,741,500	
	第152回利付国債(5年)	100,000,000	99,679,000	
	第153回利付国債(5年)	300,000,000	297,612,000	
	第157回利付国債(5年)	120,000,000	119,401,200	
	第158回利付国債(5年)	180,000,000	178,322,400	
	第159回利付国債(5年)	120,000,000	118,682,400	
	第160回利付国債(5年)	120,000,000	119,203,200	
	第1回利付国債(40年)	70,000,000	78,788,500	
	第2回利付国債(40年)	125,000,000	135,483,750	
	第3回利付国債(40年)	85,000,000	91,988,700	
	第4回利付国債(40年)	95,000,000	102,630,400	

第5回利付国債（40年）	95,000,000	98,477,000	
第6回利付国債（40年）	110,000,000	111,577,400	
第7回利付国債（40年）	130,000,000	125,716,500	
第8回利付国債（40年）	115,000,000	102,782,400	
第9回利付国債（40年）	180,000,000	116,620,200	
第10回利付国債（40年）	175,000,000	133,516,250	
第11回利付国債（40年）	140,000,000	102,425,400	
第12回利付国債（40年）	175,000,000	113,317,750	
第13回利付国債（40年）	180,000,000	115,126,200	
第14回利付国債（40年）	190,000,000	129,796,600	
第15回利付国債（40年）	210,000,000	158,207,700	
第16回利付国債（40年）	70,000,000	57,740,200	
第336回利付国債（10年）	180,000,000	181,094,400	
第337回利付国債（10年）	230,000,000	230,869,400	
第338回利付国債（10年）	390,000,000	392,172,300	
第339回利付国債（10年）	570,000,000	573,516,900	
第340回利付国債（10年）	620,000,000	624,054,800	
第341回利付国債（10年）	700,000,000	703,297,000	
第342回利付国債（10年）	630,000,000	630,000,000	
第343回利付国債（10年）	645,000,000	644,658,150	
第344回利付国債（10年）	700,000,000	699,090,000	
第345回利付国債（10年）	660,000,000	658,548,000	
第346回利付国債（10年）	660,000,000	657,881,400	
第347回利付国債（10年）	680,000,000	676,919,600	
第348回利付国債（10年）	500,000,000	497,005,000	
第349回利付国債（10年）	590,000,000	585,521,900	
第350回利付国債（10年）	540,000,000	534,967,200	
第351回利付国債（10年）	535,000,000	529,002,650	
第352回利付国債（10年）	520,000,000	513,120,400	
第353回利付国債（10年）	400,000,000	393,944,000	
第354回利付国債（10年）	325,000,000	319,429,500	
第355回利付国債（10年）	350,000,000	343,346,500	
第356回利付国債（10年）	350,000,000	342,566,000	
第357回利付国債（10年）	560,000,000	546,638,400	
第358回利付国債（10年）	590,000,000	574,306,000	
第359回利付国債（10年）	420,000,000	407,488,200	

第360回利付国債（10年）	580,000,000	560,784,600	
第361回利付国債（10年）	460,000,000	443,016,800	
第362回利付国債（10年）	400,000,000	383,800,000	
第363回利付国債（10年）	500,000,000	477,875,000	
第364回利付国債（10年）	500,000,000	475,940,000	
第365回利付国債（10年）	350,000,000	331,891,000	
第366回利付国債（10年）	400,000,000	381,268,000	
第367回利付国債（10年）	360,000,000	341,978,400	
第368回利付国債（10年）	390,000,000	369,330,000	
第369回利付国債（10年）	390,000,000	378,413,100	
第370回利付国債（10年）	420,000,000	406,854,000	
第371回利付国債（10年）	290,000,000	277,744,600	
第1回利付国債（30年）	50,000,000	56,784,000	
第3回利付国債（30年）	70,000,000	77,905,800	
第5回利付国債（30年）	80,000,000	88,904,800	
第6回利付国債（30年）	50,000,000	56,446,000	
第8回利付国債（30年）	170,000,000	184,376,900	
第9回利付国債（30年）	70,000,000	73,454,500	
第11回利付国債（30年）	170,000,000	183,209,000	
第13回利付国債（30年）	180,000,000	199,058,400	
第14回利付国債（30年）	108,000,000	123,692,400	
第15回利付国債（30年）	147,000,000	169,933,470	
第16回利付国債（30年）	35,000,000	40,497,450	
第17回利付国債（30年）	50,000,000	57,366,000	
第18回利付国債（30年）	110,000,000	125,074,400	
第19回利付国債（30年）	40,000,000	45,495,600	
第20回利付国債（30年）	40,000,000	46,404,400	
第21回利付国債（30年）	70,000,000	79,684,500	
第22回利付国債（30年）	70,000,000	81,309,900	
第23回利付国債（30年）	55,000,000	63,902,850	
第24回利付国債（30年）	68,000,000	79,021,440	
第25回利付国債（30年）	60,000,000	68,230,800	
第26回利付国債（30年）	170,000,000	195,343,600	
第27回利付国債（30年）	89,000,000	103,335,230	
第28回利付国債（30年）	144,000,000	167,078,880	
第29回利付国債（30年）	176,000,000	201,673,120	

第30回利付国債（30年）	147,000,000	166,174,680	
第31回利付国債（30年）	120,000,000	133,700,400	
第32回利付国債（30年）	160,000,000	180,161,600	
第33回利付国債（30年）	175,000,000	188,832,000	
第34回利付国債（30年）	160,000,000	176,913,600	
第35回利付国債（30年）	193,000,000	207,200,940	
第36回利付国債（30年）	195,000,000	208,605,150	
第37回利付国債（30年）	211,000,000	221,792,650	
第38回利付国債（30年）	165,000,000	170,134,800	
第39回利付国債（30年）	165,000,000	172,656,000	
第40回利付国債（30年）	130,000,000	133,420,300	
第41回利付国債（30年）	160,000,000	161,209,600	
第42回利付国債（30年）	135,000,000	135,926,100	
第43回利付国債（30年）	155,000,000	155,832,350	
第44回利付国債（30年）	150,000,000	150,696,000	
第45回利付国債（30年）	120,000,000	116,175,600	
第46回利付国債（30年）	160,000,000	154,614,400	
第47回利付国債（30年）	125,000,000	122,827,500	
第48回利付国債（30年）	85,000,000	80,353,050	
第49回利付国債（30年）	140,000,000	132,073,200	
第50回利付国債（30年）	145,000,000	120,415,250	
第51回利付国債（30年）	140,000,000	102,823,000	
第52回利付国債（30年）	130,000,000	99,921,900	
第53回利付国債（30年）	105,000,000	82,392,450	
第54回利付国債（30年）	110,000,000	90,256,100	
第55回利付国債（30年）	110,000,000	89,963,500	
第56回利付国債（30年）	140,000,000	114,125,200	
第57回利付国債（30年）	190,000,000	154,380,700	
第58回利付国債（30年）	140,000,000	113,384,600	
第59回利付国債（30年）	170,000,000	133,846,100	
第60回利付国債（30年）	120,000,000	98,964,000	
第61回利付国債（30年）	100,000,000	78,182,000	
第62回利付国債（30年）	120,000,000	88,640,400	
第63回利付国債（30年）	120,000,000	85,779,600	
第64回利付国債（30年）	100,000,000	71,183,000	
第65回利付国債（30年）	110,000,000	78,039,500	

第66回利付国債(30年)	180,000,000	127,063,800	
第67回利付国債(30年)	110,000,000	81,877,400	
第68回利付国債(30年)	140,000,000	103,812,800	
第69回利付国債(30年)	110,000,000	83,661,600	
第70回利付国債(30年)	110,000,000	83,436,100	
第71回利付国債(30年)	120,000,000	90,693,600	
第72回利付国債(30年)	160,000,000	120,593,600	
第73回利付国債(30年)	150,000,000	112,848,000	
第74回利付国債(30年)	130,000,000	106,072,200	
第75回利付国債(30年)	180,000,000	158,641,200	
第76回利付国債(30年)	150,000,000	135,376,500	
第77回利付国債(30年)	160,000,000	151,563,200	
第78回利付国債(30年)	150,000,000	135,216,000	
第79回利付国債(30年)	100,000,000	85,508,000	
第73回利付国債(20年)	113,000,000	115,634,030	
第74回利付国債(20年)	118,000,000	120,885,100	
第75回利付国債(20年)	10,000,000	10,292,800	
第76回利付国債(20年)	21,000,000	21,556,290	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	41,115,600	
第79回利付国債(20年)	160,000,000	165,200,000	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	62,326,800	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	136,520,800	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	317,253,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	16,951,520	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	265,587,500	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	63,635,400	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	63,662,400	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	53,220,500	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	88,169,680	
第96回利付国債(20年)	248,000,000	264,866,480	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	48,397,050	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	100,733,220	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	125,756,280	
第100回利付国債(20年)	30,000,000	32,465,100	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	71,995,440	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	88,673,130	

第103回利付国債（20年）	11,000,000	11,991,650	
第104回利付国債（20年）	33,000,000	35,673,000	
第105回利付国債（20年）	77,000,000	83,428,730	
第106回利付国債（20年）	2,000,000	2,176,620	
第107回利付国債（20年）	130,000,000	141,254,100	
第108回利付国債（20年）	134,000,000	144,246,980	
第109回利付国債（20年）	27,000,000	29,130,840	
第110回利付国債（20年）	98,000,000	106,769,040	
第111回利付国債（20年）	25,000,000	27,446,750	
第112回利付国債（20年）	80,000,000	87,388,800	
第113回利付国債（20年）	290,000,000	317,494,900	
第114回利付国債（20年）	52,000,000	57,047,120	
第115回利付国債（20年）	125,000,000	137,880,000	
第116回利付国債（20年）	135,000,000	149,219,550	
第117回利付国債（20年）	343,000,000	377,005,020	
第118回利付国債（20年）	70,000,000	76,581,400	
第119回利付国債（20年）	60,000,000	64,850,400	
第120回利付国債（20年）	170,000,000	181,561,700	
第121回利付国債（20年）	22,000,000	23,942,160	
第122回利付国債（20年）	17,000,000	18,387,880	
第123回利付国債（20年）	195,000,000	214,973,850	
第124回利付国債（20年）	90,000,000	98,602,200	
第125回利付国債（20年）	50,000,000	55,546,000	
第126回利付国債（20年）	105,000,000	115,122,000	
第127回利付国債（20年）	50,000,000	54,467,000	
第128回利付国債（20年）	65,000,000	70,840,900	
第129回利付国債（20年）	85,000,000	91,986,150	
第130回利付国債（20年）	150,000,000	162,288,000	
第131回利付国債（20年）	92,000,000	98,848,480	
第132回利付国債（20年）	135,000,000	145,069,650	
第133回利付国債（20年）	110,000,000	119,050,800	
第134回利付国債（20年）	120,000,000	129,950,400	
第135回利付国債（20年）	30,000,000	32,250,600	
第136回利付国債（20年）	220,000,000	234,674,000	
第137回利付国債（20年）	200,000,000	214,990,000	
第138回利付国債（20年）	120,000,000	126,998,400	

第139回利付国債（20年）	230,000,000	245,276,600	
第140回利付国債（20年）	318,000,000	342,199,800	
第141回利付国債（20年）	235,000,000	252,813,000	
第142回利付国債（20年）	165,000,000	178,911,150	
第143回利付国債（20年）	94,000,000	100,394,820	
第144回利付国債（20年）	330,000,000	349,420,500	
第145回利付国債（20年）	315,000,000	339,475,500	
第146回利付国債（20年）	195,000,000	210,132,000	
第147回利付国債（20年）	208,000,000	221,950,560	
第148回利付国債（20年）	180,000,000	190,173,600	
第149回利付国債（20年）	185,000,000	195,213,850	
第150回利付国債（20年）	210,000,000	219,223,200	
第151回利付国債（20年）	240,000,000	245,059,200	
第152回利付国債（20年）	250,000,000	254,852,500	
第153回利付国債（20年）	270,000,000	277,578,900	
第154回利付国債（20年）	160,000,000	162,451,200	
第155回利付国債（20年）	270,000,000	267,534,900	
第156回利付国債（20年）	160,000,000	147,060,800	
第157回利付国債（20年）	150,000,000	133,749,000	
第158回利付国債（20年）	170,000,000	156,882,800	
第159回利付国債（20年）	150,000,000	139,620,000	
第160回利付国債（20年）	140,000,000	131,467,000	
第161回利付国債（20年）	120,000,000	110,776,800	
第162回利付国債（20年）	150,000,000	137,883,000	
第163回利付国債（20年）	165,000,000	151,016,250	
第164回利付国債（20年）	255,000,000	229,012,950	
第165回利付国債（20年）	170,000,000	151,957,900	
第166回利付国債（20年）	150,000,000	137,479,500	
第167回利付国債（20年）	160,000,000	141,648,000	
第168回利付国債（20年）	140,000,000	121,422,000	
第169回利付国債（20年）	160,000,000	135,840,000	
第170回利付国債（20年）	140,000,000	118,204,800	
第171回利付国債（20年）	170,000,000	142,738,800	
第172回利付国債（20年）	230,000,000	195,421,800	
第173回利付国債（20年）	190,000,000	160,555,700	
第174回利付国債（20年）	200,000,000	168,074,000	

	第175回利付国債(20年)	180,000,000	153,149,400	
	第176回利付国債(20年)	190,000,000	160,903,400	
	第177回利付国債(20年)	200,000,000	165,492,000	
	第178回利付国債(20年)	220,000,000	184,657,000	
	第179回利付国債(20年)	190,000,000	158,707,000	
	第180回利付国債(20年)	190,000,000	166,973,900	
	第181回利付国債(20年)	190,000,000	169,438,200	
	第182回利付国債(20年)	200,000,000	184,152,000	
	第183回利付国債(20年)	190,000,000	183,756,600	
	第184回利付国債(20年)	170,000,000	155,575,500	
	第185回利付国債(20年)	130,000,000	118,511,900	
国債証券 合計		45,217,000,000	44,169,559,480	
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	99,725,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	102,633,000	
	第32回東京都公募公債(5年)	200,000,000	199,620,000	
	第739回東京都公募公債	100,000,000	100,229,000	
	第744回東京都公募公債	100,000,000	100,735,000	
	令和2年度第2回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,810,000	
	令和3年度第6回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,275,000	
	第214回神奈川県公募公債	100,000,000	100,704,000	
	平成27年度第10回静岡県公募公債	200,000,000	201,120,000	
	平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	103,046,000	
	平成26年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	100,427,000	
	第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,461,000	
	第142回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,610,000	
	第144回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,501,000	
	第147回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,684,000	
	第165回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,052,000	
	平成28年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	99,522,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	100,587,000	
	平成29年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	99,152,000	
	平成27年度第2回熊本県公募公債(10年)	100,000,000	100,598,000	
	第2回名古屋市定時償還公募公債(10年)	20,000,000	20,026,400	
	平成27年度第5回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	100,577,000	
	令和元年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	99,932,000	

	令和2年度第1回鹿児島県公募公債（5年）	100,000,000	99,684,000	
地方債証券 合計		2,720,000,000	2,728,710,400	
特殊債券	第5回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	99,509,000	
	第13回新関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	200,794,000	
	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	198,686,000	
	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,113,000	
	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	106,664,000	
	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	107,668,000	
	第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,397,000	
	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	100,459,000	
	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	99,525,000	
	第324回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	197,944,000	
	第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,624,000	
	第69回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,432,000	
	第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,566,000	
	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,318,000	
	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,218,000	
	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	98,517,000	
	第363回信金中金債（5年）	100,000,000	99,780,000	
	第395回信金中金債（5年）	100,000,000	98,976,000	
第29回国際協力機構債券	100,000,000	100,671,000		
第37回国際協力機構債券	100,000,000	99,413,000		
特殊債券 合計		2,500,000,000	2,503,274,000	
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	100,429,000	
	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	99,906,000	
	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	99,670,000	
	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	99,761,000	
	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	99,723,000	
	第11回株式会社セブン銀行無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,331,000	

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	99,619,000	
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	99,840,000	
第510回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	99,432,000	
第552回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,040,000	
第400回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	98,929,000	
第447回中国電力株式会社社債(一般担保付)(ト ランジションボンド)	100,000,000	98,911,000	
第31回沖縄電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	99,858,000	
社債券 合計	1,300,000,000	1,296,449,000	
合計	51,737,000,000	50,697,992,880	

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）

	2022年10月26日現在	2023年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	117,967,036	160,502,854
コール・ローン	69,590,695	80,759,786
国債証券	150,981,343,458	153,961,084,481
派生商品評価勘定	7,491	227,502
未収入金	74,008,274	-
未収利息	1,091,775,551	1,244,838,700
前払費用	46,505,846	72,483,897
流動資産合計	152,381,198,351	155,519,897,220
資産合計	152,381,198,351	155,519,897,220
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	72,386	24,377
未払解約金	106,989,541	121,462,048
未払利息	113	28
流動負債合計	107,062,040	121,486,453
負債合計	107,062,040	121,486,453
純資産の部		
元本等		
元本	57,575,300,165	57,315,428,247
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	94,698,836,146	98,082,982,520
元本等合計	152,274,136,311	155,398,410,767
純資産合計	152,274,136,311	155,398,410,767
負債純資産合計	152,381,198,351	155,519,897,220

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>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)

		2022 年 10 月 26 日現在	2023 年 10 月 26 日現在
1.	期首	2021 年 10 月 27 日	2022 年 10 月 27 日
	期首元本額	61,672,878,643 円	57,575,300,165 円
	期首からの追加設定元本額	3,281,227,327 円	3,716,701,373 円
	期首からの一部解約元本額	7,378,805,805 円	3,976,573,291 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）	16,794,261,878 円	18,929,458,764 円
	DC インデックスバランス（株式 20）	389,007,488 円	426,585,541 円
	DC インデックスバランス（株式 40）	515,032,949 円	595,287,919 円
	DC インデックスバランス（株式 60）	682,975,875 円	843,353,485 円
	DC インデックスバランス（株式 80）	560,018,801 円	757,207,482 円
	財産 3 分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	16,979,582,310 円	15,280,881,335 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	2,355,333,711 円	2,340,604,123 円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	13,154,930,712 円	12,133,636,705 円
	財産 3 分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	835,698,012 円	891,805,816 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）	144,328,916 円	143,812,763 円
	財産 3 分法（適格機関投資家専用）	203,841,699 円	316,658,443 円
	N i つみインデックスラップ世界 10 指数（均等型）	— 円	493,149 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	1,103,924 円
	財産 3 分法ファンド（不動産・債券・株式）奇数月分配型	— 円	591,254 円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	173,659,188 円	— 円
	国際分散型ファンド 40（適格機関投資家向け）	588,340,485 円	501,546,917 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 20）	58,797,064 円	59,299,022 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 40）	82,606,618 円	86,274,514 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 60）	84,495,854 円	91,903,491 円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式80)	62,113,777 円	69,258,250 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	3,607,947,517 円	3,511,904,503 円
海外債券インデックスファンド (個人型年金向け)	302,327,311 円	333,760,847 円
計	57,575,300,165 円	57,315,428,247 円
2. 受益権の総数	57,575,300,165 口	57,315,428,247 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 2021 年 10 月 27 日 至 2022 年 10 月 26 日	自 2022 年 10 月 27 日 至 2023 年 10 月 26 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

	2022 年 10 月 26 日現在	2023 年 10 月 26 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)

(2022 年 10 月 26 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	△29,029,728,271
合計	△29,029,728,271

(2023年10月26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	△5,555,230,909
合計	△5,555,230,909

(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)

(2022年10月26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	54,085,544	—	54,150,439	△64,895
	ユーロ	31,099,290	—	31,091,799	7,491
	英ポンド	10,623,129	—	10,678,865	△55,736
	豪ドル	12,363,125	—	12,379,775	△16,650
合計		54,085,544	—	54,150,439	△64,895

(2023年10月26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	65,975,344	—	65,772,219	203,125
	ユーロ	24,119,200	—	24,114,803	4,397
	英ポンド	15,865,494	—	15,807,195	58,299
	豪ドル	11,372,724	—	11,212,118	160,606
	中国元	14,617,926	—	14,638,103	△20,177
合計		65,975,344	—	65,772,219	203,125

(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)

2022年10月26日現在		2023年10月26日現在	
1口当たり純資産額	2,6448円	1口当たり純資産額	2,7113円
(1万円当たり純資産額)	(26,448円)	(1万円当たり純資産額)	(27,113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%-24/09/30	2,015,000.00	1,954,322.30	
		US TREASURY N/B-1.5%-24/09/30	2,200,000.00	2,121,633.80	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	5,190,000.00	5,027,044.38	
		US TREASURY N/B-1.5%-24/10/31	2,140,000.00	2,057,342.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	4,650,000.00	4,499,102.85	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,400,000.00	1,351,218.40	
		US TREASURY N/B-1.5%-24/11/30	3,470,000.00	3,326,182.38	
		US TREASURY N/B-4.5%-24/11/30	2,150,000.00	2,128,540.85	
		US TREASURY N/B-1.0%-24/12/15	2,450,000.00	2,332,380.40	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	1,832,719.10	
		US TREASURY N/B-1.75%-24/12/31	1,300,000.00	1,246,577.80	
		US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,448,085.00	
		US TREASURY N/B-1.375%-25/01/31	3,510,000.00	3,340,803.96	
		US TREASURY N/B-4.125%-25/01/31	1,190,000.00	1,172,265.43	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,530,000.00	4,340,392.32	
		US TREASURY N/B-1.5%-25/02/15	3,000,000.00	2,855,742.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	1,991,399.94	

US TREASURY N/B-1.125%-25/02/28	5,740,000.00	5,428,782.94	
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	2,010,000.00	1,936,194.81	
US TREASURY N/B-0.5%-25/03/31	3,470,000.00	3,242,551.91	
US TREASURY N/B-2.625%-25/04/15	2,600,000.00	2,503,056.40	
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,123,987.80	
US TREASURY N/B-0.375%-25/04/30	2,150,000.00	1,998,070.25	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	3,800,000.00	3,623,877.60	
US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,420,000.00	1,368,939.64	
US TREASURY N/B-0.25%-25/05/31	3,820,000.00	3,530,214.80	
US TREASURY N/B-2.875%-25/06/15	5,000,000.00	4,816,795.00	
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	1,370,000.00	1,315,868.56	
US TREASURY N/B-3.0%-25/07/15	5,000,000.00	4,819,920.00	
US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	1,440,000.00	1,383,749.28	
US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	3,000,000.00	2,751,912.00	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	4,730,000.00	4,471,789.30	
US TREASURY N/B-2.75%-25/08/31	3,000,000.00	2,871,795.00	
US TREASURY N/B-5.0%-25/08/31	5,000,000.00	4,983,590.00	
US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	4,200,000.00	4,034,625.00	
US TREASURY N/B-0.25%-25/09/30	1,570,000.00	1,430,784.96	
US TREASURY N/B-4.25%-25/10/15	170,000.00	167,164.40	
US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,343,343.40	
US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	2,110,000.00	1,915,236.45	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	3,440,000.00	3,249,320.80	
US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,261,836.84	
US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	3,420,000.00	3,101,779.26	
US TREASURY N/B-4.0%-25/12/15	210,000.00	205,356.90	
US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	1,899,374.00	
US TREASURY N/B-3.875%-26/01/15	1,150,000.00	1,120,979.75	
US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	1,753,740.80	
US TREASURY N/B-0.375%-26/01/31	3,000,000.00	2,701,875.00	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	1,835,506.80	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,310,000.00	3,065,109.65	
US TREASURY N/B-4.0%-26/02/15	3,000,000.00	2,930,976.00	
US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,690,150.22	
US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	3,650,000.00	3,286,281.15	
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	1,939,896.36	

US TREASURY N/B-0.75%-26/03/31	2,400,000.00	2,169,748.80	
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	1,050,000.00	985,072.20	
US TREASURY N/B-0.75%-26/04/30	2,740,000.00	2,467,282.32	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	4,840,000.00	4,449,392.64	
US TREASURY N/B-3.625%-26/05/15	6,750,000.00	6,527,459.25	
US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	2,740,000.00	2,549,216.54	
US TREASURY N/B-0.75%-26/05/31	2,800,000.00	2,512,560.40	
US TREASURY N/B-4.125%-26/06/15	3,000,000.00	2,935,194.00	
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	1,846,328.00	
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	960,000.00	883,536.96	
US TREASURY N/B-0.625%-26/07/31	3,260,000.00	2,897,960.70	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,638,124.00	
US TREASURY N/B-0.75%-26/08/31	3,000,000.00	2,666,952.00	
US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,475,147.70	
US TREASURY N/B-0.875%-26/09/30	2,000,000.00	1,781,014.00	
US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	250,000.00	226,796.75	
US TREASURY N/B-1.125%-26/10/31	3,950,000.00	3,530,620.60	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,040,000.00	2,786,704.16	
US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,400,000.00	2,172,655.20	
US TREASURY N/B-1.25%-26/11/30	2,210,000.00	1,977,258.27	
US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	1,813,828.00	
US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	4,000,000.00	3,588,280.00	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	2,680,000.00	2,461,829.24	
US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,530,000.00	1,352,555.19	
US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	2,700,000.00	2,336,026.50	
US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	2,450,000.00	2,102,357.25	
US TREASURY N/B-2.75%-27/04/30	1,430,000.00	1,329,675.49	
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,236,568.75	
US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	2,100,000.00	1,795,500.00	
US TREASURY N/B-2.625%-27/05/31	1,750,000.00	1,616,903.75	
US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	3,100,000.00	2,641,779.70	
US TREASURY N/B-3.25%-27/06/30	5,000,000.00	4,717,770.00	
US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	7,000,000.00	5,912,263.00	
US TREASURY N/B-2.75%-27/07/31	930,000.00	860,431.35	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	2,686,661.76	
US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	4,100,000.00	3,468,341.70	

US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	4,090,000.00	3,429,047.82	
US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	3,860,000.00	3,241,793.98	
US TREASURY N/B-4.125%-27/10/31	800,000.00	776,343.20	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	1,400,000.00	1,461,523.00	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	2,725,311.42	
US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	220,000.00	185,135.06	
US TREASURY N/B-3.875%-27/11/30	2,320,000.00	2,229,464.32	
US TREASURY N/B-0.625%-27/12/31	3,960,000.00	3,321,450.00	
US TREASURY N/B-0.75%-28/01/31	2,850,000.00	2,395,892.40	
US TREASURY N/B-3.5%-28/01/31	1,450,000.00	1,371,041.70	
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	3,665,076.00	
US TREASURY N/B-1.125%-28/02/29	3,830,000.00	3,265,821.85	
US TREASURY N/B-4.0%-28/02/29	2,650,000.00	2,555,697.10	
US TREASURY N/B-1.25%-28/03/31	960,000.00	820,686.72	
US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	3,370,000.00	2,873,056.43	
US TREASURY N/B-3.5%-28/04/30	3,000,000.00	2,829,960.00	
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	2,440,000.00	2,237,555.64	
US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	4,300,000.00	3,653,907.80	
US TREASURY N/B-3.625%-28/05/31	1,020,000.00	966,927.36	
US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	3,300,000.00	2,796,555.30	
US TREASURY N/B-4.0%-28/06/30	200,000.00	192,445.20	
US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	2,920,000.00	2,436,258.20	
US TREASURY N/B-4.125%-28/07/31	5,950,000.00	5,753,602.40	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	3,832,168.20	
US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	2,960,000.00	2,477,898.88	
US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	4,000,000.00	3,359,528.00	
US TREASURY N/B-1.375%-28/10/31	3,800,000.00	3,202,982.00	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,084,000.95	
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	2,610,000.00	2,399,158.98	
US TREASURY N/B-1.5%-28/11/30	4,930,000.00	4,171,046.22	
US TREASURY N/B-1.375%-28/12/31	870,000.00	728,896.44	
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,590,000.00	4,096,125.18	
US TREASURY N/B-2.375%-29/03/31	4,630,000.00	4,062,551.83	
US TREASURY N/B-2.875%-29/04/30	2,000,000.00	1,799,530.00	
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	4,810,000.00	4,212,319.02	
US TREASURY N/B-3.25%-29/06/30	4,980,000.00	4,557,088.44	

US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	4,370,000.00	3,651,506.45	
US TREASURY N/B-4.0%-29/10/31	1,920,000.00	1,822,573.44	
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	7,190,000.00	6,014,039.55	
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	3,534,300.70	
US TREASURY N/B-4.0%-30/02/28	1,650,000.00	1,562,472.45	
US TREASURY N/B-3.625%-30/03/31	2,550,000.00	2,361,039.90	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,135,566.34	
US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	4,590,000.00	3,484,989.63	
US TREASURY N/B-3.75%-30/05/31	710,000.00	661,298.26	
US TREASURY N/B-4.0%-30/07/31	4,900,000.00	4,628,201.90	
US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	5,090,000.00	3,830,520.22	
US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	5,910,000.00	4,500,831.42	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	560,000.00	575,750.00	
US TREASURY N/B-1.125%-31/02/15	4,400,000.00	3,394,872.80	
US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	6,930,000.00	5,500,687.50	
US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	7,130,000.00	5,443,448.41	
US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	6,830,000.00	5,225,216.37	
US TREASURY N/B-1.875%-32/02/15	6,240,000.00	4,943,490.24	
US TREASURY N/B-2.875%-32/05/15	4,800,000.00	4,107,000.00	
US TREASURY N/B-2.75%-32/08/15	5,100,000.00	4,301,329.80	
US TREASURY N/B-4.125%-32/11/15	6,110,000.00	5,740,057.83	
US TREASURY N/B-3.5%-33/02/15	2,610,000.00	2,330,239.32	
US TREASURY N/B-3.375%-33/05/15	1,490,000.00	1,313,993.75	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	769,500.00	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	749,794.50	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	622,942.55	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	720,000.00	675,900.00	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	660,374.40	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	1,306,132.45	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	1,313,721.52	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	681,913.50	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	636,225.00	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	1,440,253.80	
US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	2,011,727.00	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,220,793.12	
US TREASURY N/B-1.125%-40/08/15	3,000,000.00	1,616,718.00	

US TREASURY N/B-4. 25%-40/11/15	1,010,000.00	897,045.64	
US TREASURY N/B-1. 375%-40/11/15	3,100,000.00	1,741,688.50	
US TREASURY N/B-4. 75%-41/02/15	1,500,000.00	1,416,268.50	
US TREASURY N/B-1. 875%-41/02/15	4,200,000.00	2,582,013.00	
US TREASURY N/B-4. 375%-41/05/15	870,000.00	782,863.41	
US TREASURY N/B-2. 25%-41/05/15	4,900,000.00	3,205,859.30	
US TREASURY N/B-3. 75%-41/08/15	960,000.00	792,524.16	
US TREASURY N/B-1. 75%-41/08/15	3,190,000.00	1,889,822.99	
US TREASURY N/B-2. 0%-41/11/15	3,000,000.00	1,853,202.00	
US TREASURY N/B-3. 125%-42/02/15	500,000.00	373,730.00	
US TREASURY N/B-2. 75%-42/08/15	800,000.00	558,000.00	
US TREASURY N/B-2. 75%-42/11/15	2,000,000.00	1,389,218.00	
US TREASURY N/B-3. 125%-43/02/15	1,765,000.00	1,301,756.33	
US TREASURY N/B-2. 875%-43/05/15	2,050,000.00	1,445,489.85	
US TREASURY N/B-3. 625%-43/08/15	1,950,000.00	1,551,390.75	
US TREASURY N/B-3. 75%-43/11/15	2,090,000.00	1,691,756.77	
US TREASURY N/B-3. 625%-44/02/15	1,080,000.00	855,139.68	
US TREASURY N/B-3. 375%-44/05/15	2,000,000.00	1,518,046.00	
US TREASURY N/B-3. 125%-44/08/15	2,150,000.00	1,561,267.65	
US TREASURY N/B-3. 0%-44/11/15	2,100,000.00	1,487,144.40	
US TREASURY N/B-2. 5%-45/02/15	2,820,000.00	1,815,484.98	
US TREASURY N/B-3. 0%-45/05/15	1,400,000.00	986,889.40	
US TREASURY N/B-2. 875%-45/08/15	1,390,000.00	955,053.71	
US TREASURY N/B-3. 0%-45/11/15	1,190,000.00	834,300.67	
US TREASURY N/B-2. 5%-46/02/15	1,500,000.00	951,649.50	
US TREASURY N/B-2. 5%-46/05/15	1,500,000.00	948,397.50	
US TREASURY N/B-2. 25%-46/08/15	1,650,000.00	986,003.70	
US TREASURY N/B-2. 875%-46/11/15	540,000.00	366,208.56	
US TREASURY N/B-3. 0%-47/02/15	2,000,000.00	1,387,264.00	
US TREASURY N/B-3. 0%-47/05/15	1,530,000.00	1,059,463.80	
US TREASURY N/B-2. 75%-47/08/15	2,000,000.00	1,314,452.00	
US TREASURY N/B-2. 75%-47/11/15	1,740,000.00	1,142,282.16	
US TREASURY N/B-3. 0%-48/02/15	2,750,000.00	1,895,082.75	
US TREASURY N/B-3. 125%-48/05/15	2,400,000.00	1,693,310.40	
US TREASURY N/B-3. 0%-48/08/15	4,100,000.00	2,820,029.20	
US TREASURY N/B-3. 375%-48/11/15	2,950,000.00	2,180,347.95	

		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	2,268,878.70	
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	2,010,936.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,950,000.00	1,720,794.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	1,860,604.50	
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	2,024,880.50	
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	2,450,000.00	1,077,615.35	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,920,000.00	1,329,397.16	
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	3,000,000.00	1,469,763.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	4,750,000.00	2,494,491.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	4,100,000.00	2,441,578.70	
		US TREASURY N/B-2.0%-51/08/15	2,000,000.00	1,081,092.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/11/15	1,400,000.00	730,186.80	
		US TREASURY N/B-2.25%-52/02/15	2,000,000.00	1,151,874.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-52/05/15	600,000.00	400,195.20	
		US TREASURY N/B-3.0%-52/08/15	1,100,000.00	754,230.40	
		US TREASURY N/B-4.0%-52/11/15	1,500,000.00	1,253,026.50	
		US TREASURY N/B-3.625%-53/02/15	2,900,000.00	2,258,827.40	
		US TREASURY N/B-3.625%-53/05/15	2,150,000.00	1,675,823.95	
		US TREASURY N/B-4.125%-53/08/15	1,000,000.00	855,312.00	
米ドル小計			586,340,000.00	495,557,206.14 (74,472,336,938)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-24/10/01	800,000.00	769,392.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-24/11/01	600,000.00	587,664.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-25/02/01	550,000.00	541,524.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	710,000.00	676,388.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-25/04/01	760,000.00	724,196.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.75%-25/05/01	530,000.00	521,223.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	950,000.00	913,026.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-25/08/01	80,000.00	78,240.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-25/09/01	1,755,000.00	1,624,305.15	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-25/11/01	450,000.00	448,065.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	995,000.00	899,748.65	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-26/04/01	700,000.00	674,471.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	770,000.00	713,790.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-26/09/01	990,000.00	898,632.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	520,000.00	469,237.60	

		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	750,000.00	668,557.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-27/09/01	620,000.00	585,267.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-28/03/01	580,000.00	562,060.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	897,000.00	816,027.81	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-28/09/01	630,000.00	603,117.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	410,000.00	442,804.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	364,000.00	330,482.88	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	1,998,000.00	1,665,372.96	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-30/12/01	1,405,000.00	1,091,600.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	1,966,000.00	1,625,783.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/12/01	1,950,000.00	1,594,534.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-32/06/01	1,070,000.00	903,390.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-32/12/01	890,000.00	778,928.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	710,000.00	799,140.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-33/06/01	500,000.00	445,495.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-33/12/01	100,000.00	92,934.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	340,000.00	369,376.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	600,000.00	596,064.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	730,000.00	678,644.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	650,000.00	529,132.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	2,123,000.00	1,439,563.84	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-53/12/01	1,131,000.00	706,795.83	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-55/12/01	200,000.00	158,136.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	258,006.95	
			32,109,000.00	28,281,123.47	
				(3,077,834,667)	
加ドル小計					
メキシコ ペン	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	14,900,000.00	14,690,468.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.0%-25/03/06	6,400,000.00	5,916,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	24,250,000.00	21,688,593.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.0%-26/09/03	2,500,000.00	2,271,093.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	13,350,000.00	11,497,687.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	21,600,000.00	19,716,750.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	14,120,000.00	13,109,537.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	22,400,000.00	19,467,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-33/05/26	10,800,000.00	9,018,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	5,300,000.00	4,445,375.00	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-35/05/24	600,000.00	512,250.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	4,400,000.00	4,339,500.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	11,970,000.00	10,402,678.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	13,200,000.00	10,461,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	13,570,000.00	10,953,534.37	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-53/07/31	7,800,000.00	6,222,937.50	
メキシコペソ小計			187,160,000.00	164,712,406.24 (1,348,467,527)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	270,000.00	92,936.43	
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	670,000.00	650,659.11	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,135,000.00	1,089,075.63	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	585,000.00	602,194.90	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	852,000.00	805,242.24	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	830,000.00	764,167.72	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	545,000.00	481,917.88	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	970,000.00	1,064,558.51	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	900,000.00	810,600.30	
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	1,000,000.00	883,397.00	
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	770,000.00	626,040.80	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	915,000.00	770,474.83	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-31/10/22	750,000.00	573,744.75	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	565,000.00	588,385.35	
		BELGIUM KINGDOM-0.35%-32/06/22	725,000.00	557,687.40	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	525,000.00	432,823.12	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-33/06/22	373,000.00	356,257.52	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	543,000.00	513,616.09	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	974,000.00	1,091,627.05	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	425,000.00	319,542.20	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	485,000.00	378,612.34	
		BELGIUM KINGDOM-2.75%-39/04/22	160,000.00	138,811.36	
		BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	405,000.00	231,524.73	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,112,000.00	1,153,437.56	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	645,000.00	619,325.77	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	658,000.00	415,874.42	
		BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	650,000.00	401,566.75	
		BELGIUM KINGDOM-1.4%-53/06/22	485,000.00	264,061.16	

BELGIUM KINGDOM-3. 3%-54/06/22	370,000.00	316,665.98	
BELGIUM KINGDOM-2. 25%-57/06/22	412,000.00	278,544.54	
BELGIUM KINGDOM-2. 15%-66/06/22	446,000.00	285,167.94	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 45%-71/10/31	345,000.00	138,572.01	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2. 75%-24/10/31	1,420,000.00	1,406,291.32	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 0%-25/01/31	1,350,000.00	1,290,590.55	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 6%-25/04/30	1,350,000.00	1,311,610.05	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4. 65%-25/07/30	1,490,000.00	1,518,312.98	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2. 15%-25/10/31	1,455,000.00	1,419,384.51	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 0%-26/01/31	1,455,000.00	1,346,644.69	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 95%-26/04/30	1,055,000.00	1,017,492.64	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2. 8%-26/05/31	85,000.00	83,543.86	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5. 9%-26/07/30	1,360,000.00	1,445,034.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 3%-26/10/31	1,640,000.00	1,541,081.76	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 0%-27/01/31	755,000.00	675,600.42	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 5%-27/04/30	1,275,000.00	1,194,065.55	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 8%-27/07/30	1,315,000.00	1,193,618.92	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 45%-27/10/31	1,400,000.00	1,296,124.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 0%-28/01/31	1,125,000.00	972,815.62	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 4%-28/04/30	1,270,000.00	1,161,519.14	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 4%-28/07/30	1,275,000.00	1,160,122.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5. 15%-28/10/31	1,095,000.00	1,176,172.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6. 0%-29/01/31	1,545,000.00	1,726,070.91	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 45%-29/04/30	1,275,000.00	1,143,557.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 8%-29/07/30	515,000.00	441,648.03	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 6%-29/10/31	1,280,000.00	1,076,555.52	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 5%-30/04/30	1,400,000.00	1,149,967.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 95%-30/07/30	1,330,000.00	1,196,454.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 25%-30/10/31	1,330,000.00	1,133,375.46	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 1%-31/04/30	1,325,000.00	1,014,855.92	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 5%-31/10/31	1,175,000.00	913,087.80	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.7%-32/04/30	1,270,000.00	986,579.18	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	1,390,000.00	1,586,487.62	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.55%-32/10/31	1,045,000.00	940,933.67	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-33/04/30	1,082,000.00	1,015,161.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%-33/07/30	1,165,000.00	1,016,733.94	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.55%-33/10/31	600,000.00	578,375.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%-35/07/30	1,195,000.00	946,903.66	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	1,190,000.00	1,188,577.95	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.85%-37/07/30	670,000.00	434,431.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.9%-39/07/30	340,000.00	320,954.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	1,045,000.00	1,103,871.12	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%-40/10/31	1,000,000.00	619,951.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	1,265,000.00	1,306,979.02	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-42/07/30	390,000.00	221,504.79	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-43/07/30	300,000.00	258,876.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	830,000.00	905,110.85	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	1,060,000.00	818,652.84	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	985,000.00	717,619.78	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-50/10/31	1,170,000.00	535,366.26	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.9%-52/10/31	560,000.00	320,048.96	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	848,000.00	661,183.90	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-24/10/18	1,360,000.00	1,314,456.32	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-25/04/11	1,300,000.00	1,240,115.50	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-25/10/10	1,650,000.00	1,553,593.80	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-26/04/10	1,600,000.00	1,489,142.40	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-27/04/16	1,150,000.00	1,044,022.90	
BUNDESOBLIGATION-1.3%-27/10/15	1,130,000.00	1,068,161.88	
BUNDESOBLIGATION-2.2%-28/04/13	750,000.00	732,120.74	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	1,990,000.00	1,918,075.43	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15	2,070,000.00	1,992,296.34	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	1,820,000.00	1,719,612.44	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-26/08/15	2,010,000.00	1,855,431.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	2,405,000.00	2,211,832.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	910,000.00	1,024,109.45	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15	1,770,000.00	1,626,861.87	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-27/11/15	1,565,000.00	1,401,218.05	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	650,000.00	722,823.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-28/02/15	1,690,000.00	1,538,114.63	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	970,000.00	1,054,792.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-28/08/15	1,670,000.00	1,486,608.95	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-28/11/15	1,180,000.00	1,030,380.72	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-29/02/15	1,875,000.00	1,649,595.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-29/08/15	1,830,000.00	1,566,092.04	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.1%-29/11/15	620,000.00	597,763.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	660,000.00	790,656.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/02/15	1,490,000.00	1,258,135.14	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/08/15	1,800,000.00	1,498,683.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/08/15	740,000.00	616,971.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	1,110,000.00	1,305,223.47	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/02/15	1,920,000.00	1,575,050.88	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/08/15	1,565,000.00	1,265,088.09	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/08/15	400,000.00	323,609.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-32/02/15	1,623,000.00	1,291,550.94	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.7%-32/08/15	1,680,000.00	1,535,793.84	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.3%-33/02/15	1,450,000.00	1,386,404.45	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.3%-33/02/15	50,000.00	47,853.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.6%-33/08/15	500,000.00	488,141.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	1,375,000.00	1,603,130.37	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-35/05/15	1,200,000.00	854,166.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-36/05/15	1,000,000.00	687,929.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	1,790,000.00	1,973,560.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-38/05/15	50,000.00	37,877.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	1,235,000.00	1,408,517.50	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	1,355,000.00	1,640,781.69	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	955,000.00	970,107.14	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-44/07/04	1,635,000.00	1,480,948.66	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-46/08/15	1,827,000.00	1,644,031.43	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%-48/08/15	2,040,000.00	1,396,524.84	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	1,630,000.00	727,082.69	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	640,000.00	287,152.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-52/08/15	750,000.00	315,213.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%-53/08/15	1,040,000.00	776,648.08	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%-53/08/15	500,000.00	374,732.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.2%-24/12/12	240,000.00	236,680.56	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.5%-25/03/13	680,000.00	672,050.12	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.8%-25/06/12	910,000.00	903,195.93	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-72/03/01	300,000.00	149,508.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-24/11/15	1,260,000.00	1,227,970.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-24/12/01	1,080,000.00	1,063,790.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-24/12/15	870,000.00	832,537.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%-25/02/01	1,485,000.00	1,420,102.53	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-25/03/01	1,540,000.00	1,560,574.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-25/05/15	855,000.00	823,976.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-25/06/01	1,300,000.00	1,251,330.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%-25/07/01	1,000,000.00	966,365.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.6%-25/09/29	85,000.00	84,393.69	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-25/11/15	1,100,000.00	1,069,392.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-25/12/01	1,085,000.00	1,043,037.62	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-26/01/15	810,000.00	802,259.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%-26/02/01	850,000.00	786,811.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-26/03/01	1,330,000.00	1,345,030.33	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-26/04/01	1,220,000.00	1,108,675.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%-26/04/15	950,000.00	945,929.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%-26/06/01	1,330,000.00	1,252,934.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%-26/07/15	950,000.00	904,436.10	

BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-26/08/01	870,000.00	779,827.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	720,000.00	785,036.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%-26/12/01	1,080,000.00	994,231.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%-27/01/15	1,180,000.00	1,068,438.08	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.1%-27/04/01	410,000.00	371,817.93	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%-27/06/01	1,160,000.00	1,089,149.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%-27/08/01	995,000.00	925,493.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-27/09/15	1,275,000.00	1,132,864.27	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	1,560,000.00	1,697,813.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.65%-27/12/01	950,000.00	897,802.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-28/02/01	1,650,000.00	1,513,619.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%-28/03/15	1,230,000.00	1,039,218.39	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%-28/07/15	1,130,000.00	953,457.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-28/09/01	1,330,000.00	1,361,068.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-28/12/01	1,030,000.00	963,377.54	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%-29/02/15	735,000.00	602,541.24	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-29/06/15	305,000.00	281,643.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-29/08/01	2,025,000.00	1,888,701.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	1,750,000.00	1,832,351.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-29/12/15	535,000.00	518,620.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-30/03/01	1,620,000.00	1,540,377.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%-30/04/01	1,075,000.00	891,297.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.7%-30/06/15	170,000.00	162,418.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-30/08/01	1,087,000.00	865,051.99	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-30/12/01	1,287,000.00	1,064,307.81	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%-31/04/01	1,295,000.00	1,000,576.57	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	1,515,000.00	1,655,973.78	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%-31/08/01	1,120,000.00	831,686.24	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-31/10/30	290,000.00	278,570.23	

BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-31/12/01	1,010,000.00	762,306.59	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-32/03/01	1,550,000.00	1,233,645.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-32/06/01	1,200,000.00	887,377.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-32/12/01	630,000.00	527,736.51	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	1,475,000.00	1,583,577.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.4%-33/05/01	765,000.00	742,923.63	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-33/09/01	1,365,000.00	1,116,492.19	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.35%-33/11/01	300,000.00	288,229.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.2%-34/03/01	240,000.00	226,437.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	1,580,000.00	1,588,437.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%-35/03/01	980,000.00	841,587.74	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-35/04/30	400,000.00	366,832.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-36/03/01	900,000.00	607,254.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%-36/09/01	965,000.00	712,683.38	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	1,825,000.00	1,644,859.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-37/03/01	400,000.00	243,206.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-38/03/01	200,000.00	161,894.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%-38/09/01	855,000.00	663,012.31	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	1,250,000.00	1,225,405.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%-40/03/01	810,000.00	625,731.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	1,070,000.00	1,045,272.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%-41/03/01	830,000.00	513,127.58	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.45%-43/09/01	500,000.00	449,899.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01	1,165,000.00	1,090,777.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-45/04/30	440,000.00	234,065.04	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-46/09/01	820,000.00	608,415.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%-47/03/01	970,000.00	649,081.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%-48/03/01	1,015,000.00	772,158.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-	850,000.00	684,602.75	

49/09/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-50/09/01	870,000.00	530,144.07	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%-51/09/01	850,000.00	429,124.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-52/09/01	280,000.00	154,979.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-53/10/01	475,000.00	417,273.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	500,000.00	299,832.00	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	332,000.00	335,258.58	
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	280,000.00	267,740.20	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	335,000.00	314,124.47	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-26/09/15	180,000.00	164,388.60	
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-27/04/15	170,000.00	159,937.36	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	400,000.00	361,336.00	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	372,821.80	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	237,167.73	
FINNISH GOVERNMENT-2.875%-29/04/15	105,000.00	103,043.64	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	375,000.00	320,528.25	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-30/09/15	172,000.00	137,428.34	
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	465,000.00	386,473.59	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-31/09/15	200,000.00	155,480.00	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-32/09/15	230,000.00	196,498.20	
FINNISH GOVERNMENT-3.0%-33/09/15	110,000.00	105,550.72	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	325,000.00	257,534.22	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	278,000.00	180,540.15	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-38/04/15	210,000.00	186,697.35	
FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15	263,000.00	149,745.62	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	277,000.00	236,199.56	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-43/04/15	235,000.00	130,760.81	
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	167,229.92	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-52/04/15	250,000.00	97,553.50	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	515,000.00	159,781.84	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	2,383,000.00	2,337,799.25	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/02/25	375,000.00	358,330.12	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/03/25	2,865,000.00	2,731,448.02	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	2,610,000.00	2,495,833.38	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	1,820,000.00	1,913,548.00	

FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	2,070,000.00	1,976,713.38	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-26/02/25	2,440,000.00	2,265,898.68	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	2,470,000.00	2,485,654.86	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,450,000.00	2,287,386.15	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-26/09/24	400,000.00	392,063.20	
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,820,000.00	2,580,652.50	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-27/02/25	2,005,000.00	1,806,781.69	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	1,775,000.00	1,646,463.37	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,250,000.00	3,199,985.75	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/02/25	1,275,000.00	1,152,079.80	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	3,765,000.00	3,382,924.03	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	3,080,000.00	2,734,959.92	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	2,105,000.00	2,342,683.97	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	3,060,000.00	2,646,300.24	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-29/11/25	2,580,000.00	2,130,233.76	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	3,065,000.00	2,936,107.55	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-30/11/25	3,049,000.00	2,428,882.18	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	3,040,000.00	2,683,368.48	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-31/11/25	2,605,000.00	1,998,681.04	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-32/05/25	2,068,000.00	1,555,824.64	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	2,085,000.00	2,458,348.44	
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-32/11/25	2,075,000.00	1,848,957.80	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-33/05/25	935,000.00	900,602.28	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	2,475,000.00	1,980,579.15	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	1,605,000.00	1,775,311.36	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	2,555,000.00	1,936,707.88	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-38/05/25	190,000.00	136,241.59	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	1,590,000.00	1,630,274.70	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	2,060,000.00	1,575,036.86	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	2,780,000.00	3,006,161.34	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-43/05/25	135,000.00	108,814.05	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-44/06/25	1,160,000.00	606,823.84	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	1,580,000.00	1,425,852.04	
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	1,580,000.00	1,099,910.68	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-50/05/25	1,960,000.00	1,175,302.24	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-52/05/25	1,500,000.00	685,219.50	

FRANCE (GOVT OF)-0.75%-53/05/25	1,320,000.00	587,179.56	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-54/05/25	540,000.00	442,546.20	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,300,000.00	1,292,790.20	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,070,000.00	1,065,174.30	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	945,000.00	532,985.67	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	580,000.00	596,240.58	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	595,000.00	563,978.48	
IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15	327,000.00	295,288.84	
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	455,000.00	412,967.55	
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	525,000.00	470,767.50	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	476,000.00	453,782.22	
IRISH TREASURY-0.2%-30/10/18	282,000.00	229,519.80	
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	475,000.00	417,371.57	
IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	485,000.00	375,710.10	
IRISH TREASURY-0.35%-32/10/18	205,000.00	158,537.98	
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	285,000.00	237,502.18	
IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	250,000.00	177,543.75	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	390,000.00	308,841.78	
IRISH TREASURY-0.55%-41/04/22	185,000.00	110,947.83	
IRISH TREASURY-3.0%-43/10/18	170,000.00	154,810.33	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	541,000.00	399,577.19	
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	499,000.00	306,897.47	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,035,000.00	983,891.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-26/01/15	455,000.00	424,617.37	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,100,000.00	1,026,748.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	828,000.00	752,042.59	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	870,000.00	801,914.67	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	655,000.00	717,896.37	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	961,000.00	866,824.88	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	620,000.00	530,532.76	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	645,000.00	551,794.27	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-30/01/15	365,000.00	353,262.33	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-30/07/15	670,000.00	547,191.68	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-31/07/15	775,000.00	612,146.15	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-32/07/15	700,000.00	559,701.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	855,000.00	809,000.14	

NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/07/15	280,000.00	262,963.96	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,025,000.00	1,091,994.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-38/01/15	395,000.00	244,789.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	848,000.00	543,884.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	957,000.00	996,284.85	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,004,000.00	902,303.83	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	907,000.00	364,913.31	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-54/01/15	365,000.00	271,228.94	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.7%-71/04/20	200,000.00	72,452.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	173,000.00	85,131.57	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	383,000.00	235,814.63	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.85%-99/99/99	192,000.00	69,860.16	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	595,000.00	584,370.92	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-25/04/20	475,000.00	451,765.37	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	710,000.00	682,557.79	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	550,000.00	569,915.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.0%-26/07/15	170,000.00	164,816.70	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	773,000.00	720,559.68	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	625,404.31	
REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	487,000.00	539,373.44	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	660,000.00	596,598.42	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-28/10/20	255,000.00	217,527.75	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	885,000.00	767,905.65	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-29/05/23	150,000.00	147,732.45	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	680,000.00	553,333.68	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-31/02/20	745,000.00	583,803.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.9%-32/02/20	610,000.00	498,919.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-33/02/20	450,000.00	428,487.30	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	455,000.00	409,503.18	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-36/10/20	270,000.00	175,240.26	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	840,000.00	875,878.92	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	345,000.00	184,465.29	
REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	394,000.00	359,382.37	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	503,000.00	326,405.75	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.85%-49/05/23	200,000.00	137,275.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	455,000.00	225,256.85	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-53/10/20	106,000.00	94,043.51	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	245,000.00	246,280.37	
			357,322,000.00	317,394,023.39	
				(50,370,431,511)	
ユーロ小計					
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	760,000.00	314,866.48	
		UK TREASURY-1.125%-73/10/22	513,000.00	165,052.62	
		UK TREASURY-0.25%-25/01/31	1,590,000.00	1,502,152.50	
		UK TREASURY-5.0%-25/03/07	805,000.00	806,967.42	
		UK TREASURY-0.625%-25/06/07	813,000.00	762,553.35	
		UK TREASURY-3.5%-25/10/22	1,200,000.00	1,170,180.00	
		UK TREASURY-0.125%-26/01/30	710,000.00	644,300.86	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	820,000.00	757,557.00	
		UK TREASURY-0.375%-26/10/22	1,260,000.00	1,115,263.80	
		UK TREASURY-4.125%-27/01/29	1,495,000.00	1,471,752.75	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	840,000.00	748,502.16	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	850,000.00	842,894.00	
		UK TREASURY-0.125%-28/01/31	745,000.00	621,665.25	
		UK TREASURY-4.5%-28/06/07	505,000.00	503,804.16	
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	720,000.00	632,304.00	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	710,000.00	760,569.75	
		UK TREASURY-0.5%-29/01/31	1,055,000.00	859,930.50	
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	856,000.00	699,273.24	
		UK TREASURY-0.375%-30/10/22	920,000.00	697,360.00	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	945,000.00	962,624.25	
		UK TREASURY-0.25%-31/07/31	1,445,000.00	1,047,003.65	
		UK TREASURY-1.0%-32/01/31	1,645,000.00	1,248,717.85	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,310,000.00	1,287,271.50	
		UK TREASURY-3.25%-33/01/31	1,450,000.00	1,303,187.50	
		UK TREASURY-0.875%-33/07/31	840,000.00	594,700.68	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	849,000.00	835,076.40	
		UK TREASURY-0.625%-35/07/31	1,097,000.00	693,084.60	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	970,000.00	923,372.10	
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,350,000.00	928,482.75	
		UK TREASURY-3.75%-38/01/29	355,000.00	312,588.15	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,060,000.00	1,042,139.00	
		UK TREASURY-1.125%-39/01/31	300,000.00	178,267.80	

		UK TREASURY-4.25%-39/09/07	850,000.00	784,954.60	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	935,000.00	856,740.50	
		UK TREASURY-1.25%-41/10/22	1,360,000.00	761,725.12	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,090,000.00	1,020,462.36	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,175,000.00	907,828.50	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,160,000.00	924,386.60	
		UK TREASURY-0.875%-46/01/31	435,000.00	194,510.25	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	720,000.00	639,882.00	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,140,000.00	583,857.84	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	675,000.00	359,977.50	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	895,000.00	789,882.25	
		UK TREASURY-0.625%-50/10/22	660,000.00	234,389.76	
		UK TREASURY-1.25%-51/07/31	600,000.00	263,496.00	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	872,000.00	702,322.75	
		UK TREASURY-1.5%-53/07/31	580,000.00	266,979.80	
		UK TREASURY-3.75%-53/10/22	690,000.00	552,322.23	
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	925,000.00	436,600.00	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	962,000.00	846,799.53	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	516,322.50	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	751,000.00	631,827.56	
		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	1,050,000.00	271,764.15	
		UK TREASURY-4.0%-63/10/22	470,000.00	393,225.03	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	830,000.00	624,184.07	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	765,000.00	728,413.11	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	742,000.00	429,187.64	
英bond小計			52,190,000.00	41,155,507.72 (7,478,778,862)	
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,300,000.00	4,234,717.40	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	4,400,000.00	4,121,436.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,550,000.00	3,206,090.20	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	3,780,000.00	3,317,532.12	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	2,700,000.00	2,183,430.60	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,800,000.00	1,697,657.40	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.75%-33/11/11	1,430,000.00	1,273,031.76	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	2,645,000.00	2,766,035.20	
スウェーデンクローナ小計			24,605,000.00	22,799,930.68	

				(306,887,066)	
ノルウェークローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,190,000.00	3,086,851.35	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,400,000.00	2,263,992.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,400,000.00	2,229,300.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,040,000.00	1,873,817.52	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	2,250,000.00	1,989,258.75	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	2,950,000.00	2,494,555.40	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.25%-31/09/17	2,040,000.00	1,662,814.20	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.125%-32/05/18	2,130,000.00	1,837,636.20	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-33/08/15	1,450,000.00	1,327,350.30	
ノルウェークローネ小計			20,850,000.00	18,765,575.72	(251,271,058)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-0.0%-24/11/15	1,980,000.00	1,910,870.28	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	3,170,000.00	3,080,954.70	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	4,160,000.00	3,778,494.72	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	3,130,000.00	2,709,813.15	
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-31/11/15	1,350,000.00	1,061,714.25	
		KINGDOM OF DENMARK-2.25%-33/11/15	700,000.00	646,210.60	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	8,010,000.00	9,244,453.14	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	1,300,000.00	584,734.80	
デンマーククローネ小計			23,800,000.00	23,017,245.64	(489,346,642)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	2,060,000.00	2,003,226.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	1,440,000.00	1,350,763.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,270,000.00	2,197,700.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,590,000.00	2,411,445.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,950,000.00	1,686,067.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	1,310,000.00	1,243,032.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,140,000.00	1,936,914.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,160,000.00	1,933,243.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-7.5%-28/07/25	1,320,000.00	1,424,940.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	555,000.00	557,997.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	2,665,000.00	2,291,606.85	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	2,025,000.00	1,524,622.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-32/04/25	1,870,000.00	1,369,775.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.0%-33/10/25	1,070,000.00	1,078,474.40	

ポーランドズロチ小計			25,425,000.00	23,009,808.75 (816,224,644)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-24/11/21	1,391,000.00	1,330,458.11
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	1,060,000.00	1,042,809.98
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	1,050,000.00	966,027.30
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	1,000,000.00	999,800.00
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,210,000.00	1,087,431.84
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,080,000.00	1,097,029.44
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	980,000.00	923,962.62
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	700,000.00	639,982.70
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	720,000.00	667,382.40
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,080,000.00	1,019,375.28
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	890,000.00	809,651.69
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,220,000.00	1,081,532.44
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	1,010,000.00	791,747.08
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,283,000.00	1,027,953.71
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,485,000.00	1,124,419.72
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,580,000.00	1,201,833.32
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	1,295,000.00	1,015,507.92
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,190,000.00	1,172,041.71
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-33/11/21	1,120,000.00	967,144.64
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-34/05/21	960,000.00	882,274.56
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.5%-34/12/21	740,000.00	660,426.32
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	530,000.00	434,578.80
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	550,000.00	489,943.85
AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	582,000.00	473,906.88		
AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	790,000.00	580,441.44		
AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	720,000.00	514,473.12		
AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	1,020,000.00	517,249.14		
豪ドル小計			27,236,000.00	23,519,386.01 (2,219,994,845)
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	566,727.45
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.5%-26/05/15	215,000.00	190,734.88
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-27/04/15	700,000.00	683,618.60
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.25%-28/05/15	370,000.00	295,834.24
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.0%-29/04/20	680,000.00	606,947.60

		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.5%-31/05/15	350,000.00	266,807.10	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.0%-32/05/15	190,000.00	146,380.37	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.5%-33/04/14	430,000.00	369,800.00	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.25%-34/05/15	220,000.00	198,967.34	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-37/04/15	380,000.00	279,432.62	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.75%-41/05/15	225,000.00	128,767.27	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-51/05/15	500,000.00	303,251.00	
ニュージーランドドル小計			4,850,000.00	4,037,268.47 (350,798,257)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-72/08/01	240,000.00	238,440.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	580,000.00	568,272.40	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-25/11/01	314,000.00	295,186.68	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	470,000.00	453,455.06	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-26/11/01	255,000.00	238,756.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	533,000.00	534,385.80	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-27/09/01	110,000.00	108,273.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	347,000.00	337,284.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-28/08/01	60,000.00	58,979.70	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	415,000.00	405,953.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	490,000.00	476,378.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-31/07/01	300,000.00	264,960.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-32/08/01	170,000.00	160,480.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	335,000.00	335,758.77	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	451,000.00	399,360.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	220,000.00	195,989.20	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	352,000.00	328,320.96	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	382,000.00	354,114.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	367,000.00	282,590.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-51/10/01	222,000.00	173,020.14	
シンガポールドル小計			6,613,000.00	6,209,957.71 (680,052,468)	
マレーシアリングgit	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	750,000.00	754,155.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	770,000.00	774,920.30	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,380,000.00	1,392,157.80	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	830,000.00	834,324.30	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	1,170,000.00	1,178,113.95	

		MALAYSIA GOVERNMENT-3.89%-27/11/16	1,200,000.00	1,205,718.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.51%-28/04/20	240,000.00	236,760.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.504%-29/04/30	200,000.00	204,782.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,320,000.00	1,309,242.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	985,000.00	891,021.15	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	728,700.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,100,000.00	1,063,595.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	960,000.00	960,806.40	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,320,000.00	1,382,436.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	1,080,000.00	1,152,630.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	1,490,000.00	1,373,146.75	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.696%-42/10/15	750,000.00	771,555.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	660,000.00	692,010.66	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	620,000.00	629,064.40	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	510,000.00	536,897.40	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	1,460,000.00	1,346,850.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.457%-53/03/31	580,000.00	570,986.80	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	650,000.00	659,605.05	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	940,832.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,510,000.00	1,499,286.55	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	910,000.00	929,864.39	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,041,140.65	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	1,180,000.00	1,144,549.26	
		マレーシアリングット小計	26,310,000.00	26,205,151.81 (822,312,422)	
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-2.94%-24/10/17	32,000,000.00	32,244,320.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.26%-25/02/24	4,000,000.00	3,995,932.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.99%-25/04/09	22,000,000.00	21,878,725.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.24%-25/05/25	14,000,000.00	13,976,025.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-25/08/25	15,000,000.00	14,951,910.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	32,000,000.00	32,475,096.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.46%-26/02/15	8,000,000.00	8,009,708.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	17,000,000.00	17,295,264.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.3%-26/05/15	3,000,000.00	2,992,365.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-26/06/06	11,000,000.00	11,278,278.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	16,000,000.00	16,113,616.00	

		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-26/12/05	23,000,000.00	23,506,184.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	24,000,000.00	24,307,284.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.28%-27/12/03	21,000,000.00	21,731,033.10	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.64%-28/01/15	10,000,000.00	10,044,845.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-28/04/15	11,000,000.00	11,036,773.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	13,000,000.00	13,283,315.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.4%-28/07/15	4,000,000.00	3,974,930.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	22,000,000.00	22,354,684.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-29/03/24	3,000,000.00	3,027,213.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-29/05/23	14,000,000.00	14,574,021.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-29/09/25	24,000,000.00	23,970,168.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-30/03/25	5,000,000.00	5,036,237.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	21,000,000.00	20,976,522.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-30/06/25	3,000,000.00	2,986,795.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	11,000,000.00	11,501,743.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	10,000,000.00	10,257,860.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	10,000,000.00	10,032,155.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.76%-32/05/15	9,000,000.00	9,037,327.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-32/08/15	9,000,000.00	8,980,371.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-32/09/01	10,000,000.00	9,906,985.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-32/11/15	6,000,000.00	6,046,536.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-33/02/25	11,000,000.00	11,142,890.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/05/25	12,000,000.00	11,959,086.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	13,000,000.00	14,753,667.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	7,000,000.00	7,822,962.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.53%-51/10/18	10,000,000.00	10,858,910.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.32%-52/04/15	10,000,000.00	10,513,920.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-52/10/25	8,000,000.00	8,110,132.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-53/04/15	10,000,000.00	10,371,985.00	
			518,000,000.00	527,317,775.70	
				(10,826,835,838)	
中国元小計					
イスラエル エルシェケ ル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-0.4%-24/10/31	800,000.00	772,462.74	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-25/04/30	1,360,000.00	1,290,997.96	
		ISRAEL FIXED BOND-1.75%-25/08/31	1,190,000.00	1,140,859.84	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-26/02/27	630,000.00	580,183.70	
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	950,000.00	1,007,973.77	

	ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,270,000.00	1,185,123.22	
	ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,160,000.00	1,062,889.21	
	ISRAEL FIXED BOND-3.75%-29/02/28	300,000.00	293,603.01	
	ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	1,515,000.00	1,238,718.41	
	ISRAEL FIXED BOND-1.3%-32/04/30	530,000.00	413,334.46	
	ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	1,050,000.00	702,915.12	
	ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,160,000.00	1,233,821.94	
	ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,300,000.00	1,050,121.67	
	ISRAEL FIXED BOND-2.8%-52/11/29	300,000.00	192,235.93	
イスラエルシェケル小計		13,515,000.00	12,165,240.98 (449,511,736)	
合計			153,961,084,481 (153,961,084,481)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 216 銘柄	100.0%	48.5%
加ドル	国債証券 39 銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 16 銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 356 銘柄	100.0%	32.7%
英ポンド	国債証券 57 銘柄	100.0%	4.9%
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 9 銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 8 銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 14 銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券 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%
マレーシアリングット	国債証券 28 銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券 40 銘柄	100.0%	7.0%
イスラエルシェケル	国債証券 14 銘柄	100.0%	0.3%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年10月26日現在	2023年10月26日現在
資産の部		
流動資産		
預金	92,356,279	123,122,262
コール・ローン	223,451,180	110,947,468
国債証券	21,165,170,810	21,787,959,645
派生商品評価勘定	4,960,875	18,312,655
未収入金	228,168,783	-
未収利息	209,204,786	209,470,586
前払費用	4,799,110	8,852,572
流動資産合計	21,928,111,823	22,258,665,188
資産合計	21,928,111,823	22,258,665,188
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	674,177,769	460,728,964
未払解約金	1,921,122	67,101,831
未払利息	363	39
流動負債合計	676,099,254	527,830,834
負債合計	676,099,254	527,830,834
純資産の部		
元本等		
元本	15,845,617,925	17,138,690,473
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	5,406,394,644	4,592,143,881
元本等合計	21,252,012,569	21,730,834,354
純資産合計	21,252,012,569	21,730,834,354
負債純資産合計	21,928,111,823	22,258,665,188

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)

		2022 年 10 月 26 日現在	2023 年 10 月 26 日現在
1.	期首	2021 年 10 月 27 日	2022 年 10 月 27 日
	期首元本額	15,760,382,772 円	15,845,617,925 円
	期首からの追加設定元本額	1,595,187,275 円	2,354,550,563 円
	期首からの一部解約元本額	1,509,952,122 円	1,061,478,015 円
	元本の内訳 ※		
	インデックスファンド海外債券ヘッジあり (DC 専用)	4,491,168,325 円	5,910,698,702 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)	1,362,007,124 円	1,472,658,217 円
	Tracers グローバル 3 分法 (おとなのバランス)	— 円	100,476,621 円
	Ni つみインデックススラップ世界 10 指数 (均等型)	— 円	1,048,129 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	2,939,011 円
	国際分散型ファンド 40 (適格機関投資家向け)	8,946,084,555 円	8,565,178,549 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 20)	115,914,160 円	125,965,523 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 40)	160,237,873 円	182,207,848 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 60)	162,007,452 円	193,562,007 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 80)	121,140,667 円	147,415,694 円
	インデックスファンド海外債券 (ヘッジあり) 1 年決算型	487,057,769 円	436,540,172 円
	計	15,845,617,925 円	17,138,690,473 円
2.	受益権の総数	15,845,617,925 口	17,138,690,473 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 2021 年 10 月 27 日 至 2022 年 10 月 26 日	自 2022 年 10 月 27 日 至 2023 年 10 月 26 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

	2022年10月26日現在	2023年10月26日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2022年10月26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	△4,223,897,782
合計	△4,223,897,782

(2023年10月26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	△877,607,372

合計	△877,607,372
----	--------------

(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)

(2022年10月26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	21,107,740,915	—	21,776,957,809	△669,216,894
	米ドル	10,872,337,615	—	11,289,746,910	△417,409,295
	加ドル	429,141,508	—	433,345,113	△4,203,605
	メキシコペソ	161,999,208	—	167,119,751	△5,120,543
	ユーロ	6,974,520,911	—	7,161,216,757	△186,695,846
	英ポンド	869,964,569	—	903,363,190	△33,398,621
	スウェーデンクローナ	76,983,624	—	78,332,605	△1,348,981
	ノルウェークローネ	50,761,227	—	51,492,584	△731,357
	デンマーククローネ	67,178,043	—	68,306,424	△1,128,381
	ポーランドズロチ	102,244,184	—	107,104,600	△4,860,416
	豪ドル	323,591,193	—	323,045,112	546,081
	シンガポールドル	85,265,557	—	86,746,219	△1,480,662
	マレーシアリンギット	306,688,270	—	305,791,936	896,334
	中国元	677,750,740	—	688,090,904	△10,340,164
イスラエルシケル	109,314,266	—	113,255,704	△3,941,438	
合計		21,107,740,915	—	21,776,957,809	△669,216,894

(2023年10月26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	21,742,315,495	—	22,184,731,804	△442,416,309
	米ドル	10,371,147,639	—	10,725,625,335	△354,477,696
	加ドル	426,742,920	—	432,879,477	△6,136,557
	メキシコペソ	198,524,765	—	194,702,730	3,822,035
ユーロ	7,052,149,077	—	7,112,715,743	△60,566,666	

英ポンド	1,093,975,070	—	1,085,477,507	8,497,563
スウェーデンクローナ	54,263,605	—	55,149,799	△886,194
ノルウェークローネ	42,920,883	—	42,013,685	907,198
デンマーククローネ	68,400,217	—	68,881,019	△480,802
ポーランドズロチ	118,128,388	—	119,818,243	△1,689,855
豪ドル	303,959,331	—	303,872,085	87,246
ニュージーランドドル	35,337,141	—	35,766,625	△429,484
シンガポールドル	89,378,337	—	90,461,010	△1,082,673
マレーシアリンギット	315,893,920	—	316,518,941	△625,021
中国元	1,496,360,965	—	1,528,579,892	△32,218,927
イスラエルシェケル	75,133,237	—	72,269,713	2,863,524
合計	21,742,315,495	—	22,184,731,804	△442,416,309

(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)

2022年10月26日現在		2023年10月26日現在	
1口当たり純資産額	1.3412円	1口当たり純資産額	1.2679円
(1万口当たり純資産額)	(13,412円)	(1万口当たり純資産額)	(12,679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-1.5%-24/09/30	500,000.00	482,189.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	3,800,000.00	3,676,686.20	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,800,000.00	1,736,260.20	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	2,650,000.00	2,539,081.60	
		US TREASURY N/B-1.75%-25/03/15	1,200,000.00	1,143,187.20	
		US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	1,300,000.00	1,239,747.60	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	600,000.00	578,425.20	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	700,000.00	672,341.60	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	500,000.00	458,652.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	2,000,000.00	1,890,820.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	3,200,000.00	3,022,624.00	
		US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	1,500,000.00	1,360,429.50	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	900,000.00	854,718.30	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	1,600,000.00	1,481,624.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	2,100,000.00	1,930,521.60	
		US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	900,000.00	818,577.90	
		US TREASURY N/B-1.375%-26/08/31	500,000.00	452,597.50	
		US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	4,000,000.00	3,666,716.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	500,000.00	452,636.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	1,100,000.00	1,010,452.30	
		US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,000,000.00	884,023.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	1,500,000.00	1,375,312.50	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	1,100,000.00	998,421.60	
		US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	500,000.00	419,199.00	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	1,100,000.00	923,827.30	
		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	530,000.00	553,290.85	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	600,000.00	541,452.60	
		US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	1,990,000.00	1,674,630.77	
		US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	900,000.00	824,642.10	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	1,000,000.00	852,539.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	900,000.00	764,771.40	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	1,600,000.00	1,355,905.60	
		US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	400,000.00	333,734.00	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	1,500,000.00	1,368,631.50			

US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	1,400,000.00	1,171,979.20	
US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	500,000.00	419,941.00	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	210,000.00	212,747.85	
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	900,000.00	803,161.80	
US TREASURY N/B-2.375%-29/03/31	200,000.00	175,488.20	
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	900,000.00	788,167.80	
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	850,000.00	710,978.25	
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	2,400,000.00	1,954,452.00	
US TREASURY N/B-4.0%-30/02/28	450,000.00	426,128.85	
US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	1,700,000.00	1,290,736.90	
US TREASURY N/B-3.75%-30/05/31	500,000.00	465,703.00	
US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	950,000.00	723,483.90	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	400,000.00	411,250.00	
US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	600,000.00	476,250.00	
US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	900,000.00	687,111.30	
US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	1,000,000.00	765,039.00	
US TREASURY N/B-1.875%-32/02/15	1,000,000.00	792,226.00	
US TREASURY N/B-2.875%-32/05/15	900,000.00	770,062.50	
US TREASURY N/B-4.125%-32/11/15	750,000.00	704,589.75	
US TREASURY N/B-3.5%-33/02/15	800,000.00	714,249.60	
US TREASURY N/B-3.375%-33/05/15	500,000.00	440,937.50	
US TREASURY N/B-3.875%-33/08/15	400,000.00	367,187.20	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	390,000.00	375,131.25	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	170,000.00	158,060.05	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	390,000.00	321,932.52	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	100,000.00	90,921.80	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	230,000.00	208,338.60	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	350,000.00	296,720.55	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	200,000.00	179,968.60	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	200,000.00	165,109.20	
US TREASURY N/B-3.125%-41/11/15	350,000.00	262,568.25	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	300,000.00	208,382.70	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	100,000.00	73,753.90	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	250,000.00	176,279.25	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	140,000.00	111,381.90	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	200,000.00	161,890.60	

		US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	450,000.00	356,308.20	
		US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	120,000.00	91,082.76	
		US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	600,000.00	424,898.40	
		US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	650,000.00	418,462.85	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	450,000.00	317,214.45	
		US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	700,000.00	480,962.30	
		US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	200,000.00	140,218.60	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	950,000.00	602,711.35	
		US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	150,000.00	94,839.75	
		US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	950,000.00	567,699.10	
		US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	300,000.00	203,449.20	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	900,000.00	591,503.40	
		US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,050,000.00	689,308.20	
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	650,000.00	447,077.80	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	1,000,000.00	583,320.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	350,000.00	191,542.75	
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	2,350,000.00	1,033,631.05	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	1,800,000.00	819,491.40	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	1,000,000.00	525,156.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	400,000.00	238,202.80	
		US TREASURY N/B-2.875%-52/05/15	1,270,000.00	847,079.84	
		US TREASURY N/B-4.125%-53/08/15	200,000.00	171,062.40	
			84,040,000.00	70,236,203.29	
				(10,555,096,630)	
米ドル小計					
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-24/11/01	380,000.00	372,187.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	400,000.00	381,064.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	290,000.00	278,713.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	400,000.00	361,708.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	400,000.00	360,952.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	480,000.00	518,404.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	400,000.00	363,168.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	100,000.00	83,352.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	230,000.00	190,198.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-32/12/01	200,000.00	175,040.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	210,000.00	228,144.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	200,000.00	185,930.00	

		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	550,000.00	372,944.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	100,000.00	77,017.00	
加ドル小計			4,340,000.00	3,948,822.70 (429,750,374)	
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	5,000,000.00	4,929,687.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	4,000,000.00	3,577,500.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	2,000,000.00	1,825,625.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	4,000,000.00	3,713,750.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	2,500,000.00	2,172,656.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	4,500,000.00	3,910,781.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	3,000,000.00	2,377,500.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	980,000.00	791,043.75	
メキシコペソ小計			25,980,000.00	23,298,543.75 (190,740,517)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	150,000.00	154,408.95	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	150,000.00	141,768.00	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	100,000.00	92,068.40	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	130,000.00	142,672.79	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	200,000.00	180,133.40	
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	400,000.00	325,216.00	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	550,000.00	463,126.95	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	170,000.00	177,036.30	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	260,000.00	291,399.42	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	150,000.00	155,589.60	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	120,000.00	115,223.40	
		BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	200,000.00	123,559.00	
		BELGIUM KINGDOM-1.4%-53/06/22	50,000.00	27,222.80	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	50,000.00	33,803.95	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	110,000.00	70,332.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-71/10/31	50,000.00	20,082.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%-24/10/31	200,000.00	198,069.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%-25/04/30	300,000.00	291,468.90	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	200,000.00	203,800.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-26/04/30	600,000.00	578,668.80	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	400,000.00	425,010.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%-27/04/30	350,000.00	327,782.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/04/30	300,000.00	274,374.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/07/30	100,000.00	90,990.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	550,000.00	590,771.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	430,000.00	480,395.14	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%-29/10/31	150,000.00	126,158.85	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	150,000.00	134,938.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%- 30/10/31	300,000.00	255,648.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%-31/04/30	300,000.00	229,778.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.7%-32/04/30	200,000.00	155,366.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%- 32/07/30	200,000.00	228,271.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%- 33/04/30	200,000.00	187,645.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%- 33/07/30	300,000.00	261,819.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	430,000.00	429,486.15	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	400,000.00	413,274.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 44/10/31	150,000.00	163,574.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	300,000.00	231,694.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	250,000.00	182,137.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.9%-52/10/31	80,000.00	45,721.28	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%- 66/07/30	100,000.00	77,969.80	
BUNDESobligation-2.4%-28/10/19	150,000.00	147,488.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	500,000.00	481,928.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15	500,000.00	481,231.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	750,000.00	708,631.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	400,000.00	367,872.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15	600,000.00	551,478.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	260,000.00	289,129.36	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-28/02/15	500,000.00	455,063.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	200,000.00	217,483.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-	500,000.00	439,892.00	

29/02/15			
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2. 1%-29/11/15	150,000.00	144,620.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6. 25%-30/01/04	430,000.00	515,124.95	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2. 4%-30/11/15	100,000.00	97,554.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5. 5%-31/01/04	420,000.00	493,868.34	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1. 7%-32/08/15	900,000.00	822,746.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2. 3%-33/02/15	100,000.00	95,614.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4. 75%-34/07/04	300,000.00	349,773.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4. 0%-37/01/04	260,000.00	286,662.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4. 25%-39/07/04	150,000.00	171,075.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4. 75%-40/07/04	270,000.00	326,945.43	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3. 25%-42/07/04	200,000.00	203,163.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2. 5%-44/07/04	250,000.00	226,444.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2. 5%-46/08/15	330,000.00	296,951.49	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-50/08/15	200,000.00	89,212.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-52/08/15	200,000.00	84,057.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1. 8%-53/08/15	250,000.00	186,694.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1. 8%-53/08/15	100,000.00	74,946.40	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2. 2%-24/12/12	200,000.00	197,233.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2. 5%-24/12/01	200,000.00	196,998.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0. 35%-25/02/01	200,000.00	191,259.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5. 0%-25/03/01	450,000.00	456,012.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1. 5%-25/06/01	400,000.00	385,024.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2. 5%-25/11/15	300,000.00	291,652.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4. 5%-26/03/01	550,000.00	556,215.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7. 25%-26/11/01	550,000.00	599,680.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1. 25%-26/12/01	300,000.00	276,175.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2. 05%-27/08/01	400,000.00	372,057.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6. 5%-27/11/01	250,000.00	272,085.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2. 0%-28/02/01	150,000.00	137,601.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0. 25%-28/03/15	150,000.00	126,733.95	

BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%-28/08/01	580,000.00	569,253.18	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-28/09/01	550,000.00	562,848.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	450,000.00	471,176.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-30/03/01	500,000.00	475,425.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-30/08/01	150,000.00	119,372.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%-31/04/01	350,000.00	270,426.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	350,000.00	382,568.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-32/03/01	300,000.00	238,770.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-32/06/01	100,000.00	73,948.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	250,000.00	268,403.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.4%-33/05/01	350,000.00	339,899.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	250,000.00	251,335.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-35/04/30	200,000.00	183,416.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	260,000.00	234,336.18	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	450,000.00	441,145.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	300,000.00	293,067.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01	150,000.00	140,443.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-46/09/01	450,000.00	333,886.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%-48/03/01	400,000.00	304,298.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-52/09/01	140,000.00	77,489.58	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	250,000.00	149,916.00	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	150,000.00	151,472.25	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	200,000.00	196,222.00	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	150,000.00	118,861.95	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	100,000.00	85,270.60	
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	100,000.00	64,319.20	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	70,000.00	21,717.92	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	330,000.00	323,740.56	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	400,000.00	382,503.20	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	450,000.00	473,130.00	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	450,000.00	429,720.30	

FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	400,000.00	402,535.20	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	450,000.00	420,132.15	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	600,000.00	556,551.00	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	500,000.00	492,305.50	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/02/25	450,000.00	406,616.40	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	450,000.00	404,333.55	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	400,000.00	355,189.60	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	490,000.00	545,327.86	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	200,000.00	172,960.80	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	750,000.00	718,460.25	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-30/11/25	100,000.00	79,661.60	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	1,000,000.00	882,687.00	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	850,000.00	1,002,204.40	
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-32/11/25	200,000.00	178,212.80	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	300,000.00	240,070.20	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	180,000.00	199,100.34	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	300,000.00	227,402.10	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	460,000.00	471,651.80	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	150,000.00	114,687.15	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-40/05/25	270,000.00	160,397.55	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	250,000.00	270,338.25	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	370,000.00	333,902.06	
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	200,000.00	139,229.20	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-52/05/25	300,000.00	137,043.90	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	320,000.00	318,225.28	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	350,000.00	348,421.50	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	100,000.00	102,800.10	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	300,000.00	285,997.20	
IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	300,000.00	232,398.00	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	100,000.00	79,190.20	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	100,000.00	73,859.00	
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	50,000.00	30,751.25	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	150,000.00	142,593.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	250,000.00	233,352.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	270,000.00	295,926.75	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	300,000.00	256,709.40	

		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-32/07/15	150,000.00	119,936.10	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	230,000.00	217,625.77	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	300,000.00	319,608.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	200,000.00	128,274.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	50,000.00	52,052.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	200,000.00	179,741.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-54/01/15	100,000.00	74,309.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	130,000.00	80,041.52	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	100,000.00	98,213.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	250,000.00	240,337.25	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	100,000.00	103,621.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	200,000.00	221,508.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	370,000.00	321,045.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	200,000.00	180,001.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	200,000.00	208,542.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	100,000.00	91,213.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	50,000.00	24,753.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	80,000.00	80,418.08	
			47,250,000.00	44,243,697.71	
				(7,021,474,826)	
	ユーロ小計				
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.5%-26/07/22	200,000.00	184,770.00	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	250,000.00	222,768.50	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	150,000.00	148,746.00	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	120,000.00	128,547.00	
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	350,000.00	285,917.80	
		UK TREASURY-0.375%-30/10/22	200,000.00	151,600.00	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	200,000.00	203,730.00	
		UK TREASURY-1.0%-32/01/31	100,000.00	75,909.90	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	280,000.00	275,142.00	
		UK TREASURY-3.25%-33/01/31	200,000.00	179,750.00	
		UK TREASURY-0.875%-33/07/31	280,000.00	198,233.56	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	100,000.00	98,360.00	
		UK TREASURY-0.625%-35/07/31	150,000.00	94,770.00	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	100,000.00	95,193.00	
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	250,000.00	171,941.25	
		UK TREASURY-3.75%-38/01/29	200,000.00	176,106.00	

		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	170,000.00	167,135.50	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	100,000.00	91,630.00	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	120,000.00	112,344.48	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	450,000.00	347,679.00	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	50,000.00	39,844.25	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	350,000.00	311,053.75	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	100,000.00	51,215.60	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	100,000.00	53,330.00	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	560,000.00	492,939.44	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	400,000.00	336,526.00	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	300,000.00	225,608.70	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	900,000.00	856,956.60	
英bond小計			6,730,000.00	5,777,748.33	(1,049,932,426)
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	250,000.00	246,204.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	1,500,000.00	1,405,035.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,750,000.00	1,650,500.25	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	700,000.00	732,032.00	
スウェーデンクローナ小計			4,200,000.00	4,033,771.75	(54,294,567)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	1,000,000.00	967,665.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	1,000,000.00	943,330.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	1,300,000.00	1,194,099.40	
ノルウェークローネ小計			3,300,000.00	3,105,094.40	(41,577,214)
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	500,000.00	485,955.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	2,300,000.00	2,654,462.20	
デンマーククローネ小計			2,800,000.00	3,140,417.20	(66,765,269)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	500,000.00	486,220.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	500,000.00	469,015.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,200,000.00	1,037,580.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	500,000.00	474,440.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	1,000,000.00	859,890.00	
ポーランドズロチ小計			3,700,000.00	3,327,145.00	(118,023,481)

豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	250,000.00	245,945.75	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	250,000.00	230,006.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	330,000.00	329,934.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	150,000.00	152,365.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	200,000.00	188,563.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	350,000.00	330,353.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	500,000.00	443,251.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	300,000.00	235,172.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	150,000.00	120,181.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	250,000.00	196,044.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	400,000.00	356,322.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	450,000.00	321,545.70	
豪ドル小計			3,580,000.00	3,149,685.90	(297,298,852)
ニュージーランドドル	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-25/04/15	150,000.00	144,083.25	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.0%-29/04/20	150,000.00	133,885.50	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-37/04/15	150,000.00	110,302.35	
ニュージーランドドル小計			450,000.00	388,271.10	(33,736,875)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	400,000.00	401,040.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	100,000.00	100,226.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	150,000.00	139,909.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	190,000.00	176,130.00	
シンガポールドル小計			840,000.00	817,306.00	(89,503,180)
マレーシアリングgit	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	1,000,000.00	1,006,390.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,000,000.00	1,008,810.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,400,000.00	1,406,671.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,000,000.00	991,850.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,000,000.00	966,905.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	500,000.00	524,250.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	2,250,000.00	2,283,248.25	
マレーシアリングgit小計			8,150,000.00	8,188,124.75	(256,941,717)
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-2.26%-25/02/24	4,000,000.00	3,995,932.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.35%-25/03/15	1,000,000.00	999,940.00	

	CHINA GOVERNMENT BOND-2.24%-25/05/25	2,000,000.00	1,996,575.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.0%-25/06/15	1,000,000.00	995,223.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-25/08/25	1,000,000.00	996,794.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	2,000,000.00	2,029,693.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-25/11/25	3,000,000.00	2,993,614.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.46%-26/02/15	3,000,000.00	3,003,640.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	1,000,000.00	1,017,368.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.3%-26/05/15	3,000,000.00	2,992,365.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	1,000,000.00	1,007,101.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-26/08/15	1,000,000.00	993,195.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-27/01/20	2,000,000.00	1,993,037.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.48%-27/04/15	3,000,000.00	2,996,172.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	3,000,000.00	2,998,993.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.64%-28/01/15	2,000,000.00	2,008,969.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	4,000,000.00	4,087,174.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.48%-28/09/25	1,000,000.00	995,401.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	1,000,000.00	1,016,122.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-29/03/24	4,000,000.00	4,036,284.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-29/06/15	1,000,000.00	1,005,545.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.79%-29/12/15	4,000,000.00	4,029,486.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-30/03/25	2,000,000.00	2,014,495.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-30/06/25	1,000,000.00	995,598.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-30/09/15	2,000,000.00	1,987,802.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	2,000,000.00	2,051,572.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.89%-31/11/18	1,000,000.00	1,014,582.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	3,000,000.00	3,009,646.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-32/09/01	1,000,000.00	990,698.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-33/02/25	3,000,000.00	3,038,970.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/05/25	3,000,000.00	2,989,771.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	1,000,000.00	1,134,897.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	1,000,000.00	1,117,566.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-3.32%-52/04/15	4,000,000.00	4,205,568.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-52/10/25	1,000,000.00	1,013,766.50	
		73,000,000.00	73,753,561.10	
中国元小計			(1,514,300,741)	
イスラエ	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-0.5%-25/04/30	664,484.24	

ルシケ ル	ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	500,000.00	530,512.51	
	ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	620,000.00	659,456.55	
イスラエルシケル小計		1,820,000.00	1,854,453.30 (68,522,976)	
合計			21,787,959,645 (21,787,959,645)	

(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 92 銘柄	100.0%	48.4%
加ドル	国債証券 14 銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 8 銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券 166 銘柄	100.0%	32.2%
英ポンド	国債証券 28 銘柄	100.0%	4.8%
スウェーデンクローナ	国債証券 4 銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 3 銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 2 銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 5 銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券 12 銘柄	100.0%	1.4%
ニュージーランドドル	国債証券 3 銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 4 銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 7 銘柄	100.0%	1.2%
中国元	国債証券 35 銘柄	100.0%	7.0%
イスラエルシケル	国債証券 3 銘柄	100.0%	0.3%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2 【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2023年10月31日現在です。

【年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）】

【純資産額計算書】

I 資産総額	3,188,795,136円
II 負債総額	868,815円
III 純資産総額（I－II）	3,187,926,321円
IV 発行済口数	2,146,415,748口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.4852円

（参考）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	52,009,067,165円
II 負債総額	1,096,663,631円
III 純資産総額（I－II）	50,912,403,534円
IV 発行済口数	22,079,342,480口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.3059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	299,188,246,816円
II 負債総額	113,319,355円
III 純資産総額（I－II）	299,074,927,461円
IV 発行済口数	60,832,381,122口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	4.9164円

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	20,178,678,293円
II 負債総額	305,315,986円
III 純資産総額（I－II）	19,873,362,307円
IV 発行済口数	8,809,040,794口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.2560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	50,634,185,129円
II 負債総額	8,588,743円
III 純資産総額 (I - II)	50,625,596,386円
IV 発行済口数	38,504,943,036口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.3148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	156,169,000,278円
II 負債総額	284,954,662円
III 純資産総額 (I - II)	155,884,045,616円
IV 発行済口数	57,396,600,725口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	2.7159円

海外債券インデックス (ヘッジあり) マザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	22,284,566,805円
II 負債総額	410,171,350円
III 純資産総額 (I - II)	21,874,395,455円
IV 発行済口数	17,185,972,732口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.2728円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

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なわないものとします。

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2023年10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10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10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10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	845	259,771
株式投資信託	791	222,110
単位型	308	9,478
追加型	483	212,631
公社債投資信託	54	37,661
単位型	41	972
追加型	13	36,689

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 (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						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	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 ル貸建) (注 1)	—	関係会社 短期 貸付金	3,318 (SGD 33,000 千)
							貸付金利息 (シンガポールド ル貸建) (注 1)	103 (SGD 1,043 千)	未収収益	55 (SGD 551 千)
							資金の返済 (米国ドル貸建) (注 2)	2,019 (USD 16,500 千)	関係会社 短期 貸付金	—
							貸付金利息 (米国ドル貸建) (注 2)	3 (USD 26 千)	未収収益	—
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD 千) (注 3)	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	—	配当の受取	7,795 (USD 58,000 千)	—	—

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

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

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

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

(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>5 ヘッジ会計の方法</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>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) 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>(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・ピーティールワイ・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・ピーティールワイ・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 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)>

運用の基本方針

約款第17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、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。

運用方法

(1)投資対象

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

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

証券投資信託 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI (ヘッジあり) マザーファンド

証券投資信託 日本債券インデックスマザーファンド

証券投資信託 海外債券インデックス (ヘッジなし) マザーファンド

証券投資信託 海外債券インデックス (ヘッジあり) マザーファンド

(2)投資態度

主として、上に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長を目指します。

純資産総額に対する株式ならびに公社債および短期金融資産の実質組入率については、下記の標準実質組入率を目処として投資を行ないます。

組入率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないませんが、市況動向等によっては内外の有価証券等への直接投資を行なうことがあります。

株式の標準実質組入率 20%

公社債および短期金融資産の標準実質組入率 80%

また、資金動向等によっては組入率を引き下げることもあります。

ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存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)株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の総額の30%以下とします。

(2)投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の総額の5%以下とします。

(3)外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。

(4)外国為替の売買の予約取引の指図は、約款第28条の範囲で行ないます。

(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

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。)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基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。

③留保益の運用方針

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

(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1兆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50条、第51条第1項、第52条第1項および第54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（受入担保金代用有価証券および第25条に規定する借入有価証券を除きます。）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28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。

(追加日時の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まず。）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。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、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、別に定める年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）自動けいぞく投資約款に従って契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、1口の整数倍をもって取得の申込に応ずることができるものとします。

- ② 前項の取得申込者は、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3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。
- ③ 第1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円とします。
- ④ 前項の手料は、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がそれぞれ独自に定めるものとします。
- ⑤ 第3項の規定にかかわらず、受益者が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39条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、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11条の2 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11条の3 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。

(受益証券の再交付)

第12条 (削 除)

(毀損した場合等の再交付)

第13条 (削 除)

(受益証券の再交付の費用)

第14条 (削 除)

(投資の対象とする資産の種類)

第15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. 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、第20条、第21条および第22条に定めるものに限りません。）
3. 金銭債権
4. 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

(運用の指図範囲および株式への投資制限等)

第16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 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド 受益証券
2. 証券投資信託 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド 受益証券
3. 証券投資信託 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド 受益証券
4. 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
5. 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
6. 証券投資信託 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド 受益証券
7. 株券または新株引受権証書
8. 国債証券
9. 地方債証券
10. 特別の法律により法人の発行する債券
11. 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。）
12. 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。）
13. コマーシャル・ペーパー
14. 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
15. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第7号から第14号までの証券または証書の性質を有するもの
16. 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。）
17. 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。以下次号において同じ。）で次号に定めるもの以外のもの
18. 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。以下本号において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
19. 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。）
20. 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。

21. 預託証券（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。）

22. 外国法人が発行する譲渡性預金証券

23. 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。）

24. 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

25. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第7号の証券または証書ならびに第15号および第21号の証券または証書のうち第7号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第8号から第12号までの証券ならびに第18号の証券ならびに第15号および第21号の証券または証書のうち第8号から第12号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第16号および第17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。）

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前号の権利の性質を有するもの

③ 委託者は、信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしません。

④ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

⑤ 前2項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（受託者の自己または利害関係人等との取引）

第16条の2 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29条において同じ。）、第29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15条ならびに第16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18条から第26条まで、第28条および第34条から第36条までにおける委託者の指図による取引についても同様とします。

（運用の基本方針）

第17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、その指図を行ないま。

（投資する株式等の範囲）

第18条 委託者が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。

（信用取引の指図範囲）

第19条 委託者は、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。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。

- ② 前項の信用取引の指図は、当該売り付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をします。

(先物取引等の運用指図)

- 第20条 委託者は、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（以下同じ。）。
- ② 委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
 - ③ 委託者は、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

(スワップ取引の運用指図)

- 第21条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り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。
- ② 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、原則として第3条に定める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。
 - ③ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。
 - ④ 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図)

- 第22条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ② 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、第3条に定める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。
 - ③ 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
 - ④ 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

- 第23条 委託者は、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各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
1. 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。
 2. 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。
- ② 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
 - ③ 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

(公社債の空売りの指図範囲)

- 第24条 委託者は、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。なお、当該売り付けの決済については、公

社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。

- ② 前項の売り付けの指図は、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

（公社債の借入れ）

第25条 委託者は、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。なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認められた時は、担保の提供の指図を行なうものとします。

- ② 前項の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ③ 信託財産の一部解約等の事由により、前項の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ④ 第1項の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

（外貨建資産への投資制限）

第26条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上り等により100分の50を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

- ② 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該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。

（特別の場合の外貨建有価証券への投資制限）

第27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および範囲）

第28条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- ② 前項の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- ③ 前項の限度額を超えることとなった場合には、委託者は所定の期間内にその超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- ④ 第2項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンド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。

（デリバティブ取引等に係る投資制限）

第28条の2 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。

（信託業務の委託等）

第29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せん。）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30条 （削除）

（混蔵寄託）

第31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。

（一括登録）

第32条 （削除）

（信託財産の登記等および記載等の留保等）

第33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こととします。
- 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34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ならびに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35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、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金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36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37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38条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、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、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金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39条 この信託の計算期間は、毎年10月27日から翌年10月26日までとするを原則とします。ただし、第1計算期間は2001年10月17日から2002年10月26日までとします。

- 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、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40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41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、信託財産の財務諸表の監査に要する費用ならびに当該費用に係る消費税等相当額(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。

(信託報酬等の額)

第42条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第39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53.5の率を乗じて得た額とします。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。)および毎計算期末、または信託終了のとき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43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。

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。ただし、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。ただし、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。

(収益分配金の再投資等)

第44条 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交付されます。

- 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、別に定める契約に基づき、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、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。
- ③ 第49条第3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、前項の規定にかかわらず、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受益者に支払います。
- ④ 収益分配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。

(記名式受益証券への変更ならびに受益証券の返還請求の取扱い)

第45条 (削除)

(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46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47条第1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47条第2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。

(償還金および一部解約金の支払い)

第47条 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、)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。

- ② 一部解約金は、第49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。
- ③ 前2項に規定する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ます。
- ④ 第44条第3項に規定する信託の一部解約に係る受益権に帰属する収益分配金は、原則として、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受益者に支払います。
- ⑤ 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。

(償還金の時効)

第48条 受益者が、信託終了による償還金について第47条第1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49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と確実な受益証券をもって行なうものとします。
- ③ 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。

- ④ 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0.15%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。
- ⑤ 委託者は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、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。
- ⑥ 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を一部解約の実行の請求日として、第4項の規定に準じて算定した価額とします。

(質権口記載または記録の受益権の取り扱い)

第49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50条 委託者は、信託期間中において、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ときは、第1項の信託契約の解約を行いません。
- ⑤ 委託者は、この信託契約の解約を行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51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55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52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55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53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54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55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55条 委託者は、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、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第56条 第50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50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57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57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58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、「年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）自動けいぞく投資約款」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「年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）自動けいぞく投資約款」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、「年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）自動けいぞく投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。
- 第2条 第44条第4項および第47条第5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いい、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、第12条から第14条までおよび第45条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。
- 第4条 第22条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- ② 第22条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 2001年10月17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

