

世界の財産3分法ファンド (不動産・債券・株式) 毎月分配型

追加型投信／内外／資産複合

◆この目論見書により行なう「世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を2023年3月15日に関東財務局長に提出しており、2023年3月16日にその効力が発生しております。

有価証券届出書提出日	: 2023年3月15日
発行者名	: 日興アセットマネジメント株式会社
代表者の役職氏名	: 代表取締役社長 ステファニー・ドゥルーズ
本店の所在の場所	: 東京都港区赤坂九丁目7番1号
有価証券届出書（訂正届出書を含みます。） の写しを縦覧に供する場所	: 該当事項はありません。

設定・運用は

日興アセットマネジメント

投資信託は、金融機関の預金や保険契約とは商品性が異なります。

- 投資信託は、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはなりません。
- 投資信託は、元金および利回り保証のいずれもありません。
- 投資信託をご購入されたお客様は、投資した資産の価値の減少を含むリスクを負います。

－ 目 次 －

	頁
第一部【証券情報】	1
第二部【ファンド情報】	3
第1【ファンドの状況】	3
第2【管理及び運営】	61
第3【ファンドの経理状況】	66
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	247
第三部【委託会社等の情報】	248
約款	304

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

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

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

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

(5)【申込手数料】

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

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

(6)【申込単位】

販売会社の照会先にお問い合わせください。

(7)【申込期間】

2023年3月16日から2023年9月15日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8)【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(9)【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

① ファンドの目的

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

② ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

◇追加型投信

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

◇内外

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

◇資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

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

◇年12回(毎月)

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

◇グローバル(含む日本)

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

◇ファミリーファンド

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

◇為替ヘッジなし

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

③ ファンドの特色



主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行ないます。

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



国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

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



原則として、毎月、安定した収益分配を行なうことをめざします。

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

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

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



「財産3分法」とは？

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

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

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



主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行います。

[世界の財産3分法ファンド] 基本組入比率

国内の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)
東証REIT指数(配当込み)

国内の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

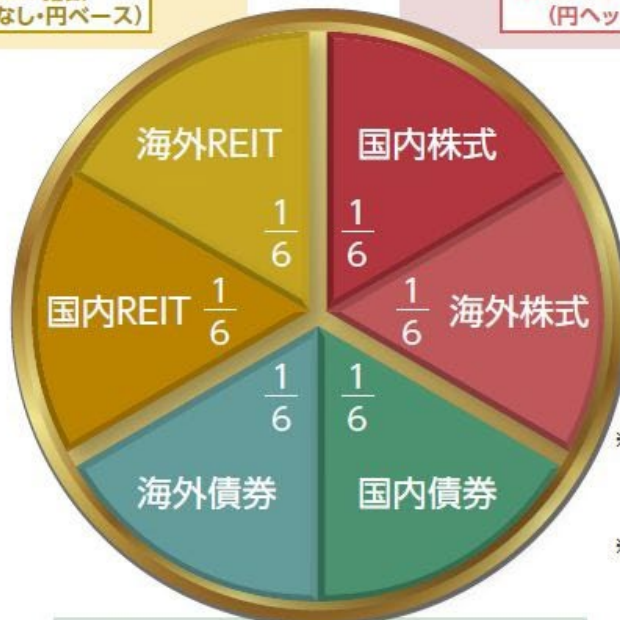
連動をめざす指数(インデックス)
TOPIX(東証株価指数)

海外の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

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

海外の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)
MSCI-KOKUSAI インデックス
(円ヘッジなし・円ベース)



※「基本組入比率」および「連動をめざす指数(インデックス)」は、2022年12月末現在のものであり、将来変更となる場合があります。
 ※市況動向および資金動向などにより左記のような運用ができない場合があります。

国内の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)
NOMURA-BPI総合

海外の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

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



国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

それぞれの資産は、異なる値動きをする傾向があります。

各資産の値動きの特徴

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

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

ご参考: 設定来のファンドと各資産の推移 (マザーファンドベース)

(2005年9月(設定月)~2022年12月、月末値)

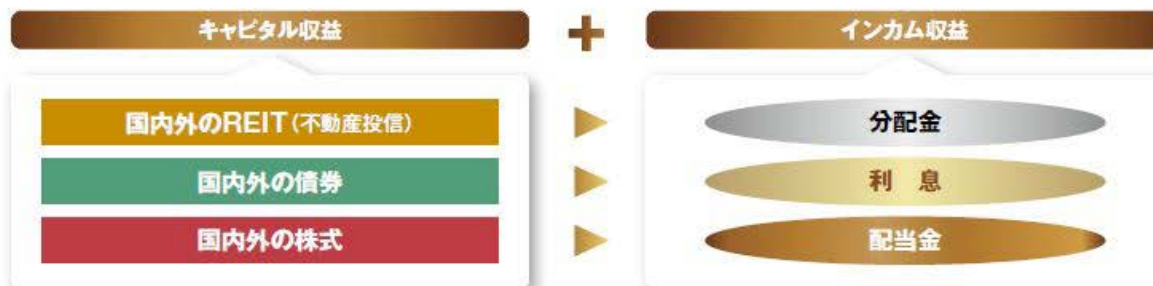


- ※基準価額は信託報酬(後述の「手続・手数料等」参照)控除後の1万円当たりの値です。
- ※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。
- ※各資産の値動きは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの値動きを示しています。
- ※上記グラフは過去のものであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。



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

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



ご参考:各指数の利回り

(2022年12月末現在)



- ◆ REIT: 実績分配金利回り
国内: 東証REIT指数(配当込み)
海外: S&P先進国REIT指数(除く日本)
 - ◆ 債券: 最終利回りなど
国内: NOMURA-BPI総合
海外: FTSE世界国債インデックス(除く日本)
 - ◆ 株式: 実績配当利回りなど
国内: TOPIX(東証株価指数)
海外: MSCI-KOKUSAIインデックス
- ※利回りは切り捨てにて端数処理しています。

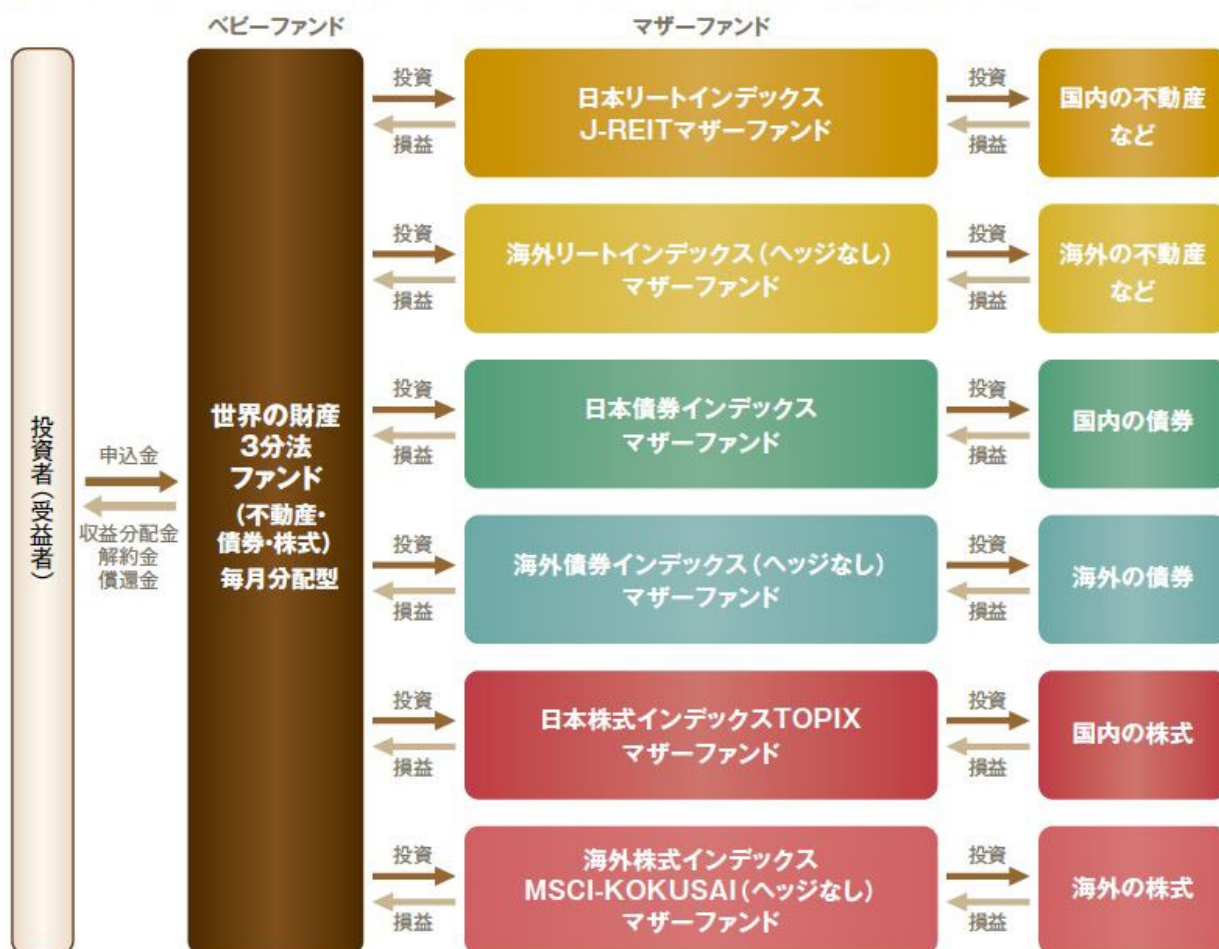
※各資産のリスク特性はそれぞれ異なるため、利回りだけで比較できるものではありません。
※上記は過去の各指数の利回りであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

各指数(インデックス)の著作権などの権利について

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

■ファンドの仕組み

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



(主な投資制限)

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

(分配方針)

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

収益分配金に関する留意事項

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

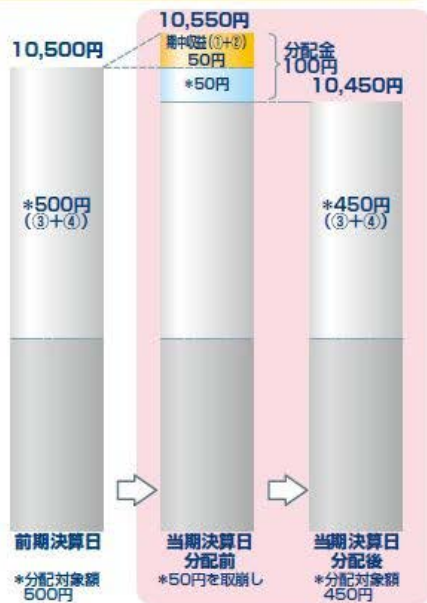
投資信託で分配金が支払われるイメージ



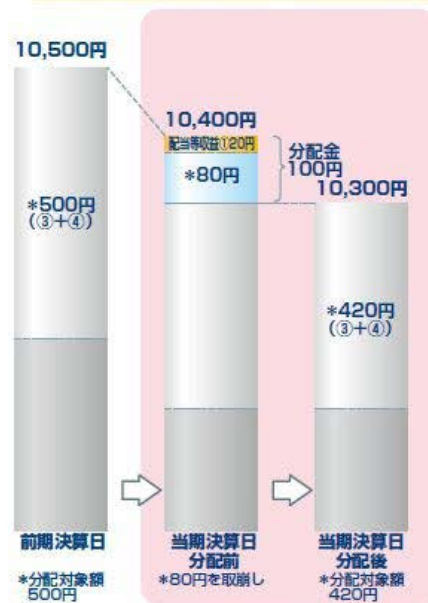
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算から基準価額が上昇した場合



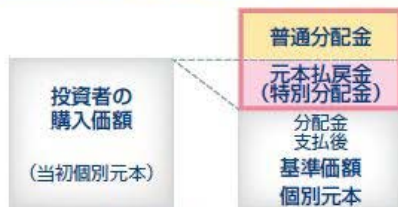
前期決算から基準価額が下落した場合



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

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

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



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

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

④ 信託金限度額

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

(2) 【ファンドの沿革】

2005 年 9 月 29 日

- ・ ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2006 年 3 月 9 日

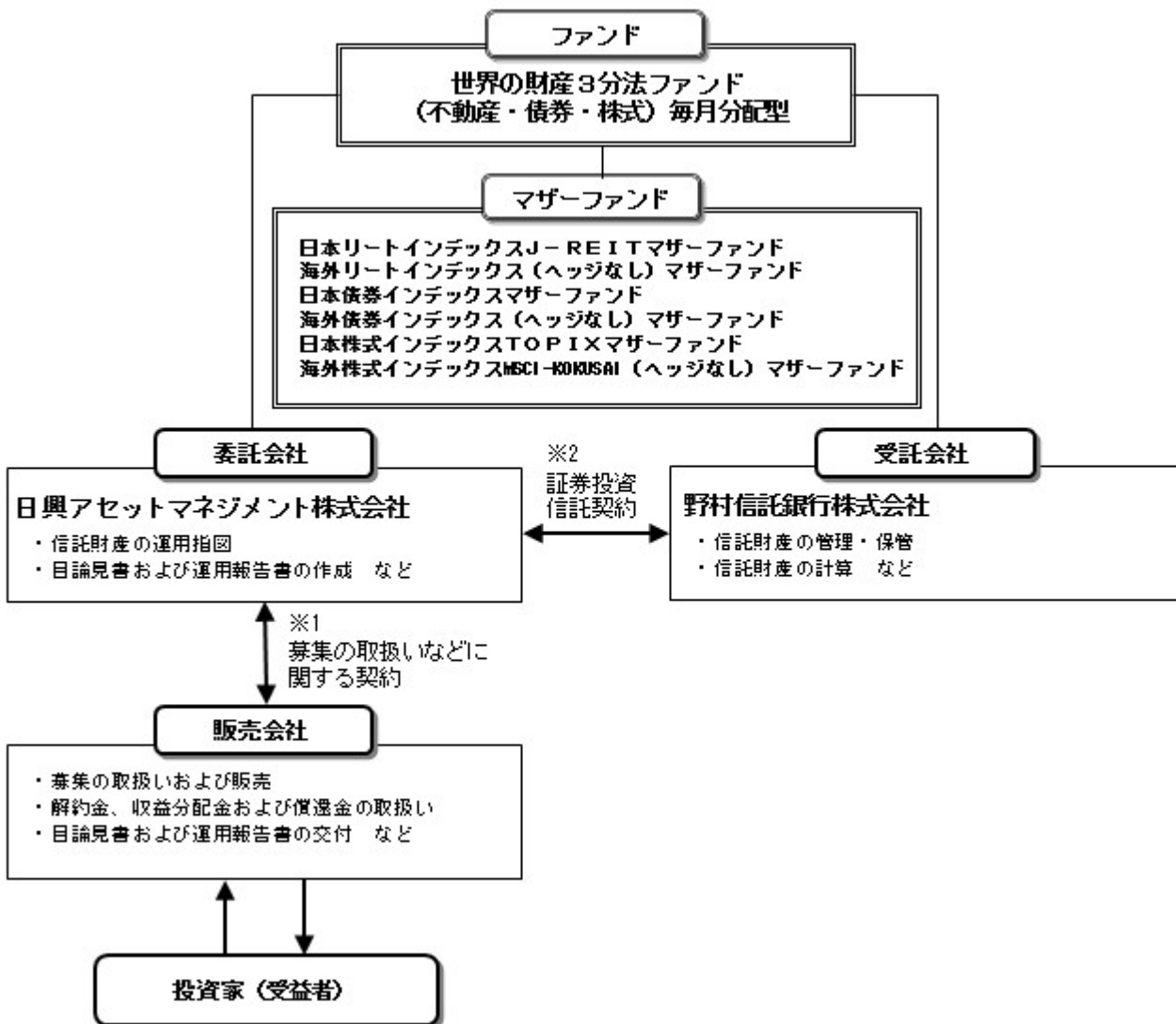
- ・ ファンド名称変更

新名称：世界の財産 3 分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型

旧名称：世界の財産 3 分法ファンド（バランス重視）毎月分配型

(3) 【ファンドの仕組み】

① ファンドの仕組み



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

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

② 委託会社の概況 (2022 年 12 月末現在)

1) 資本金

17,363 百万円

2) 沿革

1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

3) 大株主の状況

名 称	住 所	所有株数	所有比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	192,211,000株	97.562%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

(2)【投資対象】

<世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型>

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

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

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

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

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

④ 次の取引ができます。

- 1) 外国為替予約取引
- 2) 資金の借入

<日本リートインデックスJ-REITマザーファンド>

わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

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

<海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

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

① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

- 1) 預金

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

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

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

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

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

◆投資対象とする投資信託証券の概要

<日本リートインデックスJ-R E I Tマザーファンド>

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

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

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

<海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

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

* S & P先進国REIT指数（除く日本）は、スタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスーズ エル エル シー（S & P社）が発表している、日本を除く世界の主要国の不動産投信市場の合成パフォーマンスを表す指数です。（ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

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

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

<海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）*の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として世界各国の債券に投資し、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 運用の効率化をはかるため*、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。 ※下線部は、2023年4月11日付で「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」に変更予定です。 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、 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数）*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）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>

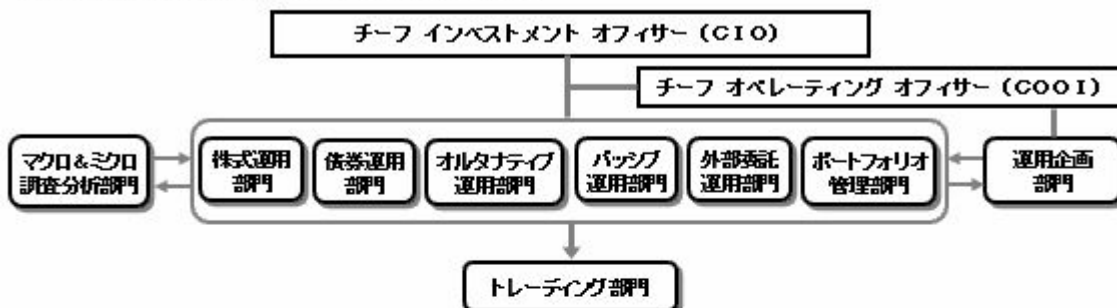
運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAI インデックス (円ヘッジなし・円ベース) *に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として日本を除く世界各国の株式 (DR (預託証券) およびカントリーファンド等を含みます。) に投資し、MSCI-KOKUSAI インデックス (円ヘッジなし・円ベース) の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。 投資対象資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。(円ヘッジなし・円ベース) とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。

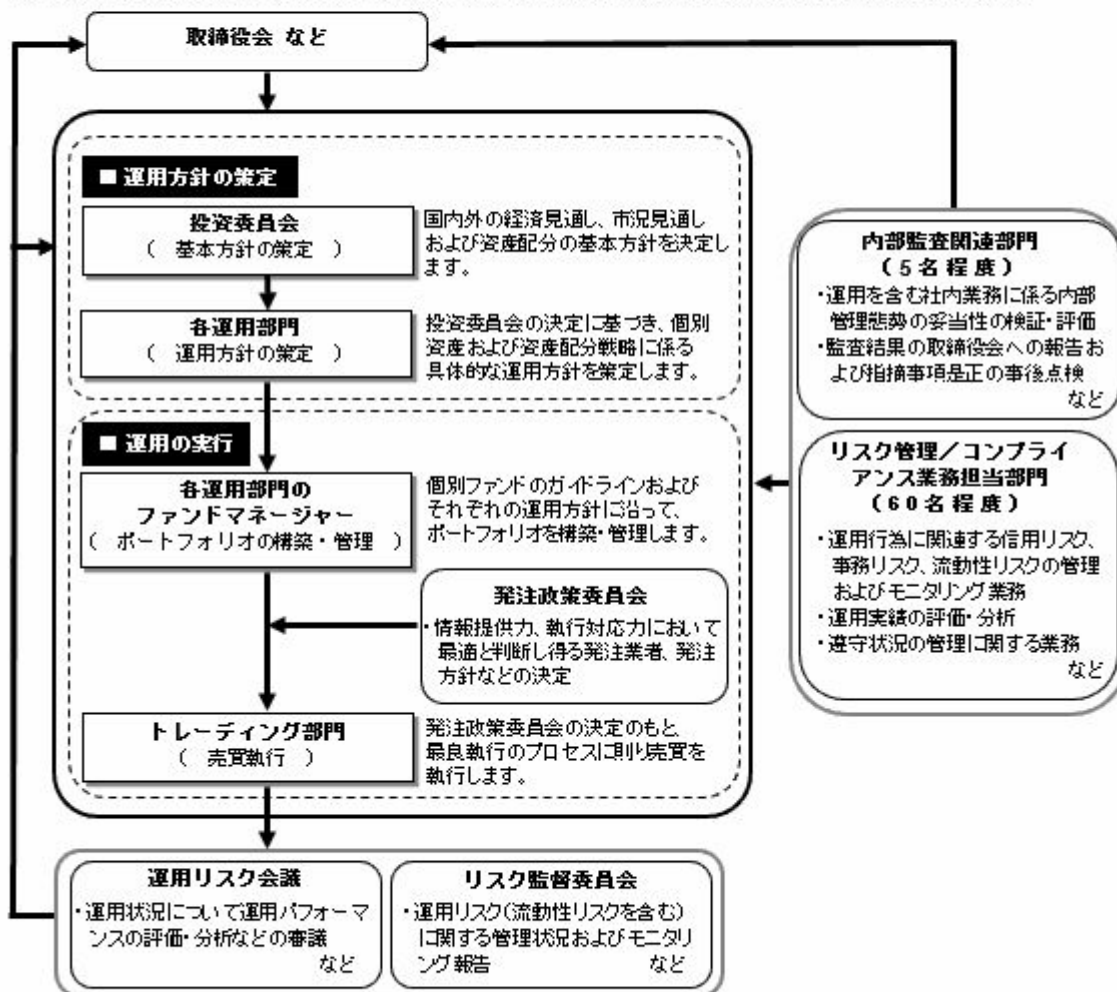
同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は MSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



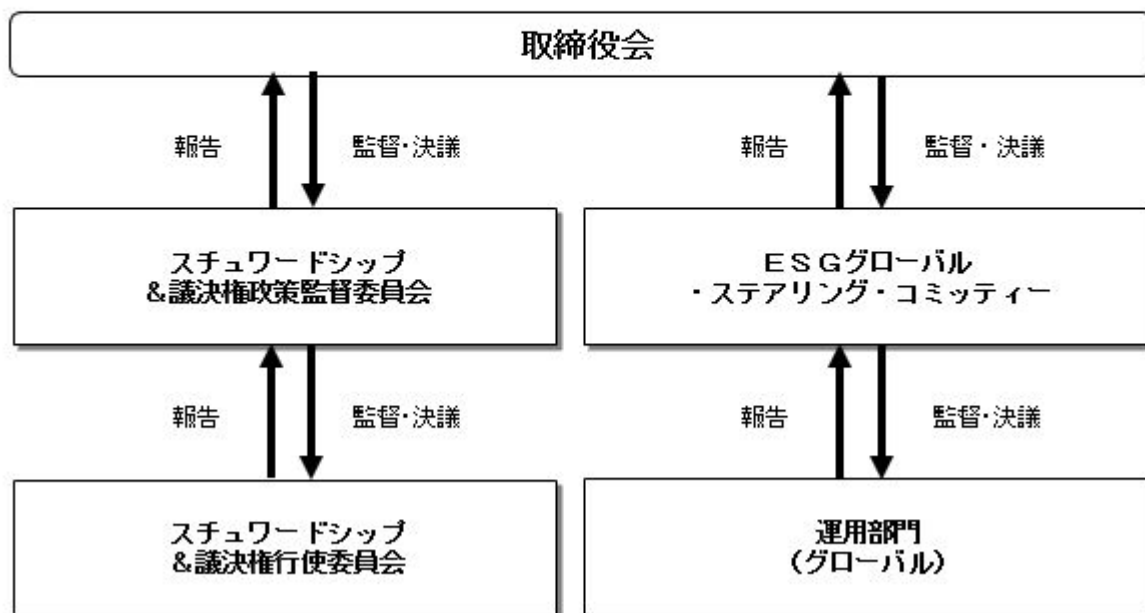
委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティー

ESG（環境、社会、企業統治）やフィデューシャリーは、当委託会社にとって最高位に位置する概念であるため、同原則に関連する決議、報告、議論は、当委託会社の取締役会にて行なうこととしています。

（スチュワードシップ&議決権政策監督委員会は、議長含め社外委員が過半数以上を占めるメンバーで構成されています）



※上記体制は 2022 年 12 月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

① 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

1) 分配対象額の範囲

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

2) 分配対象額についての分配方針

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

3) 留保益の運用方針

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

② 収益分配金の支払い

<分配金再投資コース>

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

<分配金受取りコース>

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

(5) 【投資制限】

① 約款に定める投資制限

<世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型>

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

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

3) 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。

4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

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

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

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

<日本リートインデックスJ-REITマザーファンド>

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

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

<海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

<海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

下記の変更を予定しております。

≪2023 年 4 月 10 日まで≫

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

《2023 年 4 月 11 日以降》

- 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、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、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、
- 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、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、
- 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。

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

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

- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

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

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

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

- 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 16) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一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）の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・当ファンドは、主に不動産投信、債券および株式を実質的な投資対象としますので、不動産投信、債券および株式の価格の下落や、不動産投信、債券および株式の発行体の財務状況や業績の悪化、不動産の市況の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

① 価格変動リスク

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

② 流動性リスク

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

③ 信用リスク

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

- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れが生じた場合や廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

④ 為替変動リスク

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

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

<その他の留意事項>

・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

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

・投資対象とする投資信託証券に関する事項

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

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

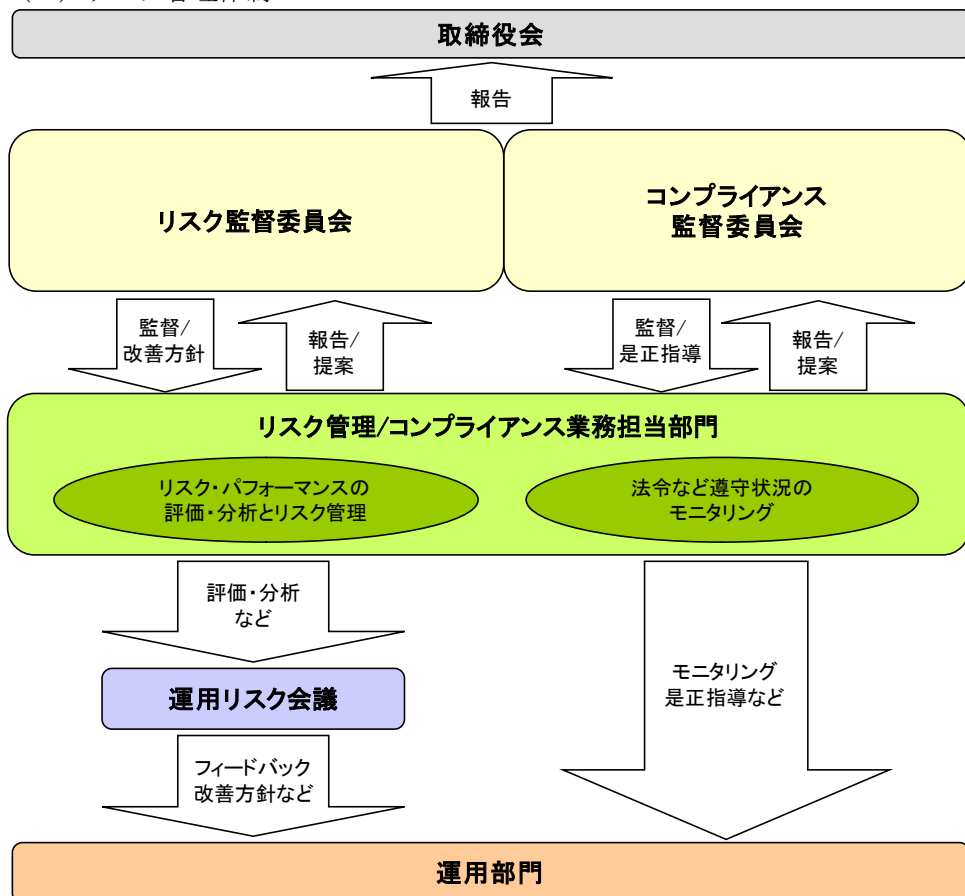
・運用制限や規制上の制限に関する事項

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。

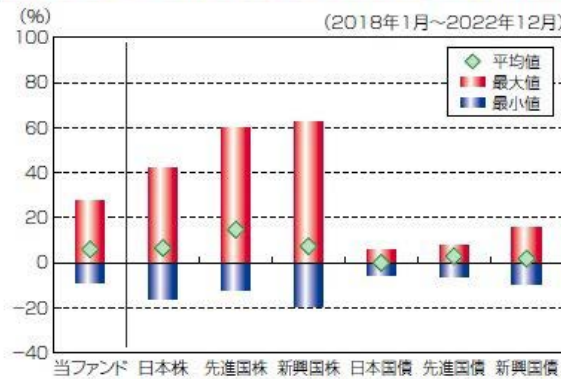
■法令など遵守状況のモニタリング

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2022年12月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	5.9%	6.5%	14.7%	7.3%	-0.1%	2.9%	1.8%
最大値	27.4%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	7.9%	15.7%
最小値	-8.7%	-16.0%	-12.4%	-19.4%	-5.5%	-6.1%	-9.4%

※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1月から2022年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株 ……東証株価指数(TOPIX、配当込)
 先進国株 ……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込、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、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1月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

日本国債 ……NOMURA-BPI国債
 先進国債 ……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
 新興国債 ……JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド(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

東証株価指数（TOPIX、配当込）

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、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、円ベース）

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

NOMURA-BPI 国債

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

FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

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

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

(2) 【換金（解約）手数料】

- ① 換金手数料
ありません。

② 信託財産留保額

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

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

(3) 【信託報酬等】

① 信託報酬

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

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

② 信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

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

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

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

③ 支払時期

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

<投資対象とする投資信託証券に係る費用>

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

※監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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。

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニア NISA」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

② 法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③ 個別元本

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

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

④ 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

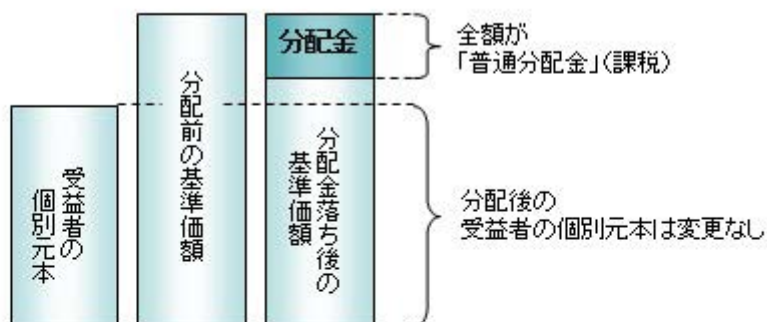
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

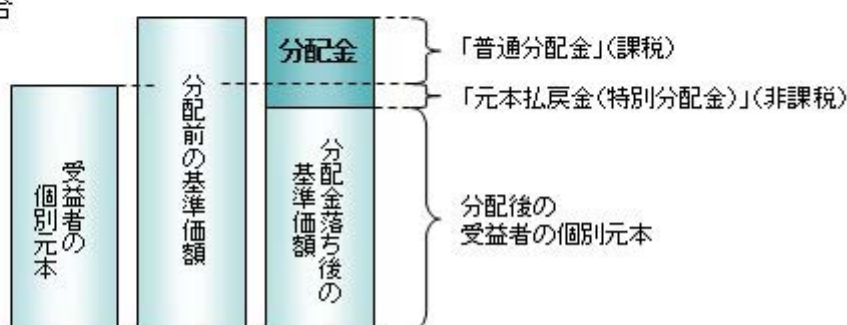
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

※上記は2023年3月15日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

【世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

以下の運用状況は2022年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	35,412,619,044	98.33
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	601,004,046	1.67
合計（純資産総額）		36,013,623,090	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	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	3,209,818,280	1.9688	6,319,490,230	1.8901	6,066,877,531	16.85
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	4,487,475,535	1.3614	6,109,249,194	1.3412	6,018,602,187	16.71
日本	親投資信託受益証券	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	2,380,323,201	2.5804	6,142,185,988	2.5135	5,982,942,365	16.61
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	1,442,393,664	4.3001	6,202,545,391	4.0668	5,865,926,552	16.29
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	2,357,442,973	2.5868	6,098,283,937	2.4634	5,807,325,019	16.13
日本	親投資信託受益証券	海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	2,158,633,242	2.7896	6,021,862,337	2.6271	5,670,945,390	15.75

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.33
合計	98.33

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16 特定期間末 (2013年 6月 17日)	57,765	57,856	0.6378	0.6388
第17 特定期間末 (2013年 12月 16日)	55,238	55,317	0.6910	0.6920
第18 特定期間末 (2014年 6月 16日)	52,281	52,353	0.7290	0.7300
第19 特定期間末 (2014年 12月 15日)	52,113	52,176	0.8237	0.8247
第20 特定期間末 (2015年 6月 15日)	48,576	48,632	0.8576	0.8586
第21 特定期間末 (2015年 12月 15日)	42,709	42,762	0.8131	0.8141
第22 特定期間末 (2016年 6月 15日)	39,155	39,206	0.7769	0.7779
第23 特定期間末 (2016年 12月 15日)	39,745	39,793	0.8277	0.8287
第24 特定期間末 (2017年 6月 15日)	36,443	36,487	0.8278	0.8288
第25 特定期間末 (2017年 12月 15日)	34,568	34,608	0.8629	0.8639
第26 特定期間末 (2018年 6月 15日)	32,895	32,934	0.8573	0.8583
第27 特定期間末 (2018年 12月 17日)	31,635	31,672	0.8421	0.8431
第28 特定期間末 (2019年 6月 17日)	31,844	31,881	0.8638	0.8648
第29 特定期間末 (2019年 12月 16日)	32,740	32,776	0.9108	0.9118
第30 特定期間末 (2020年 6月 15日)	29,571	29,607	0.8310	0.8320
第31 特定期間末 (2020年 12月 15日)	31,006	31,041	0.8907	0.8917
第32 特定期間末 (2021年 6月 15日)	34,941	34,975	1.0217	1.0227
第33 特定期間末 (2021年 12月 15日)	36,248	36,283	1.0365	1.0375
第34 特定期間末 (2022年 6月 15日)	35,426	35,462	0.9906	0.9916
第35 特定期間末 (2022年 12月 15日)	37,443	37,480	1.0208	1.0218
2021年 12月 末日	36,926	—	1.0583	—
2022年 1月 末日	35,217	—	1.0102	—
2月 末日	34,787	—	0.9978	—
3月 末日	36,717	—	1.0566	—
4月 末日	36,456	—	1.0451	—
5月 末日	36,704	—	1.0333	—
6月 末日	36,719	—	1.0198	—
7月 末日	37,975	—	1.0470	—
8月 末日	38,024	—	1.0442	—
9月 末日	36,404	—	0.9956	—
10月 末日	38,079	—	1.0386	—
11月 末日	37,645	—	1.0267	—

12月末日	36,013	—	0.9801	—
-------	--------	---	--------	---

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

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金(円)
第16特定期間	2012年12月18日～2013年6月17日	0.0070
第17特定期間	2013年6月18日～2013年12月16日	0.0060
第18特定期間	2013年12月17日～2014年6月16日	0.0060
第19特定期間	2014年6月17日～2014年12月15日	0.0060
第20特定期間	2014年12月16日～2015年6月15日	0.0060
第21特定期間	2015年6月16日～2015年12月15日	0.0060
第22特定期間	2015年12月16日～2016年6月15日	0.0060
第23特定期間	2016年6月16日～2016年12月15日	0.0060
第24特定期間	2016年12月16日～2017年6月15日	0.0060
第25特定期間	2017年6月16日～2017年12月15日	0.0060
第26特定期間	2017年12月16日～2018年6月15日	0.0060
第27特定期間	2018年6月16日～2018年12月17日	0.0060
第28特定期間	2018年12月18日～2019年6月17日	0.0060
第29特定期間	2019年6月18日～2019年12月16日	0.0060
第30特定期間	2019年12月17日～2020年6月15日	0.0060
第31特定期間	2020年6月16日～2020年12月15日	0.0060
第32特定期間	2020年12月16日～2021年6月15日	0.0060
第33特定期間	2021年6月16日～2021年12月15日	0.0060
第34特定期間	2021年12月16日～2022年6月15日	0.0060
第35特定期間	2022年6月16日～2022年12月15日	0.0060

③【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
第16特定期間	2012年12月18日～2013年6月17日	19.36
第17特定期間	2013年6月18日～2013年12月16日	9.28
第18特定期間	2013年12月17日～2014年6月16日	6.37
第19特定期間	2014年6月17日～2014年12月15日	13.81
第20特定期間	2014年12月16日～2015年6月15日	4.84
第21特定期間	2015年6月16日～2015年12月15日	△4.49
第22特定期間	2015年12月16日～2016年6月15日	△3.71
第23特定期間	2016年6月16日～2016年12月15日	7.31
第24特定期間	2016年12月16日～2017年6月15日	0.74
第25特定期間	2017年6月16日～2017年12月15日	4.96
第26特定期間	2017年12月16日～2018年6月15日	0.05
第27特定期間	2018年6月16日～2018年12月17日	△1.07

第 28 特定期間	2018 年 12 月 18 日～2019 年 6 月 17 日	3.29
第 29 特定期間	2019 年 6 月 18 日～2019 年 12 月 16 日	6.14
第 30 特定期間	2019 年 12 月 17 日～2020 年 6 月 15 日	△8.10
第 31 特定期間	2020 年 6 月 16 日～2020 年 12 月 15 日	7.91
第 32 特定期間	2020 年 12 月 16 日～2021 年 6 月 15 日	15.38
第 33 特定期間	2021 年 6 月 16 日～2021 年 12 月 15 日	2.04
第 34 特定期間	2021 年 12 月 16 日～2022 年 6 月 15 日	△3.85
第 35 特定期間	2022 年 6 月 16 日～2022 年 12 月 15 日	3.65

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

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第 16 特定期間	2012 年 12 月 18 日～2013 年 6 月 17 日	755,347,566	13,250,917,932
第 17 特定期間	2013 年 6 月 18 日～2013 年 12 月 16 日	381,538,280	11,009,976,725
第 18 特定期間	2013 年 12 月 17 日～2014 年 6 月 16 日	548,220,875	8,763,039,619
第 19 特定期間	2014 年 6 月 17 日～2014 年 12 月 15 日	848,123,250	9,300,633,130
第 20 特定期間	2014 年 12 月 16 日～2015 年 6 月 15 日	1,077,889,968	7,702,577,651
第 21 特定期間	2015 年 6 月 16 日～2015 年 12 月 15 日	822,766,387	4,936,873,357
第 22 特定期間	2015 年 12 月 16 日～2016 年 6 月 15 日	559,222,913	2,691,021,175
第 23 特定期間	2016 年 6 月 16 日～2016 年 12 月 15 日	788,561,373	3,167,580,874
第 24 特定期間	2016 年 12 月 16 日～2017 年 6 月 15 日	535,316,706	4,530,717,126
第 25 特定期間	2017 年 6 月 16 日～2017 年 12 月 15 日	675,282,245	4,636,099,733
第 26 特定期間	2017 年 12 月 16 日～2018 年 6 月 15 日	900,474,282	2,591,559,940
第 27 特定期間	2018 年 6 月 16 日～2018 年 12 月 17 日	1,657,593,437	2,463,297,514
第 28 特定期間	2018 年 12 月 18 日～2019 年 6 月 17 日	1,553,018,779	2,252,941,131
第 29 特定期間	2019 年 6 月 18 日～2019 年 12 月 16 日	1,375,802,750	2,295,826,563
第 30 特定期間	2019 年 12 月 17 日～2020 年 6 月 15 日	1,727,094,985	2,087,383,750
第 31 特定期間	2020 年 6 月 16 日～2020 年 12 月 15 日	1,154,110,398	1,927,320,256
第 32 特定期間	2020 年 12 月 16 日～2021 年 6 月 15 日	2,277,192,099	2,890,774,812
第 33 特定期間	2021 年 6 月 16 日～2021 年 12 月 15 日	2,642,144,579	1,866,998,446
第 34 特定期間	2021 年 12 月 16 日～2022 年 6 月 15 日	2,197,942,225	1,407,308,080
第 35 特定期間	2022 年 6 月 16 日～2022 年 12 月 15 日	2,127,865,577	1,212,529,506

(参考)

日本リートインデックス J-REIT マザーファンド

以下の運用状況は 2022 年 12 月 30 日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	54,313,582,000	98.97
コール・ローン等、その他資産 (負債控除後)	—	567,602,296	1.03
合計 (純資産総額)		54,881,184,296	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	5,975	667,582.98	3,988,808,340	588,000	3,513,300,000	6.40
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	5,121	602,507.34	3,085,440,127	577,000	2,954,817,000	5.38
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	25,840	101,817.56	2,630,965,917	104,700	2,705,448,000	4.93
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	16,562	160,645.26	2,660,606,805	163,000	2,699,606,000	4.92
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	8,633	318,777.73	2,752,008,168	308,500	2,663,280,500	4.85
日本	投資証券	G L P 投資法人 投資証券	16,530	154,117.89	2,547,568,766	151,300	2,500,989,000	4.56
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	7,720	292,219.84	2,255,937,241	293,400	2,265,048,000	4.13
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	10,204	177,004.35	1,806,152,403	186,500	1,903,046,000	3.47
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,121	336,472.27	1,723,074,523	339,000	1,736,019,000	3.16
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	11,456	137,292.13	1,572,818,707	150,600	1,725,273,600	3.14
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	3,502	387,891.63	1,358,396,503	370,500	1,297,491,000	2.36
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	16,516	63,362.4	1,046,493,429	77,500	1,279,990,000	2.33
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	7,653	170,953.13	1,308,304,315	151,800	1,161,725,400	2.12
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	22,541	39,558.09	891,679,090	51,000	1,149,591,000	2.09
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	15,390	76,282.6	1,173,989,338	74,600	1,148,094,000	2.09
日本	投資証券	アクティブピア・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,704	398,242.3	1,076,847,193	413,000	1,116,752,000	2.03
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	3,453	308,099.55	1,063,867,754	313,500	1,082,515,500	1.97

日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,768	640,529.42	1,132,456,015	603,000	1,066,104,000	1.94
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	6,270	165,472.05	1,037,509,789	160,100	1,003,827,000	1.83
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,023	503,507.65	1,018,595,977	481,000	973,063,000	1.77
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,900	508,148.11	965,481,416	512,000	972,800,000	1.77
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	2,980	317,017.76	944,712,933	320,000	953,600,000	1.74
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	6,022	146,189.13	880,350,965	157,400	947,862,800	1.73
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	5,669	147,374.76	835,467,530	154,500	875,860,500	1.60
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	7,097	112,294.19	796,951,911	114,900	815,445,300	1.49
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	4,792	155,999	747,547,234	163,900	785,408,800	1.43
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	3,756	203,943.52	766,011,878	205,600	772,233,600	1.41
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,760	433,003.4	762,085,998	422,000	742,720,000	1.35
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	3,434	186,984.26	642,103,975	207,500	712,555,000	1.30
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,382	319,467.09	760,970,614	296,600	706,501,200	1.29

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.97
合計	98.97

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2022年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	アメリカ	38,378,797,970	75.57
	カナダ	930,592,595	1.83
	ドイツ	24,183,205	0.05
	イタリア	6,914,001	0.01
	フランス	883,753,691	1.74
	オランダ	96,425,413	0.19
	スペイン	214,970,817	0.42
	ベルギー	548,668,822	1.08
	アイルランド	21,441,999	0.04
	イギリス	2,316,901,576	4.56
	オーストラリア	3,329,278,704	6.56
	ニュージーランド	141,773,505	0.28
	香港	742,223,809	1.46
	シンガポール	1,871,273,921	3.68
	韓国	126,497,475	0.25
	イスラエル	71,672,234	0.14
ガーンジー	116,648,430	0.23	
	小計	49,822,018,167	98.10
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	966,862,784	1.90
合計（純資産総額）		50,788,880,951	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	—	33,150,400	0.07

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	276,222	14,705.81	4,062,069,355	15,123.81	4,177,531,532	8.23
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	27,695	82,612.38	2,287,950,002	88,294.59	2,445,318,919	4.81
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	47,313	39,638.81	1,875,431,349	37,498.36	1,774,160,191	3.49
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	187,740	8,368.06	1,571,019,960	8,496.78	1,595,185,665	3.14

アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	97,817	13,012.56	1,272,849,777	15,568.36	1,522,850,661	3.00
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	288,093	3,820.43	1,100,640,004	4,300.80	1,239,032,391	2.44
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	141,466	10,123.68	1,432,156,940	8,735.64	1,235,796,190	2.43
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	86,064	16,279.63	1,401,090,593	13,442.51	1,156,916,181	2.28
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	41,907	24,521.63	1,027,628,074	21,583.65	904,506,230	1.78
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	44,674	18,240.94	814,895,843	19,268.04	860,780,419	1.69
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	101,890	9,089.95	926,175,006	7,940.76	809,084,852	1.59
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	512,474	1,607.78	823,946,217	1,555.83	797,322,885	1.57
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	40,072	21,314.27	854,105,588	19,773.62	792,368,781	1.56
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	119,699	6,357.65	761,005,186	6,045.81	723,677,651	1.42
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	34,558	21,295.69	735,936,663	20,932.09	723,371,443	1.42
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	37,077	19,927.55	738,854,105	19,218.94	712,580,675	1.40
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	173,840	4,468.00	776,718,684	3,984.98	692,749,097	1.36
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	62,342	10,700.92	667,117,253	10,414.29	649,248,041	1.28
香港	投資証券	LINK REIT	631,200	1,130.63	713,659,084	966.73	610,203,763	1.20
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	86,995	6,335.09	551,121,851	6,652.25	578,712,576	1.14
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	19,408	33,608.92	652,282,094	28,433.62	551,839,872	1.09
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	161,069	3,146.31	506,774,133	3,344.04	538,621,179	1.06
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	77,061	5,897.18	454,443,204	6,904.38	532,058,504	1.05
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	184,740	2,581.01	476,816,711	2,807.93	518,737,358	1.02
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	31,883	16,652.52	530,932,391	14,987.13	477,834,921	0.94
アメリカ	投資証券	UDR INC	91,708	5,615.86	515,019,656	5,163.35	473,521,144	0.93
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	52,420	9,071.37	475,521,320	8,667.96	454,374,673	0.89
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	213,925	2,279.78	487,703,220	2,097.98	448,811,869	0.88
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	361,356	1,502.39	542,901,254	1,238.39	447,503,270	0.88
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,560,446	231.09	360,604,402	260.64	406,728,221	0.80

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.10
合計	98.10

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	250,000.00	33,510,000	33,150,400	0.07

(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2022年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	40,502,275,120	84.82
地方債証券	日本	3,345,765,840	7.01
特殊債券	日本	3,514,904,847	7.36
社債券	日本	300,909,000	0.63
コール・ローン等、その他資産 (負債控除後)	—	87,798,020	0.18
合計 (純資産総額)		47,751,652,827	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	100.99	706,944,000	100.70	704,956,000	0.300	2025/12/20	1.48
日本	国債証券	第344回利付国債 (10年)	700,000,000	100.30	702,136,000	99.90	699,349,000	0.100	2026/9/20	1.46
日本	国債証券	第346回利付国債 (10年)	690,000,000	100.17	691,207,500	99.64	687,550,500	0.100	2027/3/20	1.44
日本	国債証券	第347回利付国債 (10年)	680,000,000	100.14	681,005,400	99.51	676,695,200	0.100	2027/6/20	1.42
日本	国債証券	第345回利付国債 (10年)	660,000,000	100.23	661,547,700	99.78	658,567,800	0.100	2026/12/20	1.38
日本	国債証券	第349回利付国債 (10年)	640,000,000	99.94	639,667,200	99.26	635,296,000	0.100	2027/12/20	1.33
日本	国債証券	第350回利付国債 (10年)	640,000,000	99.83	638,969,600	99.10	634,246,400	0.100	2028/3/20	1.33
日本	国債証券	第340回利付国債 (10年)	620,000,000	101.21	627,551,600	100.93	625,784,600	0.400	2025/9/20	1.31
日本	国債証券	第358回利付国債 (10年)	600,000,000	98.91	593,460,000	97.52	585,138,000	0.100	2030/3/20	1.23
日本	国債証券	第352回利付国債 (10年)	590,000,000	99.64	587,929,100	98.76	582,719,400	0.100	2028/9/20	1.22
日本	国債証券	第339回利付国債 (10年)	570,000,000	101.11	576,338,400	100.85	574,896,300	0.400	2025/6/20	1.20
日本	国債証券	第360回利付国債 (10年)	580,000,000	98.53	571,485,600	97.10	563,191,600	0.100	2030/9/20	1.18
日本	国債証券	第357回利付国債 (10年)	560,000,000	99.12	555,072,000	97.77	547,512,000	0.100	2029/12/20	1.15
日本	国債証券	第343回利付国債 (10年)	545,000,000	100.34	546,885,700	100.03	545,185,300	0.100	2026/6/20	1.14
日本	国債証券	第342回利付国債 (10年)	530,000,000	100.37	531,976,900	100.11	530,588,300	0.100	2026/3/20	1.11
日本	国債証券	第351回利付国債 (10年)	535,000,000	99.74	533,646,450	98.92	529,254,100	0.100	2028/6/20	1.11

日本	国債証券	第348回利付国債 (10年)	500,000,000	100.04	500,240,000	99.39	496,970,000	0.100	2027/9/20	1.04
日本	国債証券	第335回利付国債 (10年)	490,000,000	101.00	494,929,400	100.80	493,934,700	0.500	2024/9/20	1.03
日本	国債証券	第359回利付国債 (10年)	420,000,000	98.68	414,493,800	97.29	408,655,800	0.100	2030/6/20	0.86
日本	国債証券	第144回利付国債 (20年)	370,000,000	110.86	410,204,200	109.28	404,354,500	1.500	2033/3/20	0.85
日本	国債証券	第140回利付国債 (20年)	358,000,000	112.91	404,235,700	111.31	398,518,440	1.700	2032/9/20	0.83
日本	国債証券	第353回利付国債 (10年)	400,000,000	99.54	398,172,000	98.59	394,392,000	0.100	2028/12/20	0.83
日本	国債証券	第338回利付国債 (10年)	390,000,000	101.01	393,970,200	100.78	393,049,800	0.400	2025/3/20	0.82
日本	国債証券	第366回利付国債 (10年)	400,000,000	100.00	400,000,000	98.09	392,372,000	0.200	2032/3/20	0.82
日本	国債証券	第362回利付国債 (10年)	400,000,000	98.36	393,448,000	96.77	387,080,000	0.100	2031/3/20	0.81
日本	国債証券	第117回利付国債 (20年)	343,000,000	113.55	389,493,650	111.71	383,165,300	2.100	2030/3/20	0.80
日本	国債証券	第145回利付国債 (20年)	315,000,000	112.87	355,543,650	111.20	350,302,050	1.700	2033/6/20	0.73
日本	国債証券	第355回利付国債 (10年)	350,000,000	99.37	347,816,000	98.20	343,714,000	0.100	2029/6/20	0.72
日本	国債証券	第368回利付国債 (10年)	350,000,000	99.52	348,333,500	98.03	343,136,500	0.200	2032/9/20	0.72
日本	国債証券	第356回利付国債 (10年)	350,000,000	99.25	347,378,500	98.00	343,024,500	0.100	2029/9/20	0.72

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	84.82
地方債証券	7.01
特殊債券	7.36
社債券	0.63
合計	99.82

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

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2022年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	71,942,917,821	50.35
	カナダ	2,903,838,304	2.03
	メキシコ	1,212,950,233	0.85
	ドイツ	9,513,360,585	6.66
	イタリア	10,633,296,673	7.44
	フランス	12,144,980,508	8.50
	オランダ	2,260,530,797	1.58
	スペイン	7,152,128,591	5.01
	ベルギー	2,645,150,657	1.85
	オーストリア	1,672,812,901	1.17
	フィンランド	728,459,984	0.51
	アイルランド	909,013,103	0.64
	イギリス	6,570,757,848	4.60
	スウェーデン	288,609,042	0.20
	ノルウェー	299,539,581	0.21
	デンマーク	472,536,629	0.33
	ポーランド	627,079,333	0.44
	オーストラリア	2,239,293,702	1.57
	ニュージーランド	315,083,002	0.22
	シンガポール	678,175,603	0.47
マレーシア	781,673,330	0.55	
中国	5,177,506,036	3.62	
イスラエル	485,647,733	0.34	
	小計	141,655,341,996	99.14
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	1,233,497,876	0.86
合計（純資産総額）		142,888,839,872	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	—	125,965,610	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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,100,000	11,275.95	913,351,969	11,310.08	916,116,741	0.500	2027/8/31	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,480,000	10,926.49	817,301,998	11,209.26	838,452,819	1.625	2031/5/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,190,000	11,654.89	837,986,904	11,620.32	835,501,097	1.750	2029/11/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,600,000	10,497.81	797,833,869	10,803.90	821,096,804	1.250	2031/8/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	11,068.00	774,760,656	11,280.01	789,601,283	0.375	2027/7/31	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	12,284.08	737,044,824	12,378.94	742,736,412	0.375	2024/9/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,830,000	10,543.94	720,151,649	10,845.37	740,739,049	1.375	2031/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,500,000	10,989.21	714,299,219	11,294.79	734,161,451	1.875	2032/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	11,319.41	679,164,818	11,556.82	693,409,338	1.500	2028/11/30	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,190,000	12,738.62	661,134,756	12,759.41	662,213,692	2.250	2024/10/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	10,400.36	635,462,149	10,649.17	650,664,593	0.875	2030/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,774.18	638,709,464	12,868.78	643,439,489	3.000	2025/7/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,692.02	634,601,463	12,860.49	643,024,801	3.250	2027/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,749.56	637,478,359	12,842.35	642,117,677	2.875	2025/6/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,980,000	12,532.33	624,110,489	12,736.60	634,283,087	3.250	2029/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,526.67	626,333,636	12,614.27	630,713,771	0.125	2024/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,501.79	625,089,573	12,588.87	629,443,792	0.250	2024/3/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,316.73	615,836,854	12,408.48	620,424,333	0.375	2024/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	11,963.85	610,156,414	12,123.38	618,292,840	2.750	2032/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,650,000	12,694.10	590,275,775	12,758.89	593,288,743	2.250	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,730,000	12,411.07	587,044,016	12,536.52	592,977,464	2.000	2025/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,620,000	12,768.22	589,892,139	12,819.54	592,263,012	2.375	2024/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	12,065.85	583,987,195	12,230.68	591,965,370	1.625	2026/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,640,000	12,642.26	586,601,178	12,701.87	589,367,146	1.750	2024/7/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	12,002.95	576,141,808	12,274.75	589,188,000	2.875	2032/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	12,370.12	581,396,022	12,461.87	585,708,252	0.250	2024/6/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	11,871.97	571,041,958	12,101.35	582,075,354	2.375	2029/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,530,000	12,553.10	568,655,834	12,638.63	572,530,316	2.000	2025/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,590,000	12,080.10	554,476,655	12,306.62	564,874,272	2.625	2029/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,630,000	11,880.53	550,068,896	12,111.72	560,772,909	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	99.14
合計	99.14

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	950,000.00	126,897,000	125,965,610	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。

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2022年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	42,838,158,730	99.21
コール・ローン等、その他資産 (負債控除後)	—	340,346,318	0.79
合計 (純資産総額)		43,178,505,048	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	359,385,000	0.83

(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	862,800	2,018.45	1,741,520,108	1,812.50	1,563,825,000	3.62
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	111,200	9,887.77	1,099,520,600	10,035.00	1,115,892,000	2.58
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	985,100	711.32	700,721,332	889.00	875,753,900	2.03
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,700	51,221.27	804,174,000	51,420.00	807,294,000	1.87
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	201,900	4,101.86	828,167,083	3,762.00	759,547,800	1.76
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	113,100	4,223.05	477,627,600	5,296.00	598,977,600	1.39
日本	株式	第一三共	医薬品	137,300	4,543.96	623,886,792	4,250.00	583,525,000	1.35
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	139,500	3,828.23	534,038,700	4,111.00	573,484,500	1.33
日本	株式	任天堂	その他製品	99,200	6,066.92	601,838,600	5,532.00	548,774,400	1.27
日本	株式	日立製作所	電気機器	79,700	6,547.24	521,815,200	6,691.00	533,272,700	1.24
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	91,100	6,028.26	549,174,700	5,644.00	514,168,400	1.19
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	119,600	4,616.44	552,127,400	4,177.00	499,569,200	1.16
日本	株式	KDDI	情報・通信業	121,800	4,402.08	536,173,800	3,982.00	485,007,600	1.12
日本	株式	三井物産	卸売業	121,700	3,307.17	402,482,800	3,853.00	468,910,100	1.09
日本	株式	三菱商事	卸売業	104,000	4,097.56	426,146,700	4,283.00	445,432,000	1.03
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	155,800	2,660.51	414,508,242	2,827.50	440,524,500	1.02
日本	株式	信越化学工業	化学	26,600	15,471.44	411,540,304	16,225.00	431,585,000	1.00
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	11,100	39,188.01	434,987,000	38,880.00	431,568,000	1.00
日本	株式	HOYA	精密機器	33,700	14,673.67	494,502,679	12,705.00	428,158,500	0.99
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	100,300	3,911.37	392,311,400	4,146.00	415,843,800	0.96

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	223,800	1,627.44	364,221,114	1,856.00	415,372,800	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	127,800	3,357.57	429,098,400	3,032.00	387,489,600	0.90
日本	株式	ダイキン工業	機械	19,000	21,865.92	415,452,500	20,200.00	383,800,000	0.89
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	253,200	1,471.79	372,659,050	1,488.00	376,761,600	0.87
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	17,100	19,168.27	327,777,500	19,160.00	327,636,000	0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	57,300	5,592.69	320,461,400	5,660.00	324,318,000	0.75
日本	株式	村田製作所	電気機器	47,700	7,165.94	341,815,700	6,588.00	314,247,600	0.73
日本	株式	ファナック	電気機器	15,400	20,483.05	315,439,000	19,835.00	305,459,000	0.71
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	151,100	2,042.39	308,606,600	2,006.50	303,182,150	0.70
日本	株式	SMC	機械	5,100	58,380.00	297,738,000	55,580.00	283,458,000	0.66

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	0.10
		鉱業	0.31
		建設業	1.96
		食料品	3.50
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.18
		化学	6.07
		医薬品	5.76
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.69
		鉄鋼	0.77
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.55
		機械	4.99
		電気機器	16.42
		輸送用機器	7.25
		精密機器	2.56
		その他製品	2.33
		電気・ガス業	1.27
		陸運業	3.11
		海運業	0.63
		空運業	0.52
倉庫・運輸関連業	0.15		
情報・通信業	8.88		
卸売業	6.00		
小売業	4.73		

	銀行業	6.42
	証券、商品先物取引業	0.74
	保険業	2.53
	その他金融業	1.13
	不動産業	1.96
	サービス業	5.33
合 計		99.21

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03月	買建	19	日本円	361,270,450	359,385,000	0.83

(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2022年12月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	163,784,485,250	66.48
	カナダ	8,995,404,318	3.65
	ドイツ	6,020,329,947	2.44
	イタリア	1,286,580,176	0.52
	フランス	7,970,173,669	3.24
	オランダ	4,336,420,741	1.76
	スペイン	1,832,226,411	0.74
	ベルギー	624,491,677	0.25
	オーストリア	139,268,184	0.06
	ルクセンブルク	174,836,630	0.07
	フィンランド	938,387,524	0.38
	アイルランド	4,629,073,791	1.88
	ポルトガル	135,161,537	0.05
	イギリス	10,685,124,426	4.34
	スイス	8,398,206,431	3.41
	スウェーデン	2,301,347,176	0.93
	ノルウェー	565,288,020	0.23
	デンマーク	2,170,685,407	0.88
	ケイマン	465,622,336	0.19
	オーストラリア	5,366,094,760	2.18
	バミューダ	154,575,323	0.06
	ニュージーランド	175,922,546	0.07
	香港	1,777,858,187	0.72
	シンガポール	846,885,719	0.34
	イスラエル	603,259,292	0.24
	ジャージー	797,952,776	0.32
アラブ首長国連邦	0	0.00	
マン島	52,882,192	0.02	
小計		235,228,544,446	95.49
投資証券	アメリカ	4,775,731,367	1.94
	カナダ	11,714,692	0.00
	フランス	103,034,492	0.04
	ベルギー	29,613,689	0.01
	イギリス	102,013,547	0.04

	オーストラリア	309,390,735	0.13
	香港	83,912,684	0.03
	シンガポール	118,666,826	0.05
	小計	5,534,078,032	2.25
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	5,585,510,702	2.27
合計（純資産総額）		246,348,133,180	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,624,031,025	1.88
	買建	ドイツ	939,898,386	0.38

(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	—	3,220,588,430	1.31

(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	621,044	20,200.74	12,545,550,698	17,199.24	10,681,489,154	4.34
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	273,724	33,218.54	9,092,712,301	31,982.02	8,754,248,359	3.55
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	354,230	15,897.20	5,631,267,964	11,170.68	3,956,992,102	1.61
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	231,650	13,831.31	3,204,025,049	11,737.31	2,718,949,020	1.10
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	36,200	71,662.48	2,594,181,905	70,315.07	2,545,405,751	1.03
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	214,290	13,892.13	2,976,945,886	11,803.66	2,529,407,373	1.03
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	101,691	22,673.60	2,305,701,554	23,562.21	2,396,064,900	0.97
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	160,701	14,067.52	2,260,665,657	14,490.84	2,328,692,479	0.95
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	50,265	38,490.63	1,934,731,543	41,012.26	2,061,481,349	0.84
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	113,400	16,315.23	1,850,147,866	17,678.29	2,004,718,540	0.81
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	92,369	17,405.15	1,607,697,187	20,248.69	1,870,351,524	0.76
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・	96,200	17,663.88	1,699,266,193	19,378.18	1,864,181,012	0.76

			半導体製造装置						
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	63,322	25,850.15	1,636,883,669	27,609.56	1,748,292,685	0.71
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	71,841	23,235.83	1,669,285,649	23,663.06	1,699,978,181	0.69
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	39,720	38,595.61	1,533,017,932	42,518.40	1,688,831,126	0.69
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	107,090	15,556.21	1,665,914,651	15,561.29	1,666,458,803	0.68
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	102,905	29,375.22	3,022,857,032	16,165.51	1,663,512,218	0.68
アメリカ	株式	MASTERCARD INC	ソフトウェア・サービス	33,300	41,401.33	1,378,664,485	46,207.46	1,538,708,651	0.62
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	31,169	46,669.43	1,454,639,694	48,703.55	1,518,041,075	0.62
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	216,830	6,063.01	1,314,643,578	6,811.49	1,476,935,594	0.60
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	68,346	19,904.94	1,360,423,260	21,571.71	1,474,340,228	0.60
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	97,873	12,996.80	1,272,035,863	14,705.81	1,439,302,134	0.58
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	88,110	18,152.24	1,599,394,148	15,958.50	1,406,103,611	0.57
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	159,292	7,833.23	1,247,771,057	8,486.16	1,351,778,195	0.55
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	53,491	23,671.48	1,266,211,428	24,148.74	1,291,740,572	0.52
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	280,229	4,699.10	1,316,826,780	4,397.67	1,232,356,908	0.50
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	15,625	61,235.77	956,809,006	74,021.38	1,156,584,172	0.47
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	15,722	70,383.16	1,106,564,089	73,097.54	1,149,239,665	0.47
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	64,125	15,374.11	985,865,243	17,895.91	1,147,575,742	0.47
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	27,153	47,584.20	1,292,053,897	42,094.25	1,142,985,415	0.46

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	5.81
		素材	4.39
		資本財	6.63
		商業・専門サービス	1.20
		運輸	1.87
		自動車・自動車部品	1.49
		耐久消費財・アパレル	1.62
		消費者サービス	1.86
		メディア・娯楽	4.65
		小売	4.29
		食品・生活必需品小売り	1.50
		食品・飲料・タバコ	4.44
		家庭用品・パーソナル用品	1.89
		ヘルスケア機器・サービス	5.01
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.53
		銀行	5.97
		各種金融	4.74
		保険	3.40
		不動産	0.34
		ソフトウェア・サービス	10.22
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.78		
電気通信サービス	1.44		
公益事業	3.25		
半導体・半導体製造装置	4.15		
投資証券	—	—	2.25
合計			97.73

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 EMINI2303	買建	180	米ドル	35,646,437.5	4,730,282,256	34,845,750	4,624,031,025	1.88
	ドイツ	ユーレックス ・ドイツ 金融先物取 引所	DJSTX5 2303	買建	180	ユーロ	6,720,370	950,730,744	6,643,800	939,898,386	0.38

(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	18,700,000.00	2,520,484,700	2,466,376,220	1.00
	ユーロ	買建	5,350,000.00	766,880,125	754,212,210	0.31

(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

2022年12月30日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額……………9,801円

純資産総額……………360.13億円

※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、2012年12月末の基準価額を起点として指数化しています。

※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2022年8月	2022年9月	2022年10月	2022年11月	2022年12月	直近1年間累計	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	120円	5,300円

主要な資産の状況

組入資産	投資対象	比率*1	組入上位の銘柄名	国名	比率*2
日本リートインデックス J-REITマザーファンド	日本リート	16.6%	日本ビルファンド投資法人 投資証券	日本	6.4%
			ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	日本	5.4%
			日本都市ファンド投資法人 投資証券	日本	4.9%
			野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	日本	4.9%
			日本プロロジスリート投資法人 投資証券	日本	4.9%
海外リートインデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外リート	15.7%	PROLOGIS INC	アメリカ	8.2%
			EQUINIX INC	アメリカ	4.8%
			PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.5%
			REALTY INCOME CORP	アメリカ	3.1%
			SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.0%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	16.7%	第341回利付国債(10年)	日本	1.5%
			第344回利付国債(10年)	日本	1.5%
			第346回利付国債(10年)	日本	1.4%
			第347回利付国債(10年)	日本	1.4%
			第345回利付国債(10年)	日本	1.4%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外債券	16.1%	US TREASURY N/B(0.5%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(1.625%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(1.75%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(1.25%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(0.375%)	アメリカ	0.6%
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	16.8%	トヨタ自動車	日本	3.6%
			ソニーグループ	日本	2.6%
			三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	2.0%
			キーエンス	日本	1.9%
			日本電信電話	日本	1.8%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	海外株式	16.3%	APPLE INC	アメリカ	4.3%
			MICROSOFT CORP	アメリカ	3.6%
			AMAZON.COM INC	アメリカ	1.6%
			ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.1%
			UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	1.0%
現金その他		1.7%			

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

*2:各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



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

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

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

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

(2) コースの選択

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

＜分配金再投資コース＞

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

＜分配金受取りコース＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 取扱時間

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

(5) 取得申込不可日

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

●ニューヨーク証券取引所の休業日

●ニューヨークの銀行休業日

(6) 申込金額

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

(7) 申込単位

販売会社の照会先にお問い合わせください。

(8) 申込代金の支払い

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

(9) 受付の中止および取消

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

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

(10) 償還乗換

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

・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。

(11) 乗換優遇

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

2【換金（解約）手続等】

＜解約請求による換金＞

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

- ニューヨーク証券取引所の休業日
- ニューヨークの銀行休業日

(4) 解約制限

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

(5) 解約価額

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

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 手取額

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

(7) 解約単位

1口単位

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

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

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

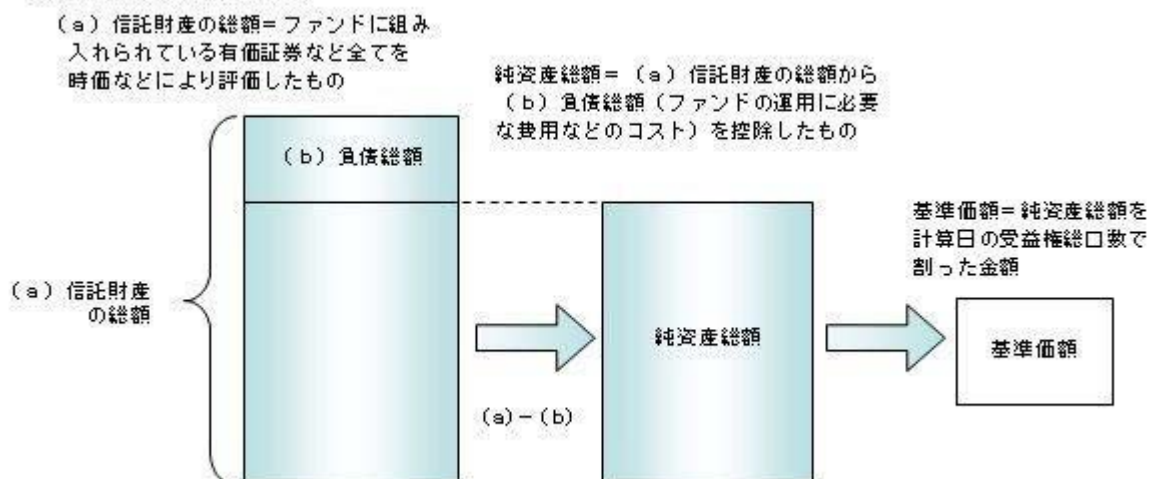
3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

① 基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



② 有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

◇マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

◇国内上場株式

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

◇外国株式

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

◇公社債 (国内・外国)

原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。

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

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

*外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

◇国内上場不動産投信

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

◇海外上場不動産投信

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

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

③ 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

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

(5) 【その他】

① 信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 受益者の解約により受益権の口数が 10 億口を下回るようになった場合
 - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（1 ヶ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 ヶ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して 5 営業日まで）から受益者に支払います。
- ・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

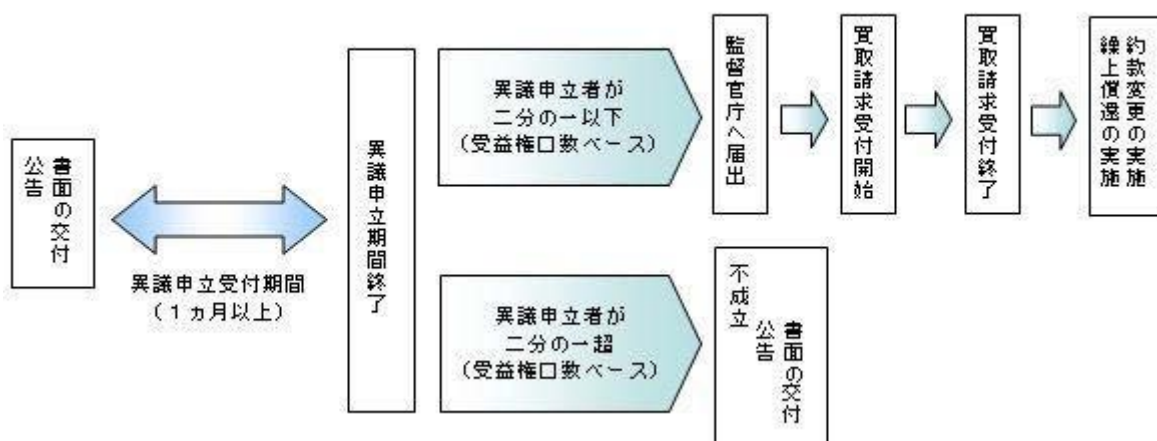
③ 信託約款の変更

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）
- 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

④ 異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるとときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
- 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



⑤ 公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

⑥ 運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

⑦ 関係法人との契約について

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

4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 38 年大蔵省令第 59 号）並びに同規則第 2 条の 2 の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、6 ヶ月未満であるため、財務諸表は 6 ヶ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、2022 年 6 月 16 日から 2022 年 12 月 15 日までの特定期間の財務諸表について、P w C あらた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

2023年3月1日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 榎原 康太
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2022年6月16日から2022年12月15日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2022年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

1 【財務諸表】

【世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 2022年6月15日現在	当期 2022年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	765,689,623	664,141,270
親投資信託受益証券	34,761,176,247	36,867,115,693
未収入金	-	4,115,223
流動資産合計	35,526,865,870	37,535,372,186
資産合計	35,526,865,870	37,535,372,186
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	35,763,757	36,679,093
未払解約金	27,598,322	19,443,502
未払受託者報酬	1,645,245	1,699,401
未払委託者報酬	29,614,595	30,589,408
未払利息	333	1,084
その他未払費用	5,822,834	3,125,059
流動負債合計	100,445,086	91,537,547
負債合計	100,445,086	91,537,547
純資産の部		
元本等		
元本	35,763,757,188	36,679,093,259
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△337,336,404	764,741,380
(分配準備積立金)	6,306,389,406	6,412,654,432
元本等合計	35,426,420,784	37,443,834,639
純資産合計	35,426,420,784	37,443,834,639
負債純資産合計	35,526,865,870	37,535,372,186

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期		当期	
	自 2021年12月16日 至 2022年6月15日		自 2022年6月16日 至 2022年12月15日	
営業収益				
有価証券売買等損益		△1,235,069,362		1,498,424,587
営業収益合計		△1,235,069,362		1,498,424,587
営業費用				
支払利息		32,368		129,134
受託者報酬		9,852,407		10,320,389
委託者報酬		177,344,373		185,768,125
その他費用		3,035,239		3,814,684
営業費用合計		190,264,387		200,032,332
営業利益又は営業損失(△)		△1,425,333,749		1,298,392,255
経常利益又は経常損失(△)		△1,425,333,749		1,298,392,255
当期純利益又は当期純損失(△)		△1,425,333,749		1,298,392,255
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(△)		13,619,075		4,736,345
期首剰余金又は期首欠損金(△)		1,275,636,443		△337,336,404
剰余金増加額又は欠損金減少額		69,294,698		61,007,789
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,684,819		2,622,523
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		64,609,879		58,385,266
剰余金減少額又は欠損金増加額		33,048,401		33,726,641
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		32,102,802		33,726,641
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		945,599		-
分配金		210,266,320		218,859,274
期末剰余金又は期末欠損金(△)		△337,336,404		764,741,380

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	前期 2022年6月15日現在	当期 2022年12月15日現在
1. 期首元本額	34,973,123,043円	35,763,757,188円
期中追加設定元本額	2,197,942,225円	2,127,865,577円
期中一部解約元本額	1,407,308,080円	1,212,529,506円
2. 受益権の総数	35,763,757,188口	36,679,093,259口
3. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	337,336,404円	－円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2021年12月16日 至 2022年6月15日	当期 自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
自 2021年12月16日 至 2022年1月17日	自 2022年6月16日 至 2022年7月15日
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 24,906,055円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 71,667,167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 1,527,789,851円	C 信託約款に定める収益調整金 2,059,274,216円
D 信託約款に定める分配準備積立 金 6,455,583,978円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 6,277,745,888円
E 分配対象収益 (A+B+C+D) 8,008,279,884円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 8,408,687,271円
F 分配対象収益(1万口当たり) 2,296円	F 分配対象収益(1万口当たり) 2,324円
G 分配金額 34,869,284円	G 分配金額 36,179,299円
H 分配金額(1万口当たり) 10円	H 分配金額(1万口当たり) 10円
自 2022年1月18日 至 2022年2月15日	自 2022年7月16日 至 2022年8月15日
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 14,811,134円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 65,026,374円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益 192,093,097円
C 信託約款に定める収益調整金 1,562,540,605円	C 信託約款に定める収益調整金 2,126,493,600円
D 信託約款に定める分配準備積立 金 6,405,335,103円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 6,275,108,862円
E 分配対象収益 (A+B+C+D) 7,982,686,842円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 8,658,721,933円
F 分配対象収益(1万口当たり) 2,291円	F 分配対象収益(1万口当たり) 2,385円
G 分配金額 34,842,827円	G 分配金額 36,302,330円
H 分配金額(1万口当たり) 10円	H 分配金額(1万口当たり) 10円
自 2022年2月16日 至 2022年3月15日	自 2022年8月16日 至 2022年9月15日
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 49,231,838円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益 55,996,325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 1,583,983,784円	C 信託約款に定める収益調整金 2,219,466,777円
D 信託約款に定める分配準備積立 金 6,352,986,317円	D 信託約款に定める分配準備積立 金 6,436,934,259円
E 分配対象収益 (A+B+C+D) 7,986,201,939円	E 分配対象収益 (A+B+C+D) 8,712,397,361円

F	分配対象収益(1万口当たり)	2,295円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,390円
G	分配金額	34,793,292円	G	分配金額	36,440,689円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2022年3月16日			自 2022年9月16日	
	至 2022年4月15日			至 2022年10月17日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	124,090,927円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	84,453,714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	1,636,119,127円	C	信託約款に定める収益調整金	2,289,299,364円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,322,498,029円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,429,611,633円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	8,082,708,083円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	8,803,364,711円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,321円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,404円
G	分配金額	34,821,928円	G	分配金額	36,617,407円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2022年4月16日			自 2022年10月18日	
	至 2022年5月16日			至 2022年11月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	19,528,155円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	39,788,352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	1,757,617,610円	C	信託約款に定める収益調整金	2,320,611,516円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,372,702,822円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,451,957,499円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	8,149,848,587円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	8,812,357,367円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,316円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,405円
G	分配金額	35,175,232円	G	分配金額	36,640,456円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円
	自 2022年5月17日			自 2022年11月16日	
	至 2022年6月15日			至 2022年12月15日	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	24,957,184円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益	27,142,772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	1,934,143,166円	C	信託約款に定める収益調整金	2,363,280,670円
D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,317,195,979円	D	信託約款に定める分配準備積立 金	6,422,190,753円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	8,276,296,329円	E	分配対象収益(A+B+C+D)	8,812,614,195円
F	分配対象収益(1万口当たり)	2,314円	F	分配対象収益(1万口当たり)	2,402円
G	分配金額	35,763,757円	G	分配金額	36,679,093円
H	分配金額(1万口当たり)	10円	H	分配金額(1万口当たり)	10円

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	前期 自 2021年12月16日 至 2022年6月15日	当期 自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資	同左

	<p>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。</p>	
金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	<p>前期 2022年 6月 15日現在</p>	<p>当期 2022年 12月 15日現在</p>
貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>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。</p>	同左
時価の算定方法	<p>(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。</p>	<p>(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</p>
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>	同左

(有価証券に関する注記)

前期 (2022年 6月 15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	△884,814,910
合計	△884,814,910

当期 (2022年 12月 15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	△27,145,297
合計	△27,145,297

(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)

	<p>前期 2022年 6月 15日現在</p>	<p>当期 2022年 12月 15日現在</p>
1口当たり純資産額	0.9906円	1.0208円
(1万口当たり純資産額)	(9,906円)	(10,208円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI (ヘッジなし) マザーファンド	1,441,704,173	6,199,760,455	
	日本債券インデックスマザーファンド	4,491,558,627	6,115,257,070	
	海外債券インデックス (ヘッジなし) マザーファンド	2,355,015,026	6,092,188,370	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	3,215,724,391	6,331,118,181	
	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	2,382,153,384	6,147,146,807	
	海外リートインデックス (ヘッジなし) マザーファンド	2,143,651,380	5,981,644,810	
合計		16,029,806,981	36,867,115,693	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(参考)

日本リートインデックス J-REIT マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2022年6月15日現在	2022年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	359,639,108	269,814,075
投資証券	56,994,452,900	59,014,113,500
未収入金	1,276,789,350	25,416,300
未収配当金	318,296,387	273,397,853
流動資産合計	58,949,177,745	59,582,741,728
資産合計	58,949,177,745	59,582,741,728
負債の部		
流動負債		
未払金	-	81,840,000
未払解約金	4,039,590	24,369
未払利息	156	440
流動負債合計	4,039,746	81,864,809
負債合計	4,039,746	81,864,809
純資産の部		
元本等		
元本	24,155,988,864	23,057,537,880
剰余金		
剰余金又は欠損金(△)	34,789,149,135	36,443,339,039
元本等合計	58,945,137,999	59,500,876,919
純資産合計	58,945,137,999	59,500,876,919
負債純資産合計	58,949,177,745	59,582,741,728

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2022年6月15日現在	2022年12月15日現在
1.	期首	2021年12月16日	2022年6月16日
	期首元本額	29,200,487,757円	24,155,988,864円
	期首からの追加設定元本額	449,236,375円	4,906,856,121円
	期首からの一部解約元本額	5,493,735,268円	6,005,307,105円
	元本の内訳 ※		
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,382,747,719円	2,382,153,384円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	1,379,342,070円	1,412,842,931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）	147,619,721円	146,673,427円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	19,994,005,194円	18,736,151,151円
	財産3分法（適格機関投資家専用）	252,274,160円	379,716,987円
計	24,155,988,864円	23,057,537,880円	
2.	受益権の総数	24,155,988,864口	23,057,537,880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12月16日 至 2022年6月15日	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。当該有価証券の性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリ	同左

	スク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	
--	-------------------------------	--

II 金融商品の時価等に関する事項

	2022年 6月 15日現在	2022年 12月 15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2022年 6月 15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	△7,924,209,227
合計	△7,924,209,227

(2022年 12月 15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1,816,082,327
合計	1,816,082,327

(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 6月 15日現在		2022年 12月 15日現在	
1口当たり純資産額	2.4402円	1口当たり純資産額	2.5805円
(1万口当たり純資産額)	(24,402円)	(1万口当たり純資産額)	(25,805円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	1,098	131,211,000	
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,730	159,333,000	
	S O S i L A物流リート投資法人 投資証券	2,686	378,726,000	
	東海道リート投資法人 投資証券	655	79,582,500	
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,864	1,150,088,000	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	6,349	1,029,172,900	
	産業ファンド投資法人 投資証券	8,069	1,274,902,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,399	1,854,556,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	3,960	837,144,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,851	1,198,845,500	
	G L P投資法人 投資証券	17,427	2,732,553,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,512	781,232,000	
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	9,100	3,021,200,000	
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	944	660,800,000	
	O n e リート投資法人 投資証券	942	238,231,800	
	イオンリート投資法人 投資証券	5,977	930,021,200	
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,052	868,438,800	
	日本リート投資法人 投資証券	1,754	646,349,000	
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	16,225	1,259,060,000	
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	1,198	159,933,000	
	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	2,347	608,811,800	
	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	1,331	239,313,800	
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,404	167,356,800	
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	17,461	2,928,209,700	
	いちごホテルリート投資法人 投資証券	894	96,909,600	
	ラサールロジポート投資法人 投資証券	6,610	1,086,023,000	
	スターアジア不動産投資法人 投資証券	6,742	370,135,800	
	マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	674	92,338,000	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,133	1,081,431,000	
	大江戸温泉リート投資法人 投資証券	872	56,592,800	
	投資法人みらい 投資証券	6,560	310,616,000	
	森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	1,267	171,171,700	
	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,855	812,490,000	

CRE ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,091	421,754,700	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	876	106,696,800	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	2,365	238,628,500	
アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	2,354	348,627,400	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	6,299	3,899,081,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	5,400	3,240,000,000	
日本都市ファンド投資法人 投資証券	27,243	2,890,482,300	
オリックス不動産投資法人 投資証券	10,758	2,046,171,600	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	3,693	1,425,498,000	
NTT都市開発リート投資法人 投資証券	5,190	739,056,000	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	3,620	779,748,000	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	3,973	429,084,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	12,078	1,831,024,800	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	3,859	563,028,100	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	23,765	1,242,909,500	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,003	1,047,569,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	3,690	576,378,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	3,641	1,181,504,500	
福岡リート投資法人 投資証券	2,793	484,585,500	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	3,142	1,033,718,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	4,424	382,676,000	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,129	731,592,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	2,439	376,093,800	
スターツプロシード投資法人 投資証券	936	215,467,200	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	8,139	2,429,491,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	17,412	1,385,995,200	
大和証券リビング投資法人 投資証券	7,482	878,386,800	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	4,953	676,084,500	
合計	321,689	59,014,113,500	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年6月15日現在	2022年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	444,676,322	261,040,279
コール・ローン	38,856,343	33,553,753
投資証券	53,475,567,885	54,145,705,588
派生商品評価勘定	49,833	-
未収入金	381,269,245	1,509,867
未収配当金	122,957,091	139,135,228
流動資産合計	54,463,376,719	54,580,944,715
資産合計	54,463,376,719	54,580,944,715
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	50,310	5,040
未払解約金	453,923	-
未払利息	16	54
流動負債合計	504,249	5,094
負債合計	504,249	5,094
純資産の部		
元本等		
元本	19,989,699,038	19,559,991,666
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	34,473,173,432	35,020,947,955
元本等合計	54,462,872,470	54,580,939,621
純資産合計	54,462,872,470	54,580,939,621
負債純資産合計	54,463,376,719	54,580,944,715

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2022 年 6 月 15 日現在	2022 年 12 月 15 日現在
1.	期首	2021 年 12 月 16 日	2022 年 6 月 16 日
	期首元本額	26,079,655,919 円	19,989,699,038 円
	期首からの追加設定元本額	1,611,278,058 円	3,169,382,941 円
	期首からの一部解約元本額	7,701,234,939 円	3,599,090,313 円
	元本の内訳 ※		
	世界の財産 3 分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,013,320,865 円	2,143,651,380 円
	インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）	10,492,459 円	7,439,594 円
	グローバル 3 倍 3 分法ファンド（適格機関投資家向け）	17,686,876,446 円	17,177,981,811 円
海外先進国 REIT インデックスファンド（適格機関投資家向け）	279,009,268 円	230,918,881 円	
計	19,989,699,038 円	19,559,991,666 円	
2.	受益権の総数	19,989,699,038 口	19,559,991,666 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 12 月 16 日 至 2022 年 6 月 15 日	自 2022 年 6 月 16 日 至 2022 年 12 月 15 日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主な	同左

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

II 金融商品の時価等に関する事項

	2022年6月15日現在	2022年12月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、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6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	△9,519,365,764
合計	△9,519,365,764

(2022年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	58,908,355
合計	58,908,355

(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6月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	602,170,680	—	602,171,157	△477
	米ドル	405,030,000	—	404,985,900	44,100
	加ドル	11,460,504	—	11,460,823	△319
	ユーロ	29,574,300	—	29,568,567	5,733
	英ポンド	27,564,276	—	27,573,439	△9,163
	豪ドル	28,845,500	—	28,858,520	△13,020
	香港ドル	8,596,000	—	8,599,650	△3,650
	シンガポールドル	91,100,100	—	91,124,258	△24,158
合計		602,170,680	—	602,171,157	△477

(2022年12月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	27,086,000	—	27,080,960	△5,040
	米ドル	27,086,000	—	27,080,960	△5,040
合計		27,086,000	—	27,080,960	△5,040

(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6月15日現在		2022年12月15日現在	
1口当たり純資産額	2.7245円	1口当たり純資産額	2.7904円

附属明細表

第 1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	29,203	437,752.97	
		AGREE REALTY CORPORATION	24,537	1,747,770.51	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	22,315	445,184.25	
		ALEXANDER'S INC	692	159,076.96	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	45,516	6,962,582.52	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	3,543	67,777.59	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	16,014	441,666.12	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	92,789	3,000,796.26	
		AMERICOLD REALTY TRUST INC	82,666	2,416,327.18	
		APARTMENT INCOME REIT CO	47,340	1,734,064.20	
		APARTMENT INVT&MGMT CO -A	47,061	378,370.44	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	65,130	1,084,414.50	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	20,486	246,856.30	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	9,695	54,195.05	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	42,908	7,383,608.64	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,014	23,656.62	
		BOSTON PROPERTIES INC	43,791	3,045,226.14	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	16,299	67,640.85	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	53,051	340,056.91	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	91,469	2,099,213.55	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	53,082	934,774.02	
		BRT APARTMENTS CORP	3,528	73,699.92	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	32,672	3,815,436.16	
		CARETRUST REIT INC	29,712	582,058.08	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,610	191,163.20	
		CENTERSPACE	4,851	314,829.90	
		CHATHAM LODGING TRUST	15,166	202,769.42	
CITY OFFICE REIT INC	11,825	109,381.25			

CLIPPER REALTY INC	4,887	34,257.87	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	7,098	251,056.26	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	34,604	910,777.28	
COUSINS PROPERTIES INC	46,379	1,201,679.89	
CTO REALTY GROWTH INC	4,497	84,093.90	
CUBESMART	68,739	2,896,661.46	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	64,338	579,042.00	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	99,300	59,580.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	88,140	9,222,969.60	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	70,382	53,258.05	
DOUGLAS EMMETT INC	54,172	889,504.24	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	68,595.90	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	28,282	423,947.18	
EASTGROUP PROPERTIES INC	13,340	2,081,306.80	
ELME COMMUNITIES	27,018	515,503.44	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	40,963	291,656.56	
EPR PROPERTIES	22,991	945,619.83	
EQUINIX INC	27,923	19,641,875.89	
EQUITY COMMONWEALTH	34,288	870,229.44	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	53,678	3,556,167.50	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	103,868	6,640,281.24	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	42,990	1,004,246.40	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	19,995	4,417,695.30	
EXTRA SPACE STORAGE INC	41,049	6,404,054.49	
FARMLAND PARTNERS INC	15,001	191,262.75	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	22,302	2,426,011.56	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	40,395	2,034,292.20	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	24,996	674,392.08	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	26,426	77,428.18	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	78,276	4,114,969.32	
GETTY REALTY CORPORATION	13,004	445,387.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	11,426	224,406.64	
GLADSTONE LAND CORP	9,463	184,149.98	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	18,078	181,864.68	
GLOBAL NET LEASE INC	31,742	433,278.30	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	117,036	2,275,179.84	

HEALTHPEAK PROPERTIES INC	165,638	4,222,112.62	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9,249	90,455.22	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	32,303	951,646.38	
HOST HOTELS & RESORTS INC	219,081	3,851,443.98	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	40,052	433,362.64	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	67,772	1,220,573.72	
INDUS REALTY TRUST INC	1,415	90,418.50	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	18,753	71,823.99	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	8,549	974,842.47	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	20,681	495,309.95	
INVITATION HOMES INC	177,823	5,692,114.23	
IRON MOUNTAIN INC	89,103	4,897,100.88	
ISTAR INC	26,464	202,978.88	
JBG SMITH PROPERTIES	30,805	612,711.45	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	229,200	118,038.00	
KILROY REALTY CORPORATION	32,292	1,320,419.88	
KIMCO REALTY CORP	189,298	4,166,448.98	
KITE REALTY GROUP TRUST	67,037	1,483,528.81	
LIFE STORAGE INC	25,833	2,734,939.71	
LTC PROPERTIES INC	12,467	476,114.73	
LXP INDUSTRIAL TRUST	85,659	918,264.48	
MACERICH CO/THE	65,798	818,527.12	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	563,347	197,171.45	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	183,734	2,179,085.24	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	35,396	5,821,226.16	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	54,308	2,505,228.04	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	26,082	992,680.92	
NATL HEALTH INVESTORS INC	13,765	766,710.50	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	40,067	264,041.53	
NETSTREIT CORP	14,899	289,040.60	
NEXPOINT RESIDENTIAL	7,122	325,831.50	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	15,179	221,309.82	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	71,876	2,116,029.44	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,571	109,566.87	
ORION OFFICE REIT INC	17,241	159,479.25	
PARAMOUNT GROUP INC	52,334	333,367.58	

PARK HOTELS & RESORTS INC	68,850	868,198.50	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	40,187	628,524.68	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	35,895	1,194,226.65	
PHYSICIANS REALTY TRUST	69,748	1,035,757.80	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	38,450	361,430.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	11,108	224,492.68	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	4,876	74,017.68	
PRIME US REIT	184,200	86,574.00	
PROLOGIS INC	283,025	34,410,179.50	
PUBLIC STORAGE	48,440	14,540,719.20	
REALTY INCOME CORP	189,399	12,246,539.34	
REGENCY CENTERS CORP	47,183	3,091,901.99	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	37,780	595,790.60	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	52,371	2,952,676.98	
RLJ LODGING TRUST	49,798	567,697.20	
RPT REALTY	26,298	289,015.02	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	16,870	1,493,669.80	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	71,039	909,299.20	
SAFEHOLD INC	7,360	210,937.60	
SAUL CENTERS INC	4,067	173,172.86	
SERVICE PROPERTIES TRUST	50,914	398,147.48	
SIMON PROPERTY GROUP INC	100,325	12,009,905.75	
SITE CENTERS CORP	56,875	772,931.25	
SL GREEN REALTY CORP	19,791	722,569.41	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	41,716	1,734,134.12	
STAG INDUSTRIAL INC	54,861	1,869,114.27	
STORE CAPITAL CORP	81,505	2,607,344.95	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	32,493	259,944.00	
SUN COMMUNITIES INC	37,827	5,495,128.29	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	64,847	664,033.28	
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS INC	31,945	605,357.75	
TERRENO REALTY CORP	20,306	1,189,728.54	
UDR INC	93,784	3,805,754.72	
UMH PROPERTIES INC	15,125	259,091.25	
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	4,045	208,438.85	
URBAN EDGE PROPERTIES	35,716	543,954.68	

		URSTADT BIDDLE PROPERTIES- CL A	9,416	175,137.60
		VENTAS INC	122,629	5,698,569.63
		VERIS RESIDENTIAL INC	24,649	402,271.68
		VICI PROPERTIES INC	295,153	10,091,281.07
		VORNADO REALTY TRUST	49,618	1,139,725.46
		WELLTOWER INC	142,137	9,572,926.95
		WHITESTONE REIT	15,080	146,879.20
		WP CAREY INC	63,700	5,124,665.00
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	34,970	522,451.80
米ドル小計			8,323,295	308,765,286.34 (41,831,520,993)
加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	19,596	527,916.24
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,827	156,154.56
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	6,820	76,315.80
		BOARDWALK EQUITIES INC	6,852	345,272.28
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	5,270	95,703.20
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	16,414	61,060.08
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	26,055	1,131,568.65
		CHOICE PROPERTIES REIT	49,732	747,969.28
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,426	265,115.64
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	16,589	257,958.95
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	37,697	456,133.70
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	6,850	106,654.50
		EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	19,525	61,308.50
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	32,780	563,160.40
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	9,749	738,389.26
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	39,498	494,119.98
		INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	6,035	25,286.65
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	21,436	275,666.96
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	17,060	284,731.40
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,668	82,696.12
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	5,526	88,194.96
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	9,412	93,178.80
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	35,379	348,836.94
		PRIMARIS REIT	15,226	224,888.02
		PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	9,850	59,789.50

		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	45,502	971,467.70	
		SLATE GROCERY REIT	8,061	128,169.90	
		SLATE OFFICE REIT	15,698	69,228.18	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	21,719	594,231.84	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	28,260	640,089.00	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	12,783	72,863.10	
加ドル小計			584,295	10,044,120.09 (1,004,813,773)	
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	12,266	978,826.80	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	2,768	21,202.88	
		ALTAREA	1,445	192,763.00	
		CARE PROPERTY INVEST	9,252	141,555.60	
		CARMILA	17,654	243,625.20	
		COFINIMMO	9,263	802,638.95	
		COVIVIO	14,173	822,742.65	
		CROMWELL REIT EUR	115,360	179,961.60	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	12,808	291,510.08	
		GECINA SA	16,686	1,636,896.60	
		HAMBORNER REIT AG	23,410	166,913.30	
		ICADE	10,032	414,722.88	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	15,466	49,800.52	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	92,136	576,771.36	
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	7,356	145,501.68	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	147,807	158,153.49	
		KLEPIERRE	59,683	1,343,464.33	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	18,057	77,554.81	
		MERCIALYS	22,897	225,993.39	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	102,833	954,290.24	
		MONTEA	3,677	244,152.80	
		NSI NV	5,548	128,713.60	
		RETAIL ESTATES	3,568	219,432.00	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	32,730	1,737,635.70	
		VASTNED RETAIL	5,181	109,837.20	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	43,323	1,213,910.46	
		WERELDHAVE NV	12,657	161,123.61	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	6,270	179,949.00	

ユーロ小計			824,306	13,419,643.73 (1,941,956,644)
英債券	投資証券	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	120,064	70,477.56
		AEW UK REIT PLC	55,637	55,358.81
		ASSURA PLC	911,640	515,076.60
		BALANCED COMM PROPERTY TRUST	246,094	239,695.55
		BIG YELLOW GROUP PLC	53,245	614,447.30
		BRITISH LAND COMPANY PLC	287,284	1,150,285.13
		CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	266,969	282,720.17
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	204,828	122,691.97
		CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	138,091	125,662.81
		DERWENT LONDON PLC	34,411	827,240.44
		EDISTON PROPERTY INVESTMENT	77,511	46,506.60
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	187,911	157,657.32
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	78,133	399,259.63
		HAMMERSON PLC	1,057,996	256,881.42
		HOME REIT PLC	256,438	97,190.00
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	131,826	138,944.60
		INTU PROPERTIES PLC	758,746	—
		LAND SECURITIES GROUP PLC	230,198	1,463,138.48
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	298,785	544,386.27
		LXI REIT PLC	526,409	614,845.71
		NEWRIVER REIT PLC	92,155	73,724.00
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	165,236	135,989.22
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	409,433	463,478.15
		PRS REIT PLC/THE	177,270	150,679.50
		REGIONAL REIT LTD	146,079	86,624.84
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	64,040	607,419.40
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	181,830	82,823.56
		SEGRO PLC	370,007	3,048,857.68
		SHAFTESBURY PLC	89,771	326,048.27
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	381,480	402,461.40
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	107,950	71,786.75		
TRITAX BIG BOX REIT PLC	569,232	864,094.17		
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	255,547	154,861.48		
UNITE GROUP PLC	122,311	1,152,169.62		

		URBAN LOGISTICS REIT PLC	144,073	202,422.56	
		WAREHOUSE REIT PLC	132,647	148,564.64	
		WORKSPACE GROUP PLC	42,515	184,004.92	
英債券小計			9,373,792	15,878,476.53 (2,672,665,169)	
豪ドル	投資証券	ABACUS PROPERTY GROUP	127,845	356,687.55	
		ARENA REIT	109,002	422,927.76	
		BWP TRUST	153,235	631,328.20	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	214,454	386,017.20	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	167,463	547,604.01	
		CENTURIA OFFICE REIT	144,283	235,181.29	
		CHARTER HALL GROUP	144,998	1,899,473.80	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	202,523	917,429.19	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	160,993	650,411.72	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	103,835	350,962.30	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	454,974	311,657.19	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	61,888	188,758.40	
		DEXUS/AU	332,203	2,724,064.60	
		GDI PROPERTY GROUP	157,640	121,382.80	
		GOODMAN GROUP	521,565	9,701,109.00	
		GPT GROUP	590,224	2,596,985.60	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	91,178	296,328.50	
		HEALTHCO REIT	75,774	124,648.23	
		HMC CAPITAL LTD	58,502	269,109.20	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	486,401	639,617.31	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	57,168	203,518.08	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	115,251	505,951.89	
		MIRVAC GROUP	1,215,333	2,698,039.26	
		NATIONAL STORAGE REIT	331,357	788,629.66	
		RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	132,547	97,422.04	
		REGION RE LTD	346,642	974,064.02	
RURAL FUNDS GROUP	123,608	306,547.84			
SCENTRE GROUP	1,597,224	4,727,783.04			
STOCKLAND	734,879	2,866,028.10			
VICINITY CENTRES	1,191,859	2,383,718.00			
WAYPOINT REIT	225,263	632,989.03			

豪ドル小計			10,430,111	39,556,374.81 (3,680,720,676)
ニュージーランドドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	413,811	835,898.22
		STRIDE PROPERTY GROUP	292,246	417,911.78
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	214,774	493,980.20
ニュージーランドドル小計			920,831	1,747,790.20 (153,088,943)
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	608,000	1,830,080.00
		FORTUNE REIT	456,900	2,750,538.00
		LINK REIT	647,000	36,814,300.00
		PROSPERITY REIT	360,000	684,000.00
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	330,000	1,065,900.00
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	718,110	1,457,763.30
香港ドル小計			3,120,010	44,602,581.30 (776,976,966)
シンガポールドル	投資証券	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	156,325	190,716.50
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,032,032	2,869,048.96
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	618,892	625,080.92
		CAPITALAND CHINA TRUST	371,285	434,403.45
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,546,692	3,170,718.60
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	262,200	327,750.00
		DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	153,000	96,390.00
		EC WORLD REIT	82,900	38,548.50
		ESR-LOGOS REIT	1,743,518	653,819.25
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	318,000	200,340.00
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	365,940	93,314.70
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	333,705	690,769.35
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	881,260	1,022,261.60
		KEPPEL DC REIT	407,477	749,757.68
		KEPPEL REIT	623,800	561,420.00
		LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	591,252	419,788.92
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	612,608	1,378,368.00
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	986,087	1,597,460.94
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	709,131	1,198,431.39
		QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	804,235	277,461.07
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	122,100	457,875.00		

		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	169,400	127,897.00	
		SPH REIT	340,500	304,747.50	
		STARHILL GLOBAL REIT	437,000	235,980.00	
		SUNTEC REIT	694,000	964,660.00	
シンガポールドル小計			14,363,339	18,687,009.33 (1,879,539,398)	
韓国ウォン	投資証券	D&D PLATFORM REIT CO LTD	21,452	74,545,700.00	
		E KOCREF CR-REIT CO LTD	8,770	47,007,200.00	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	53,101	213,997,030.00	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,591	52,623,140.00	
		JR REIT XXVII	49,792	218,586,880.00	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	13,627	67,998,730.00	
		LOTTE REIT CO LTD	39,257	163,505,405.00	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	8,226	34,466,940.00	
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,699	41,779,710.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,984	132,693,760.00	
		SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	9,014	34,794,040.00	
		SK REITS CO LTD	27,123	140,768,370.00	
韓国ウォン小計			274,636	1,222,766,905.00 (127,901,418)	
イスラエルシェケル	投資証券	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	231,039	389,069.67	
		REIT 1 LTD	56,915	1,011,379.55	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	63,417	523,190.25	
イスラエルシェケル小計			351,371	1,923,639.47 (76,521,608)	
合計				54,145,705,588 (54,145,705,588)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 145 銘柄	100.0%	77.3%
加ドル	投資証券 31 銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 28 銘柄	100.0%	3.6%
英ポンド	投資証券 37 銘柄	100.0%	4.9%

豪ドル	投資証券	31 銘柄	100.0%	6.8%
ニュージーランドドル	投資証券	3 銘柄	100.0%	0.3%
香港ドル	投資証券	6 銘柄	100.0%	1.4%
シンガポールドル	投資証券	25 銘柄	100.0%	3.5%
韓国ウォン	投資証券	12 銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券	3 銘柄	100.0%	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2022年6月15日現在	2022年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	130,304,779	102,398,818
国債証券	38,633,394,520	40,988,778,100
地方債証券	4,580,457,895	3,452,622,710
特殊債券	3,641,133,000	3,524,854,000
社債券	705,950,000	301,100,000
未収利息	127,491,713	129,093,851
前払費用	2,872,254	1,656,426
流動資産合計	47,821,604,161	48,500,503,905
資産合計	47,821,604,161	48,500,503,905
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,796,357	17,753,784
未払利息	56	167
流動負債合計	12,796,413	17,753,951
負債合計	12,796,413	17,753,951
純資産の部		
元本等		
元本	34,912,052,752	35,610,435,312
剰余金		
剰余金又は欠損金(△)	12,896,754,996	12,872,314,642
元本等合計	47,808,807,748	48,482,749,954
純資産合計	47,808,807,748	48,482,749,954
負債純資産合計	47,821,604,161	48,500,503,905

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6月15日現在	2022年12月15日現在
1.	期首	2021年12月16日	2022年6月16日
	期首元本額	34,511,107,270円	34,912,052,752円
	期首からの追加設定元本額	2,397,099,489円	2,127,168,657円
	期首からの一部解約元本額	1,996,154,007円	1,428,786,097円
	元本の内訳 ※		
	DCインデックスバランス（株式20）	4,574,153,668円	4,921,236,138円
	DCインデックスバランス（株式40）	4,092,233,547円	4,569,564,215円
	DCインデックスバランス（株式60）	3,029,017,619円	3,421,641,846円
	DCインデックスバランス（株式80）	491,586,018円	567,244,180円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	2,196,744,337円	2,204,984,670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	4,389,817,324円	4,491,558,627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）	1,670,587,208円	1,672,224,901円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	5,227,949円	—円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	29,858,408円	—円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	99,177,989円	—円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	247,230,346円	—円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	3,596,938,679円	3,370,522,718円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,479,202,447円	1,487,476,623円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,429,643,138円	1,442,524,040円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	804,871,283円	820,184,428円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	118,811,725円	122,162,555円	
インデックスファンド日本債券（1年決算型）	6,304,150,448円	6,136,780,166円	
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	352,800,619円	382,330,205円	
計	34,912,052,752円	35,610,435,312円	
2.	受益権の総数	34,912,052,752口	35,610,435,312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 12 月 16 日 至 2022 年 6 月 15 日	自 2022 年 6 月 16 日 至 2022 年 12 月 15 日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	2022 年 6 月 15 日現在	2022 年 12 月 15 日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等による場合、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 6 月 15 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△1,600,794,050
地方債証券	△19,328,105
特殊債券	△19,888,000
社債券	△2,819,000
合計	△1,642,829,155

(2022年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	218,936,230
地方債証券	△3,531,940
特殊債券	△3,765,000
社債券	△233,000
合計	211,406,290

(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6月15日現在		2022年12月15日現在	
1口当たり純資産額	1.3694円	1口当たり純資産額	1.3615円
(1万口当たり純資産額)	(13,694円)	(1万口当たり純資産額)	(13,615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153回利付国債(5年)	300,000,000	298,719,000	
	第1回利付国債(40年)	70,000,000	86,448,600	
	第2回利付国債(40年)	125,000,000	148,768,750	
	第3回利付国債(40年)	85,000,000	101,623,450	
	第4回利付国債(40年)	95,000,000	112,669,050	
	第5回利付国債(40年)	75,000,000	85,673,250	
	第6回利付国債(40年)	110,000,000	122,864,500	
	第7回利付国債(40年)	80,000,000	85,496,800	
	第8回利付国債(40年)	95,000,000	94,266,600	
	第9回利付国債(40年)	130,000,000	94,597,100	
	第10回利付国債(40年)	125,000,000	107,058,750	
	第11回利付国債(40年)	140,000,000	115,533,600	
	第12回利付国債(40年)	175,000,000	128,905,000	
	第13回利付国債(40年)	180,000,000	131,630,400	

第14回利付国債（40年）	150,000,000	117,405,000	
第15回利付国債（40年）	140,000,000	119,600,600	
第333回利付国債（10年）	210,000,000	211,730,400	
第334回利付国債（10年）	120,000,000	121,159,200	
第335回利付国債（10年）	490,000,000	494,576,600	
第336回利付国債（10年）	180,000,000	181,882,800	
第337回利付国債（10年）	230,000,000	231,478,900	
第338回利付国債（10年）	390,000,000	393,654,300	
第339回利付国債（10年）	570,000,000	575,933,700	
第340回利付国債（10年）	620,000,000	627,018,400	
第341回利付国債（10年）	700,000,000	706,426,000	
第342回利付国債（10年）	530,000,000	531,637,700	
第343回利付国債（10年）	545,000,000	546,526,000	
第344回利付国債（10年）	700,000,000	701,575,000	
第345回利付国債（10年）	660,000,000	661,056,000	
第346回利付国債（10年）	690,000,000	690,579,600	
第347回利付国債（10年）	680,000,000	680,000,000	
第348回利付国債（10年）	500,000,000	499,525,000	
第349回利付国債（10年）	640,000,000	638,720,000	
第350回利付国債（10年）	640,000,000	638,329,600	
第351回利付国債（10年）	535,000,000	533,245,200	
第352回利付国債（10年）	590,000,000	587,811,100	
第353回利付国債（10年）	400,000,000	398,212,000	
第354回利付国債（10年）	325,000,000	323,290,500	
第355回利付国債（10年）	350,000,000	347,861,500	
第356回利付国債（10年）	350,000,000	347,431,000	
第357回利付国債（10年）	560,000,000	555,357,600	
第358回利付国債（10年）	600,000,000	594,432,000	
第359回利付国債（10年）	420,000,000	415,354,800	
第360回利付国債（10年）	580,000,000	572,500,600	
第361回利付国債（10年）	270,000,000	266,087,700	
第362回利付国債（10年）	400,000,000	393,712,000	
第363回利付国債（10年）	300,000,000	295,020,000	
第364回利付国債（10年）	300,000,000	294,876,000	
第365回利付国債（10年）	300,000,000	294,993,000	
第366回利付国債（10年）	400,000,000	400,544,000	

第367回利付国債（10年）	350,000,000	348,859,000	
第368回利付国債（10年）	350,000,000	348,330,500	
第1回利付国債（30年）	50,000,000	58,692,000	
第3回利付国債（30年）	70,000,000	80,577,000	
第5回利付国債（30年）	80,000,000	92,680,000	
第6回利付国債（30年）	50,000,000	59,259,000	
第8回利付国債（30年）	80,000,000	91,267,200	
第14回利付国債（30年）	108,000,000	130,495,320	
第15回利付国債（30年）	147,000,000	179,484,060	
第16回利付国債（30年）	35,000,000	42,799,400	
第17回利付国債（30年）	50,000,000	60,660,500	
第18回利付国債（30年）	110,000,000	132,333,300	
第19回利付国債（30年）	40,000,000	48,136,400	
第20回利付国債（30年）	40,000,000	49,154,400	
第21回利付国債（30年）	70,000,000	84,361,200	
第22回利付国債（30年）	70,000,000	86,174,200	
第23回利付国債（30年）	55,000,000	67,804,550	
第24回利付国債（30年）	68,000,000	83,943,280	
第25回利付国債（30年）	60,000,000	72,480,000	
第26回利付国債（30年）	170,000,000	207,733,200	
第27回利付国債（30年）	89,000,000	110,064,520	
第28回利付国債（30年）	144,000,000	178,133,760	
第29回利付国債（30年）	176,000,000	215,263,840	
第30回利付国債（30年）	147,000,000	177,571,590	
第31回利付国債（30年）	120,000,000	143,032,800	
第32回利付国債（30年）	160,000,000	193,171,200	
第33回利付国債（30年）	135,000,000	156,541,950	
第34回利付国債（30年）	180,000,000	214,506,000	
第35回利付国債（30年）	128,000,000	148,337,920	
第36回利付国債（30年）	135,000,000	156,546,000	
第37回利付国債（30年）	161,000,000	183,696,170	
第38回利付国債（30年）	135,000,000	151,659,000	
第39回利付国債（30年）	115,000,000	131,273,650	
第40回利付国債（30年）	130,000,000	145,996,500	
第41回利付国債（30年）	160,000,000	176,684,800	
第42回利付国債（30年）	135,000,000	148,954,950	

第43回利付国債（30年）	155,000,000	170,878,200	
第44回利付国債（30年）	150,000,000	165,222,000	
第45回利付国債（30年）	120,000,000	127,488,000	
第46回利付国債（30年）	120,000,000	127,329,600	
第47回利付国債（30年）	125,000,000	134,936,250	
第48回利付国債（30年）	85,000,000	88,275,900	
第49回利付国債（30年）	140,000,000	145,178,600	
第50回利付国債（30年）	95,000,000	86,827,150	
第51回利付国債（30年）	90,000,000	72,874,800	
第52回利付国債（30年）	130,000,000	110,120,400	
第53回利付国債（30年）	105,000,000	90,801,900	
第54回利付国債（30年）	110,000,000	99,398,200	
第55回利付国債（30年）	110,000,000	99,132,000	
第56回利付国債（30年）	90,000,000	80,813,700	
第57回利付国債（30年）	100,000,000	89,548,000	
第58回利付国債（30年）	100,000,000	89,220,000	
第59回利付国債（30年）	170,000,000	147,492,000	
第60回利付国債（30年）	120,000,000	108,949,200	
第61回利付国債（30年）	100,000,000	86,159,000	
第62回利付国債（30年）	120,000,000	97,761,600	
第63回利付国債（30年）	90,000,000	71,019,900	
第64回利付国債（30年）	100,000,000	78,619,000	
第65回利付国債（30年）	110,000,000	86,740,500	
第66回利付国債（30年）	180,000,000	141,692,400	
第67回利付国債（30年）	110,000,000	90,456,300	
第68回利付国債（30年）	140,000,000	114,629,200	
第69回利付国債（30年）	110,000,000	92,369,200	
第70回利付国債（30年）	110,000,000	92,078,800	
第71回利付国債（30年）	120,000,000	100,227,600	
第72回利付国債（30年）	160,000,000	133,342,400	
第73回利付国債（30年）	120,000,000	99,886,800	
第74回利付国債（30年）	130,000,000	117,379,600	
第75回利付国債（30年）	90,000,000	88,028,100	
第76回利付国債（30年）	120,000,000	119,622,000	
第65回利付国債（20年）	100,000,000	102,008,000	
第66回利付国債（20年）	34,000,000	34,648,380	

第67回利付国債（20年）	34,000,000	34,836,400	
第68回利付国債（20年）	78,000,000	80,212,860	
第70回利付国債（20年）	104,000,000	107,832,400	
第72回利付国債（20年）	112,000,000	116,204,480	
第73回利付国債（20年）	113,000,000	117,591,190	
第74回利付国債（20年）	118,000,000	123,031,520	
第75回利付国債（20年）	10,000,000	10,477,600	
第76回利付国債（20年）	21,000,000	21,908,040	
第77回利付国債（20年）	40,000,000	41,820,000	
第79回利付国債（20年）	160,000,000	168,092,800	
第82回利付国債（20年）	60,000,000	63,496,800	
第87回利付国債（20年）	130,000,000	139,293,700	
第88回利付国債（20年）	300,000,000	323,988,000	
第90回利付国債（20年）	16,000,000	17,297,920	
第91回利付国債（20年）	250,000,000	271,220,000	
第92回利付国債（20年）	60,000,000	64,897,200	
第93回利付国債（20年）	60,000,000	64,901,400	
第94回利付国債（20年）	50,000,000	54,297,000	
第95回利付国債（20年）	82,000,000	90,118,820	
第96回利付国債（20年）	248,000,000	270,327,440	
第97回利付国債（20年）	45,000,000	49,431,150	
第98回利付国債（20年）	94,000,000	102,811,560	
第99回利付国債（20年）	117,000,000	128,442,600	
第100回利付国債（20年）	30,000,000	33,216,600	
第101回利付国債（20年）	66,000,000	73,765,560	
第102回利付国債（20年）	81,000,000	90,958,140	
第103回利付国債（20年）	11,000,000	12,292,280	
第104回利付国債（20年）	33,000,000	36,516,150	
第105回利付国債（20年）	77,000,000	85,552,390	
第106回利付国債（20年）	2,000,000	2,233,560	
第107回利付国債（20年）	130,000,000	144,970,800	
第108回利付国債（20年）	134,000,000	147,836,840	
第109回利付国債（20年）	27,000,000	29,882,790	
第110回利付国債（20年）	98,000,000	109,676,700	
第111回利付国債（20年）	25,000,000	28,240,000	
第112回利付国債（20年）	80,000,000	89,853,600	

第1 1 3 回利付国債（20年）	290,000,000	326,757,500	
第1 1 4 回利付国債（20年）	52,000,000	58,790,160	
第1 1 5 回利付国債（20年）	125,000,000	142,186,250	
第1 1 6 回利付国債（20年）	135,000,000	154,148,400	
第1 1 7 回利付国債（20年）	343,000,000	389,202,100	
第1 1 8 回利付国債（20年）	10,000,000	11,302,400	
第1 1 9 回利付国債（20年）	30,000,000	33,464,400	
第1 2 0 回利付国債（20年）	170,000,000	187,122,400	
第1 2 1 回利付国債（20年）	22,000,000	24,754,400	
第1 2 2 回利付国債（20年）	17,000,000	18,999,030	
第1 2 3 回利付国債（20年）	195,000,000	222,980,550	
第1 2 4 回利付国債（20年）	90,000,000	102,208,500	
第1 2 5 回利付国債（20年）	50,000,000	57,771,000	
第1 2 6 回利付国債（20年）	105,000,000	119,623,350	
第1 2 7 回利付国債（20年）	50,000,000	56,560,000	
第1 2 8 回利付国債（20年）	65,000,000	73,751,600	
第1 2 9 回利付国債（20年）	85,000,000	95,738,050	
第1 3 0 回利付国債（20年）	150,000,000	169,425,000	
第1 3 1 回利付国債（20年）	92,000,000	103,127,400	
第1 3 2 回利付国債（20年）	135,000,000	151,848,000	
第1 3 3 回利付国債（20年）	30,000,000	34,007,700	
第1 3 4 回利付国債（20年）	120,000,000	136,396,800	
第1 3 5 回利付国債（20年）	30,000,000	33,828,600	
第1 3 6 回利付国債（20年）	220,000,000	246,092,000	
第1 3 7 回利付国債（20年）	200,000,000	225,888,000	
第1 3 8 回利付国債（20年）	120,000,000	133,312,800	
第1 3 9 回利付国債（20年）	230,000,000	257,643,700	
第1 4 0 回利付国債（20年）	358,000,000	404,765,540	
第1 4 1 回利付国債（20年）	195,000,000	220,566,450	
第1 4 2 回利付国債（20年）	125,000,000	142,598,750	
第1 4 3 回利付国債（20年）	94,000,000	105,374,000	
第1 4 4 回利付国債（20年）	370,000,000	411,114,400	
第1 4 5 回利付国債（20年）	315,000,000	356,479,200	
第1 4 6 回利付国債（20年）	135,000,000	152,791,650	
第1 4 7 回利付国債（20年）	98,000,000	109,880,540	
第1 4 8 回利付国債（20年）	90,000,000	99,910,800	

第149回利付国債（20年）	115,000,000	127,584,450	
第150回利付国債（20年）	140,000,000	153,654,200	
第151回利付国債（20年）	140,000,000	150,336,200	
第152回利付国債（20年）	300,000,000	321,837,000	
第153回利付国債（20年）	270,000,000	292,501,800	
第154回利付国債（20年）	160,000,000	171,176,000	
第155回利付国債（20年）	270,000,000	281,672,100	
第156回利付国債（20年）	160,000,000	154,457,600	
第157回利付国債（20年）	150,000,000	140,482,500	
第158回利付国債（20年）	170,000,000	165,316,500	
第159回利付国債（20年）	150,000,000	147,333,000	
第160回利付国債（20年）	140,000,000	139,008,800	
第161回利付国債（20年）	120,000,000	117,183,600	
第162回利付国債（20年）	150,000,000	145,942,500	
第163回利付国債（20年）	165,000,000	159,932,850	
第164回利付国債（20年）	255,000,000	242,617,200	
第165回利付国債（20年）	170,000,000	161,183,800	
第166回利付国債（20年）	150,000,000	146,059,500	
第167回利付国債（20年）	160,000,000	150,516,800	
第168回利付国債（20年）	100,000,000	92,189,000	
第169回利付国債（20年）	160,000,000	144,435,200	
第170回利付国債（20年）	140,000,000	125,840,400	
第171回利付国債（20年）	170,000,000	152,146,600	
第172回利付国債（20年）	230,000,000	208,614,600	
第173回利付国債（20年）	150,000,000	135,579,000	
第174回利付国債（20年）	200,000,000	180,000,000	
第175回利付国債（20年）	140,000,000	127,852,200	
第176回利付国債（20年）	160,000,000	145,624,000	
第177回利付国債（20年）	150,000,000	133,647,000	
第178回利付国債（20年）	120,000,000	108,548,400	
第179回利付国債（20年）	190,000,000	171,400,900	
第180回利付国債（20年）	190,000,000	180,798,300	
第181回利付国債（20年）	190,000,000	183,895,300	
第182回利付国債（20年）	170,000,000	169,860,600	
国債証券 合計	40,144,000,000	40,988,778,100	
地方債証券	第4回東京都公募公債（東京グリーンbond（5	100,000,000	99,738,000

	年))			
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,267,000	
	第32回東京都公募公債(5年)	300,000,000	299,313,000	
	第726回東京都公募公債	100,000,000	100,695,000	
	第730回東京都公募公債	100,000,000	100,757,000	
	第739回東京都公募公債	100,000,000	100,372,000	
	第744回東京都公募公債	100,000,000	101,180,000	
	令和2年度第2回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,753,000	
	令和3年度第6回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,441,000	
	第214回神奈川県公募公債	100,000,000	101,145,000	
	平成25年度第10回静岡県公募公債	100,000,000	100,769,000	
	平成27年度第10回静岡県公募公債	200,000,000	201,904,000	
	平成26年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	100,855,000	
	平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	104,547,000	
	平成26年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	100,712,000	
	平成26年度第1回岐阜県公募公債(10年)	100,000,000	100,822,000	
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,839,000	
	第140回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,787,000	
	第142回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,010,000	
	第144回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,827,000	
	第147回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,113,000	
	第165回共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,676,000	
	平成28年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	99,773,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	101,062,000	
	平成29年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	99,662,000	
	平成27年度第2回熊本県公募公債(10年)	100,000,000	101,034,000	
	第2回名古屋市定時償還公募公債(10年)	30,000,000	30,040,710	
	平成27年度第5回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	100,977,000	
	令和元年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	99,825,000	
	令和2年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	99,727,000	
地方債証券 合計		3,430,000,000	3,452,622,710	
特殊債券	第5回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	99,893,000	
	第13回新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	201,128,000	
	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,692,000	
	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	199,178,000	

	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,380,000	
	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	108,911,000	
	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	110,067,000	
	第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,752,000	
	第125回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,440,000	
	第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,647,000	
	第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,679,000	
	第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,675,000	
	第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,926,000	
	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	100,892,000	
	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	99,747,000	
	第324回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,854,000	
	第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,457,000	
	第69回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,516,000	
	第77回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,879,000	
	第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,384,000	
	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,776,000	
	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	199,640,000	
	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	99,368,000	
	第39回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	100,866,000	
	第357回信金中金債（5年）	100,000,000	99,797,000	
	第363回信金中金債（5年）	100,000,000	99,670,000	
	第29回国際協力機構債券	100,000,000	101,106,000	
	第37回国際協力機構債券	100,000,000	99,534,000	
	特殊債券 合計	3,500,000,000	3,524,854,000	
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・債務返済機構重畳の債務引受条項付）	100,000,000	100,640,000	
	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	100,550,000	
	第26回KDDI株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,910,000	
	社債券 合計	300,000,000	301,100,000	
	合計	47,374,000,000	48,267,354,810	

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6月15日現在	2022年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	119,020,128	125,912,949
コール・ローン	116,550,628	55,075,932
国債証券	149,301,537,049	148,467,081,975
派生商品評価勘定	-	41,100
未収利息	871,478,328	864,221,648
前払費用	30,671,789	48,155,622
流動資産合計	150,439,257,922	149,560,489,226
資産合計	150,439,257,922	149,560,489,226
負債の部		
流動負債		
未払解約金	90,395,334	65,651,019
未払利息	50	89
流動負債合計	90,395,384	65,651,108
負債合計	90,395,384	65,651,108
純資産の部		
元本等		
元本	59,214,530,778	57,789,894,452
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	91,134,331,760	91,704,943,666
元本等合計	150,348,862,538	149,494,838,118
純資産合計	150,348,862,538	149,494,838,118
負債純資産合計	150,439,257,922	149,560,489,226

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 6 月 15 日現在	2022 年 12 月 15 日現在
1.	期首	2021 年 12 月 16 日	2022 年 6 月 16 日
	期首元本額	61,191,933,864 円	59,214,530,778 円
	期首からの追加設定元本額	1,469,666,301 円	2,103,900,729 円
	期首からの一部解約元本額	3,447,069,387 円	3,528,537,055 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）	15,750,883,415 円	17,218,206,949 円
	DC インデックスバランス（株式 20）	375,522,121 円	397,085,254 円
	DC インデックスバランス（株式 40）	490,755,336 円	529,171,824 円
	DC インデックスバランス（株式 60）	655,897,983 円	716,103,266 円
	DC インデックスバランス（株式 80）	530,976,469 円	594,831,050 円
	財産 3 分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	17,835,725,517 円	16,784,643,957 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	2,329,691,662 円	2,355,015,026 円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	13,511,673,535 円	13,054,433,780 円
	財産 3 分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	824,400,230 円	840,710,667 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）	148,762,525 円	145,733,134 円
	財産 3 分法（適格機関投資家専用）	152,358,277 円	224,166,809 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 80）	2,813,548 円	— 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 60）	3,191,447 円	— 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 40）	5,832,584 円	— 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 20）	10,157,016 円	— 円
	世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	1,714,862,926 円	172,500,884 円
	国際分散型ファンド 40（適格機関投資家向け）	645,345,736 円	585,220,546 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 20）	61,395,257 円	59,962,366 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 40）	85,866,838 円	83,870,029 円

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式60)	86,968,061 円	85,847,452 円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式80)	64,029,067 円	63,920,343 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	3,638,679,580 円	3,578,960,141 円
海外債券インデックスファンド (個人型年金向け)	288,741,648 円	299,510,975 円
計	59,214,530,778 円	57,789,894,452 円
2. 受益権の総数	59,214,530,778 口	57,789,894,452 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12月16日 至 2022年6月15日	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	2022年6月15日現在	2022年12月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)
(2022年6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△23,227,502,456
合計	△23,227,502,456

(2022年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	4,644,430,994
合計	4,644,430,994

(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6月15日現在)

該当事項はありません。

(2022年12月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	20,739,000	—	20,697,900	41,100
	メキシコペソ	20,739,000	—	20,697,900	41,100
合計		20,739,000	—	20,697,900	41,100

(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6月15日現在		2022年12月15日現在	
1口当たり純資産額	2,5391円	1口当たり純資産額	2,5869円
(1万口当たり純資産額)	(25,391円)	(1万口当たり純資産額)	(25,869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%-23/11/30	2,680,000.00	2,616,890.77	
		US TREASURY N/B-2.875%-23/11/30	1,810,000.00	1,780,599.69	
		US TREASURY N/B-0.5%-23/11/30	4,000,000.00	3,845,023.68	
		US TREASURY N/B-0.125%-23/12/15	3,000,000.00	2,869,124.52	
		US TREASURY N/B-2.25%-23/12/31	2,000,000.00	1,951,739.56	
		US TREASURY N/B-2.625%-23/12/31	2,470,000.00	2,419,082.25	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/01/31	2,000,000.00	1,948,437.50	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/01/31	2,520,000.00	2,461,921.86	
		US TREASURY N/B-2.75%-24/02/15	3,300,000.00	3,229,746.10	
		US TREASURY N/B-0.125%-24/02/15	5,000,000.00	4,747,656.25	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/02/29	1,500,000.00	1,456,523.43	
		US TREASURY N/B-2.375%-24/02/29	1,630,000.00	1,588,040.23	
		US TREASURY N/B-0.25%-24/03/15	5,000,000.00	4,738,671.90	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/03/31	3,860,000.00	3,741,938.27	
		US TREASURY N/B-2.0%-24/04/30	2,000,000.00	1,931,875.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-24/04/30	3,000,000.00	2,907,421.86	
		US TREASURY N/B-2.5%-24/05/15	3,380,000.00	3,285,861.72	
		US TREASURY N/B-0.25%-24/05/15	2,830,000.00	2,664,511.33	
		US TREASURY N/B-2.0%-24/05/31	3,870,000.00	3,732,887.09	
		US TREASURY N/B-0.25%-24/06/15	4,700,000.00	4,412,859.37	
		US TREASURY N/B-2.0%-24/06/30	2,300,000.00	2,215,816.41	
		US TREASURY N/B-1.75%-24/06/30	2,660,000.00	2,552,664.85	
		US TREASURY N/B-2.125%-24/07/31	2,490,000.00	2,399,445.69	
		US TREASURY N/B-1.75%-24/07/31	4,640,000.00	4,444,431.23	
US TREASURY N/B-2.375%-24/08/15	4,620,000.00	4,467,864.83			
US TREASURY N/B-0.375%-24/08/15	5,000,000.00	4,677,734.40			

US TREASURY N/B-1.875%-24/08/31	1,420,000.00	1,360,981.25	
US TREASURY N/B-1.25%-24/08/31	2,300,000.00	2,182,035.16	
US TREASURY N/B-0.375%-24/09/15	6,000,000.00	5,600,859.36	
US TREASURY N/B-2.125%-24/09/30	2,015,000.00	1,938,650.40	
US TREASURY N/B-1.5%-24/09/30	2,200,000.00	2,094,210.93	
US TREASURY N/B-2.25%-24/10/31	5,190,000.00	5,000,037.89	
US TREASURY N/B-1.5%-24/10/31	2,140,000.00	2,033,334.37	
US TREASURY N/B-2.25%-24/11/15	4,650,000.00	4,478,894.50	
US TREASURY N/B-2.125%-24/11/30	1,400,000.00	1,344,875.00	
US TREASURY N/B-1.5%-24/11/30	3,470,000.00	3,292,026.96	
US TREASURY N/B-1.0%-24/12/15	1,800,000.00	1,689,257.80	
US TREASURY N/B-2.25%-24/12/31	1,900,000.00	1,827,265.62	
US TREASURY N/B-1.75%-24/12/31	1,300,000.00	1,238,199.22	
US TREASURY N/B-2.5%-25/01/31	1,500,000.00	1,448,203.12	
US TREASURY N/B-1.375%-25/01/31	3,510,000.00	3,310,094.54	
US TREASURY N/B-2.0%-25/02/15	4,530,000.00	4,324,911.31	
US TREASURY N/B-2.75%-25/02/28	2,060,000.00	1,999,004.67	
US TREASURY N/B-1.125%-25/02/28	1,540,000.00	1,442,667.19	
US TREASURY N/B-2.625%-25/03/31	2,010,000.00	1,945,460.14	
US TREASURY N/B-0.5%-25/03/31	3,470,000.00	3,199,448.43	
US TREASURY N/B-2.625%-25/04/15	2,600,000.00	2,513,062.50	
US TREASURY N/B-2.875%-25/04/30	2,200,000.00	2,138,210.93	
US TREASURY N/B-0.375%-25/04/30	2,150,000.00	1,970,189.45	
US TREASURY N/B-2.125%-25/05/15	3,800,000.00	3,627,515.64	
US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,420,000.00	1,379,285.93	
US TREASURY N/B-0.25%-25/05/31	3,820,000.00	3,481,273.41	
US TREASURY N/B-2.875%-25/06/15	5,000,000.00	4,858,593.75	
US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	1,370,000.00	1,327,883.19	
US TREASURY N/B-3.0%-25/07/15	5,000,000.00	4,870,507.80	
US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	1,440,000.00	1,398,937.50	
US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	3,000,000.00	2,719,570.32	
US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	4,730,000.00	4,487,217.99	
US TREASURY N/B-2.75%-25/08/31	3,000,000.00	2,901,914.07	
US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	4,200,000.00	4,088,437.50	
US TREASURY N/B-0.25%-25/09/30	1,570,000.00	1,418,458.19	
US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,361,882.81	

US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	2,110,000.00	1,898,670.31	
US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	3,440,000.00	3,277,271.86	
US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,279,214.05	
US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	3,420,000.00	3,079,335.92	
US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	1,925,625.00	
US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	1,780,480.47	
US TREASURY N/B-0.375%-26/01/31	3,000,000.00	2,688,398.43	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	1,910,460.78	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,310,000.00	3,085,023.43	
US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,713,785.16	
US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	3,650,000.00	3,275,875.00	
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	2,070,000.00	1,966,500.00	
US TREASURY N/B-0.75%-26/03/31	2,400,000.00	2,168,718.74	
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	320,000.00	304,875.00	
US TREASURY N/B-0.75%-26/04/30	2,740,000.00	2,470,067.20	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	4,840,000.00	4,492,125.00	
US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	2,740,000.00	2,586,731.25	
US TREASURY N/B-0.75%-26/05/31	2,800,000.00	2,518,687.50	
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	1,871,250.00	
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	960,000.00	896,774.99	
US TREASURY N/B-0.625%-26/07/31	3,260,000.00	2,908,276.57	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,681,796.88	
US TREASURY N/B-0.75%-26/08/31	3,000,000.00	2,683,359.36	
US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,497,171.09	
US TREASURY N/B-0.875%-26/09/30	3,000,000.00	2,691,562.50	
US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	2,450,000.00	2,260,699.23	
US TREASURY N/B-1.125%-26/10/31	3,950,000.00	3,570,583.97	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,040,000.00	2,841,806.25	
US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,870,000.00	2,644,660.17	
US TREASURY N/B-1.25%-26/11/30	2,210,000.00	2,005,316.01	
US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	1,850,312.50	
US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	4,000,000.00	3,655,156.24	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	2,060,000.00	1,940,342.96	
US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,530,000.00	1,376,462.11	
US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	3,310,000.00	2,903,361.33	
US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	2,450,000.00	2,134,658.19	

US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,333,919.51	
US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	2,100,000.00	1,823,144.52	
US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	3,100,000.00	2,685,496.08	
US TREASURY N/B-3.25%-27/06/30	5,000,000.00	4,902,148.45	
US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	7,000,000.00	6,017,812.50	
US TREASURY N/B-2.75%-27/07/31	930,000.00	892,218.75	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	2,776,271.88	
US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	8,100,000.00	6,986,566.38	
US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	4,090,000.00	3,498,547.63	
US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	3,860,000.00	3,314,473.45	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	1,400,000.00	1,550,554.60	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	2,824,879.67	
US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	220,000.00	189,698.43	
US TREASURY N/B-0.625%-27/12/31	3,960,000.00	3,407,920.32	
US TREASURY N/B-0.75%-28/01/31	2,850,000.00	2,463,802.74	
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	3,824,062.48	
US TREASURY N/B-1.125%-28/02/29	3,830,000.00	3,371,148.03	
US TREASURY N/B-1.25%-28/03/31	960,000.00	849,000.00	
US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	3,370,000.00	2,976,262.88	
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	2,440,000.00	2,343,543.75	
US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	4,300,000.00	3,789,878.91	
US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	3,300,000.00	2,904,515.62	
US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	2,920,000.00	2,527,396.88	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	4,028,226.55	
US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	3,900,000.00	3,393,761.70	
US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	4,000,000.00	3,500,781.24	
US TREASURY N/B-1.375%-28/10/31	4,000,000.00	3,521,562.48	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,155,808.97	
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	4,510,000.00	4,380,513.66	
US TREASURY N/B-1.5%-28/11/30	6,000,000.00	5,315,156.28	
US TREASURY N/B-1.375%-28/12/31	870,000.00	764,886.32	
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,590,000.00	4,330,557.40	
US TREASURY N/B-2.375%-29/03/31	4,630,000.00	4,299,750.80	
US TREASURY N/B-2.875%-29/04/30	2,000,000.00	1,912,968.76	
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	4,810,000.00	4,466,348.05	
US TREASURY N/B-3.25%-29/06/30	4,980,000.00	4,868,339.01	

US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	4,070,000.00	3,609,024.78	
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	7,190,000.00	6,425,922.07	
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	3,788,684.37	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,239,703.07	
US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	4,590,000.00	3,730,271.47	
US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	5,090,000.00	4,113,356.25	
US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	6,110,000.00	5,021,656.25	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	560,000.00	631,159.36	
US TREASURY N/B-1.125%-31/02/15	4,400,000.00	3,688,609.36	
US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	7,480,000.00	6,473,414.08	
US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	7,600,000.00	6,342,437.50	
US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	6,830,000.00	5,729,996.46	
US TREASURY N/B-1.875%-32/02/15	6,500,000.00	5,678,867.22	
US TREASURY N/B-2.875%-32/05/15	4,600,000.00	4,369,640.64	
US TREASURY N/B-2.75%-32/08/15	5,100,000.00	4,787,625.00	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	893,062.48	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	878,642.55	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	739,224.60	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	720,000.00	805,134.31	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	793,625.00	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	1,573,929.61	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	1,586,850.00	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	825,117.15	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	770,285.91	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	1,745,149.17	
US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	2,460,789.04	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,481,793.69	
US TREASURY N/B-1.125%-40/08/15	3,000,000.00	1,979,179.68	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	1,088,669.50	
US TREASURY N/B-1.375%-40/11/15	3,100,000.00	2,136,335.92	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	1,719,785.10	
US TREASURY N/B-1.875%-41/02/15	4,200,000.00	3,145,406.25	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	951,800.35	
US TREASURY N/B-2.25%-41/05/15	4,900,000.00	3,893,968.75	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	963,637.44	
US TREASURY N/B-1.75%-41/08/15	3,190,000.00	2,311,940.02	

US TREASURY N/B-2.0%-41/11/15	3,000,000.00	2,265,527.34	
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	456,191.40	
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	683,093.75	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	1,703,671.88	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	1,765,000.00	1,597,325.00	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	1,779,255.86	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	1,950,000.00	1,903,382.81	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	2,078,080.47	
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	1,080,000.00	1,054,350.00	
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,200,000.00	2,063,531.25	
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	2,150,000.00	1,936,679.68	
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	2,100,000.00	1,851,691.40	
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	2,820,000.00	2,275,387.50	
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	1,400,000.00	1,232,820.31	
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	1,390,000.00	1,197,327.54	
US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	1,190,000.00	1,048,408.58	
US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	1,500,000.00	1,205,390.62	
US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	1,500,000.00	1,203,046.87	
US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	2,150,000.00	1,640,046.87	
US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	1,540,000.00	1,325,603.12	
US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	2,000,000.00	1,759,296.88	
US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	1,780,000.00	1,566,539.05	
US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	2,000,000.00	1,683,164.06	
US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,740,000.00	1,465,406.25	
US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	2,428,701.16	
US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	2,172,140.61	
US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	3,631,222.64	
US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	2,804,516.59	
US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	2,940,673.82	
US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	2,612,812.50	
US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,950,000.00	2,257,556.64	
US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	2,440,160.16	
US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	2,670,070.29	
US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	2,450,000.00	1,451,864.26	
US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,570,000.00	1,573,773.62	
US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	3,000,000.00	1,964,355.48	

		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	4,750,000.00	3,312,846.69	
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	4,100,000.00	3,210,892.57	
		US TREASURY N/B-2.0%-51/08/15	2,000,000.00	1,435,156.24	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/11/15	1,400,000.00	973,054.68	
		US TREASURY N/B-3.0%-52/08/15	1,000,000.00	898,437.50	
米ドル小計			608,710,000.00	550,537,597.10 (74,586,833,655)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-24/02/01	590,000.00	568,932.28	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-24/03/01	790,000.00	774,187.36	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-24/04/01	1,450,000.00	1,383,887.25	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-24/06/01	1,010,000.00	991,047.35	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-24/08/01	650,000.00	638,969.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-24/09/01	795,000.00	765,833.83	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.75%-24/10/01	800,000.00	759,165.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-25/03/01	610,000.00	579,864.17	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-25/04/01	760,000.00	725,219.36	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	950,000.00	923,218.55	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-25/09/01	1,855,000.00	1,713,226.06	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	995,000.00	903,194.33	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	770,000.00	728,857.36	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-26/09/01	1,090,000.00	1,008,277.25	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	520,000.00	483,647.84	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	850,000.00	783,599.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-27/09/01	520,000.00	515,419.84	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	707,000.00	679,257.32	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	540,000.00	633,536.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	364,000.00	352,893.99	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	2,198,000.00	1,971,568.63	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-30/12/01	1,405,000.00	1,175,893.67	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	1,966,000.00	1,772,400.11	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/12/01	1,950,000.00	1,747,455.45	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-32/06/01	790,000.00	736,272.10	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-32/12/01	410,000.00	398,272.77	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	710,000.00	893,770.01	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	340,000.00	420,758.84	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	600,000.00	687,724.80	

		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	730,000.00	799,814.28	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	750,000.00	731,405.25	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	2,403,000.00	1,995,088.34	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-53/12/01	1,046,000.00	810,155.24	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	326,671.90	
加ドル小計			32,249,000.00	30,379,486.43	(3,039,163,822)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-23/12/07	12,100,000.00	11,812,625.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-24/09/05	18,900,000.00	18,365,484.37	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-24/12/05	16,700,000.00	16,825,250.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	24,250,000.00	22,169,804.68	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	4,550,000.00	4,036,703.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	20,600,000.00	19,750,250.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	16,670,000.00	16,513,718.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	22,400,000.00	21,056,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	5,300,000.00	4,848,671.87	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	3,900,000.00	4,233,937.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	12,970,000.00	12,457,279.68	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	13,200,000.00	11,692,312.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	13,570,000.00	12,331,737.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-53/07/31	2,800,000.00	2,528,750.00	
メキシコペソ小計			187,910,000.00	178,622,524.97	(1,232,763,356)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	270,000.00	135,225.25	
		BELGIUM KINGDOM-2.6%-24/06/22	845,000.00	850,129.15	
		BELGIUM KINGDOM-0.5%-24/10/22	670,000.00	650,139.19	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,265,000.00	1,225,413.40	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	670,000.00	721,708.59	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	852,000.00	820,988.19	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	830,000.00	781,954.62	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	495,000.00	445,236.66	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	1,070,000.00	1,250,370.97	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	965,000.00	898,546.24	
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	1,060,000.00	975,174.56	
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	800,000.00	679,230.65	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	1,000,000.00	894,050.00	

BELGIUM KINGDOM-0.0%-31/10/22	750,000.00	605,596.50	
BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	600,000.00	673,276.80	
BELGIUM KINGDOM-0.35%-32/06/22	390,000.00	319,117.73	
BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	695,000.00	617,344.17	
BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	543,000.00	562,751.08	
BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	1,080,000.00	1,340,807.04	
BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	425,000.00	361,082.12	
BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	485,000.00	433,926.10	
BELGIUM KINGDOM-2.75%-39/04/22	160,000.00	159,351.20	
BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	330,000.00	222,271.50	
BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	1,112,000.00	1,339,968.89	
BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	455,000.00	530,030.86	
BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	658,000.00	527,024.44	
BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	650,000.00	521,716.00	
BELGIUM KINGDOM-1.4%-53/06/22	485,000.00	354,144.57	
BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	412,000.00	375,833.81	
BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	486,000.00	435,070.11	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-71/10/31	345,000.00	191,352.52	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.8%-24/01/31	765,000.00	786,729.82	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.8%-24/04/30	1,250,000.00	1,275,471.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-24/05/31	1,000,000.00	966,780.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.25%-24/07/30	1,100,000.00	1,064,179.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.75%-24/10/31	1,520,000.00	1,532,046.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-25/01/31	1,350,000.00	1,285,822.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.6%-25/04/30	1,350,000.00	1,328,676.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	1,490,000.00	1,578,494.08	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%-25/10/31	1,455,000.00	1,449,818.74	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-26/01/31	1,315,000.00	1,220,476.03	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-26/04/30	1,055,000.00	1,040,542.28	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%-26/07/30	1,360,000.00	1,526,976.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%-26/10/31	1,720,000.00	1,652,679.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-27/01/31	505,000.00	456,576.37	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%-27/04/30	1,475,000.00	1,418,519.30	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%-27/07/30	1,315,000.00	1,219,102.31	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-27/10/31	1,400,000.00	1,333,879.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%-28/01/31	1,010,000.00	887,864.74	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/04/30	1,270,000.00	1,197,637.94	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%-28/07/30	1,275,000.00	1,198,784.32	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-28/10/31	1,095,000.00	1,245,423.43	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%-29/01/31	1,545,000.00	1,845,400.53	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-29/04/30	1,495,000.00	1,396,183.49	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%-29/10/31	1,240,000.00	1,084,306.84	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-30/04/30	1,400,000.00	1,198,719.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%-30/07/30	1,330,000.00	1,261,970.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%-30/10/31	1,530,000.00	1,372,201.92	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%-31/04/30	1,155,000.00	927,426.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-31/10/31	1,235,000.00	1,011,309.39	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.7%-32/04/30	1,340,000.00	1,101,839.12	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	1,450,000.00	1,809,228.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.55%-32/10/31	645,000.00	622,657.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%-33/07/30	1,165,000.00	1,100,725.78	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%-35/07/30	1,195,000.00	1,041,801.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	1,250,000.00	1,403,132.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.85%-37/07/30	670,000.00	484,452.88	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	1,045,000.00	1,284,112.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%-40/10/31	1,000,000.00	719,368.24	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	1,265,000.00	1,529,383.73	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-42/07/30	300,000.00	203,781.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	930,000.00	1,215,020.82	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	1,060,000.00	1,013,203.12	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	985,000.00	896,462.29	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-50/10/31	1,170,000.00	701,148.24	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.9%-52/10/31	560,000.00	411,775.84	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-	848,000.00	868,994.78	

66/07/30		
BUNDESOBLIGATION-0.0%-24/04/05	1,300,000.00	1,266,794.88
BUNDESOBLIGATION-0.0%-24/10/18	1,360,000.00	1,310,617.04
BUNDESOBLIGATION-0.0%-25/04/11	1,300,000.00	1,241,957.60
BUNDESOBLIGATION-0.0%-25/10/10	2,045,000.00	1,937,032.18
BUNDESOBLIGATION-0.0%-26/04/10	1,600,000.00	1,503,040.00
BUNDESOBLIGATION-0.0%-27/04/16	1,250,000.00	1,151,416.25
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-24/01/04	790,000.00	825,334.72
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.75%-24/02/15	1,230,000.00	1,226,461.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.5%-24/05/15	1,575,000.00	1,563,540.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-24/08/15	1,790,000.00	1,760,651.16
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-25/02/15	870,000.00	842,654.16
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-25/08/15	2,070,000.00	2,018,527.66
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	1,820,000.00	1,741,842.32
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-26/08/15	2,710,000.00	2,530,874.42
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	2,795,000.00	2,614,261.32
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%-27/07/04	910,000.00	1,090,992.63
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15	1,770,000.00	1,662,384.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-27/11/15	1,370,000.00	1,249,842.78
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	650,000.00	765,631.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-28/02/15	1,770,000.00	1,651,965.78
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	970,000.00	1,113,497.92
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-28/08/15	1,670,000.00	1,526,521.95
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-28/11/15	1,080,000.00	968,434.92
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-29/02/15	1,875,000.00	1,701,421.87
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-29/08/15	1,830,000.00	1,617,893.85
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	660,000.00	848,234.64
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/02/15	1,410,000.00	1,235,030.28
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/08/15	1,920,000.00	1,667,080.32
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-30/08/15	820,000.00	712,000.26
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	1,110,000.00	1,401,112.81
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/02/15	2,000,000.00	1,716,686.00

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/08/15	1,565,000.00	1,330,052.81	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-31/08/15	400,000.00	340,281.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-32/02/15	1,238,000.00	1,040,732.12	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.7%-32/08/15	1,680,000.00	1,645,682.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	1,475,000.00	1,899,387.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-35/05/15	1,200,000.00	937,920.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-36/05/15	1,000,000.00	765,772.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	1,790,000.00	2,229,317.91	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	1,235,000.00	1,622,573.87	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	1,355,000.00	1,902,377.99	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	955,000.00	1,157,037.89	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-44/07/04	1,635,000.00	1,809,125.86	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-46/08/15	2,197,000.00	2,472,016.06	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%-48/08/15	2,040,000.00	1,813,441.68	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	1,480,000.00	915,086.26	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	640,000.00	396,504.32	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-52/08/15	750,000.00	448,930.92	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-23/12/15	900,000.00	882,176.67	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.0%-24/03/15	830,000.00	809,229.25	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-0.2%-24/06/14	760,000.00	739,290.19	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-72/03/01	300,000.00	194,207.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-24/01/15	650,000.00	631,781.15	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-24/01/30	250,000.00	242,810.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-24/03/01	1,650,000.00	1,685,501.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-24/04/15	1,360,000.00	1,314,267.28	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%-24/05/15	1,075,000.00	1,063,445.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.75%-24/07/01	1,180,000.00	1,164,409.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-24/08/15	570,000.00	545,775.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.75%-24/09/01	1,250,000.00	1,273,321.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-24/11/15	1,260,000.00	1,232,532.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-24/12/01	1,080,000.00	1,076,940.36	

BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-24/12/15	650,000.00	617,001.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.35%-25/02/01	1,485,000.00	1,413,385.87	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-25/03/01	1,540,000.00	1,616,072.92	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-25/05/15	855,000.00	830,835.99	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-25/06/01	1,300,000.00	1,261,638.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%-25/07/01	1,000,000.00	976,141.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-25/11/15	1,100,000.00	1,089,693.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-25/12/01	1,085,000.00	1,057,983.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%-26/02/01	850,000.00	787,509.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-26/03/01	1,330,000.00	1,391,884.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-26/04/01	1,220,000.00	1,104,658.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%-26/06/01	1,330,000.00	1,269,140.53	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%-26/07/15	1,220,000.00	1,182,199.52	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-26/08/01	870,000.00	780,227.48	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	720,000.00	834,008.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%-26/12/01	1,080,000.00	1,009,256.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%-27/01/15	1,180,000.00	1,081,526.59	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.1%-27/04/01	410,000.00	377,110.62	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%-27/06/01	1,160,000.00	1,118,474.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%-27/08/01	995,000.00	948,920.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-27/09/15	1,275,000.00	1,152,311.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	1,560,000.00	1,797,633.24	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-28/02/01	1,650,000.00	1,555,953.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%-28/03/15	1,230,000.00	1,049,761.95	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%-28/07/15	1,330,000.00	1,139,701.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-28/09/01	1,330,000.00	1,428,712.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-28/12/01	1,415,000.00	1,376,811.98	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%-29/02/15	1,125,000.00	940,057.87	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-29/08/01	1,655,000.00	1,614,174.46	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	1,750,000.00	1,951,948.25	

BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-30/03/01	1,620,000.00	1,624,147.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%-30/04/01	1,075,000.00	925,654.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-30/08/01	1,167,000.00	962,912.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-30/12/01	1,367,000.00	1,182,530.18	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%-31/04/01	1,375,000.00	1,109,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	1,515,000.00	1,781,291.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%-31/08/01	1,260,000.00	978,280.38	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-31/12/01	1,010,000.00	800,169.47	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-32/03/01	1,610,000.00	1,355,958.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-32/06/01	950,000.00	743,052.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	1,475,000.00	1,704,961.35	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-33/09/01	1,365,000.00	1,190,443.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	1,580,000.00	1,722,953.66	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%-35/03/01	980,000.00	916,613.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-36/03/01	900,000.00	674,264.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%-36/09/01	965,000.00	798,517.23	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	2,005,000.00	2,014,698.18	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-37/03/01	400,000.00	273,750.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%-38/09/01	1,200,000.00	1,053,802.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	1,500,000.00	1,671,313.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%-40/03/01	610,000.00	539,668.83	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	1,070,000.00	1,199,925.82	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%-41/03/01	830,000.00	598,361.94	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01	1,165,000.00	1,282,711.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-45/04/30	440,000.00	282,449.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-46/09/01	1,020,000.00	912,400.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%-47/03/01	970,000.00	789,621.71	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%-48/03/01	1,135,000.00	1,045,364.51	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-	850,000.00	834,222.30	

49/09/01			
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-50/09/01	870,000.00	658,343.79	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%-51/09/01	850,000.00	543,516.35	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-52/09/01	280,000.00	194,807.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	630,000.00	484,840.44	
FINNISH GOVERNMENT-2.0%-24/04/15	250,000.00	249,689.75	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-24/09/15	255,000.00	245,986.77	
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	332,000.00	347,977.83	
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	280,000.00	270,895.66	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	435,000.00	412,508.32	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-26/09/15	100,000.00	92,075.70	
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-27/04/15	120,000.00	115,489.50	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	400,000.00	368,334.00	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	380,000.00	389,238.18	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	243,880.20	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	375,000.00	331,722.22	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-30/09/15	172,000.00	142,778.74	
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	535,000.00	466,868.28	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-31/09/15	150,000.00	122,963.22	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-32/09/15	110,000.00	100,482.39	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	325,000.00	280,158.77	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	278,000.00	202,153.81	
FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15	263,000.00	176,829.62	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	277,000.00	280,959.43	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-43/04/15	235,000.00	161,010.72	
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	213,783.70	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-52/04/15	250,000.00	137,197.35	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	515,000.00	244,258.32	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-24/02/25	1,005,000.00	979,745.35	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-24/03/25	2,390,000.00	2,324,102.92	
FRANCE (GOVT OF)-2.25%-24/05/25	2,439,000.00	2,440,079.98	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-24/11/25	2,758,000.00	2,733,715.81	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/02/25	135,000.00	128,643.52	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-25/03/25	2,785,000.00	2,650,637.67	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-25/05/25	2,610,000.00	2,508,275.25	

FRANCE (GOVT OF) -6.0%-25/10/25	2,090,000.00	2,311,897.39	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-25/11/25	2,070,000.00	2,005,202.79	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-26/02/25	2,040,000.00	1,906,586.04	
FRANCE (GOVT OF) -3.5%-26/04/25	2,730,000.00	2,848,006.43	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-26/05/25	2,450,000.00	2,318,665.30	
FRANCE (GOVT OF) -0.25%-26/11/25	3,010,000.00	2,799,077.26	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-27/02/25	1,390,000.00	1,272,446.30	
FRANCE (GOVT OF) -1.0%-27/05/25	2,275,000.00	2,167,069.45	
FRANCE (GOVT OF) -2.75%-27/10/25	3,250,000.00	3,339,914.50	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/02/25	165,000.00	153,417.66	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/05/25	3,995,000.00	3,704,931.04	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-28/11/25	3,030,000.00	2,791,932.90	
FRANCE (GOVT OF) -5.5%-29/04/25	1,975,000.00	2,360,857.72	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-29/05/25	2,990,000.00	2,690,895.35	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-29/11/25	2,580,000.00	2,217,522.90	
FRANCE (GOVT OF) -2.5%-30/05/25	3,065,000.00	3,129,141.25	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-30/11/25	3,049,000.00	2,556,068.17	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-31/05/25	3,290,000.00	3,108,734.16	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-31/11/25	2,605,000.00	2,124,283.72	
FRANCE (GOVT OF) -0.0%-32/05/25	2,178,000.00	1,746,250.70	
FRANCE (GOVT OF) -5.75%-32/10/25	2,085,000.00	2,694,620.64	
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-32/11/25	775,000.00	746,760.55	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-34/05/25	2,425,000.00	2,108,428.37	
FRANCE (GOVT OF) -4.75%-35/04/25	1,665,000.00	2,038,962.33	
FRANCE (GOVT OF) -1.25%-36/05/25	2,555,000.00	2,158,967.33	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-38/10/25	1,590,000.00	1,862,948.94	
FRANCE (GOVT OF) -1.75%-39/06/25	2,060,000.00	1,831,550.12	
FRANCE (GOVT OF) -4.5%-41/04/25	2,780,000.00	3,506,191.60	
FRANCE (GOVT OF) -0.5%-44/06/25	960,000.00	630,779.52	
FRANCE (GOVT OF) -3.25%-45/05/25	1,730,000.00	1,898,564.28	
FRANCE (GOVT OF) -2.0%-48/05/25	1,830,000.00	1,611,382.71	
FRANCE (GOVT OF) -1.5%-50/05/25	1,960,000.00	1,533,809.76	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-52/05/25	1,500,000.00	942,121.50	
FRANCE (GOVT OF) -0.75%-53/05/25	775,000.00	475,602.00	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-55/04/25	1,300,000.00	1,668,893.20	
FRANCE (GOVT OF) -4.0%-60/04/25	1,070,000.00	1,419,072.52	

FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	825,000.00	671,200.20	
IRISH TREASURY-3.4%-24/03/18	460,000.00	467,463.91	
IRISH TREASURY-5.4%-25/03/13	580,000.00	621,038.48	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	655,000.00	633,707.26	
IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15	327,000.00	300,992.95	
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	520,000.00	486,964.40	
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	600,000.00	560,638.80	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	546,000.00	551,994.26	
IRISH TREASURY-0.2%-30/10/18	282,000.00	240,435.73	
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	475,000.00	443,421.05	
IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	485,000.00	395,430.20	
IRISH TREASURY-0.35%-32/10/18	205,000.00	169,176.59	
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	285,000.00	254,923.95	
IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	310,000.00	239,638.37	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	390,000.00	348,370.23	
IRISH TREASURY-0.55%-41/04/22	250,000.00	174,292.00	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	541,000.00	481,838.39	
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	444,000.00	353,230.86	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-24/01/15	835,000.00	816,552.34	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-24/07/15	989,000.00	987,619.35	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	1,035,000.00	988,353.94	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-26/01/15	250,000.00	234,463.76	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	1,140,000.00	1,080,238.92	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	898,000.00	826,588.34	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	925,000.00	873,796.62	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	775,000.00	901,342.05	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	961,000.00	895,609.71	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	570,000.00	501,877.02	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	645,000.00	572,024.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-30/07/15	785,000.00	670,248.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-31/07/15	775,000.00	646,948.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-32/07/15	570,000.00	487,179.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	855,000.00	876,379.27	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	1,025,000.00	1,236,445.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-38/01/15	325,000.00	232,818.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	888,000.00	675,505.15	

		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	1,017,000.00	1,258,630.04	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	1,154,000.00	1,299,640.57	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	777,000.00	447,144.07	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-54/01/15	235,000.00	233,195.67	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.7%-71/04/20	200,000.00	107,525.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	173,000.00	124,885.58	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	403,000.00	348,490.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.85%-99/99/99	192,000.00	95,909.76	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-24/07/15	555,000.00	536,590.65	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.65%-24/10/21	705,000.00	699,273.28	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-25/04/20	400,000.00	379,957.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	710,000.00	693,109.10	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	550,000.00	597,713.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.0%-26/07/15	140,000.00	139,152.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	963,000.00	917,669.66	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	638,694.68	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	540,000.00	637,688.32	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	660,000.00	613,514.22	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-28/10/20	190,000.00	166,224.35	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	885,000.00	793,111.33	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	680,000.00	573,467.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-31/02/20	665,000.00	545,400.41	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.9%-32/02/20	450,000.00	390,599.10	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	485,000.00	478,696.94	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-36/10/20	270,000.00	197,535.24	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	840,000.00	994,249.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	345,000.00	219,538.33	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	394,000.00	434,934.27	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	503,000.00	415,208.89	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.85%-49/05/23	170,000.00	150,605.55	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	405,000.00	268,063.42	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	190,000.00	251,255.43	
			365,478,000.00	350,311,534.34	
				(50,693,582,134)	
ユーロ小計					
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	650,000.00	380,822.00	
		UK TREASURY-1.125%-73/10/22	473,000.00	219,784.18	

UK TREASURY-0.125%-24/01/31	1,230,000.00	1,184,753.46	
UK TREASURY-1.0%-24/04/22	1,030,000.00	997,121.57	
UK TREASURY-2.75%-24/09/07	935,000.00	922,371.89	
UK TREASURY-0.25%-25/01/31	1,230,000.00	1,146,831.33	
UK TREASURY-5.0%-25/03/07	1,205,000.00	1,246,549.36	
UK TREASURY-0.625%-25/06/07	813,000.00	761,893.84	
UK TREASURY-0.125%-26/01/30	710,000.00	645,638.59	
UK TREASURY-1.5%-26/07/22	820,000.00	770,409.68	
UK TREASURY-0.375%-26/10/22	1,220,000.00	1,091,229.00	
UK TREASURY-4.125%-27/01/29	350,000.00	358,369.13	
UK TREASURY-1.25%-27/07/22	840,000.00	767,298.00	
UK TREASURY-4.25%-27/12/07	850,000.00	886,248.08	
UK TREASURY-0.125%-28/01/31	745,000.00	634,665.50	
UK TREASURY-1.625%-28/10/22	720,000.00	659,167.20	
UK TREASURY-6.0%-28/12/07	710,000.00	810,291.76	
UK TREASURY-0.5%-29/01/31	845,000.00	712,901.15	
UK TREASURY-0.875%-29/10/22	856,000.00	731,653.57	
UK TREASURY-0.375%-30/10/22	920,000.00	735,236.40	
UK TREASURY-4.75%-30/12/07	1,005,000.00	1,108,324.05	
UK TREASURY-0.25%-31/07/31	1,445,000.00	1,110,317.77	
UK TREASURY-1.0%-32/01/31	1,155,000.00	938,599.20	
UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,370,000.00	1,471,503.30	
UK TREASURY-0.875%-33/07/31	420,000.00	323,790.60	
UK TREASURY-4.5%-34/09/07	849,000.00	930,217.88	
UK TREASURY-0.625%-35/07/31	1,007,000.00	705,953.32	
UK TREASURY-4.25%-36/03/07	970,000.00	1,037,851.50	
UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,350,000.00	1,056,415.50	
UK TREASURY-4.75%-38/12/07	1,060,000.00	1,192,372.80	
UK TREASURY-4.25%-39/09/07	970,000.00	1,029,334.90	
UK TREASURY-4.25%-40/12/07	935,000.00	991,913.45	
UK TREASURY-1.25%-41/10/22	1,100,000.00	732,644.00	
UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,090,000.00	1,199,577.70	
UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,175,000.00	1,078,920.25	
UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,160,000.00	1,107,092.40	
UK TREASURY-0.875%-46/01/31	435,000.00	241,516.35	
UK TREASURY-4.25%-46/12/07	920,000.00	983,618.00	

		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,230,000.00	782,833.00	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	675,000.00	452,074.50	
		UK TREASURY-4.25%-49/12/07	895,000.00	965,633.40	
		UK TREASURY-0.625%-50/10/22	660,000.00	311,473.80	
		UK TREASURY-1.25%-51/07/31	300,000.00	170,559.00	
		UK TREASURY-3.75%-52/07/22	872,000.00	875,104.32	
		UK TREASURY-1.5%-53/07/31	360,000.00	216,500.40	
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	635,000.00	393,287.25	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	962,000.00	1,066,867.62	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	688,795.50	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	751,000.00	815,893.91	
		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	830,000.00	313,623.80	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	830,000.00	830,016.60	
		UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	605,000.00	584,067.00	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	882,000.00	691,664.40	
英ポンド小計			47,130,000.00	42,061,593.16	(7,079,807,360)
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-2.5%-25/05/12	4,420,000.00	4,444,854.54	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	4,700,000.00	4,521,369.49	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,550,000.00	3,351,364.61	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	3,780,000.00	3,522,910.86	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	2,700,000.00	2,359,815.93	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,800,000.00	1,884,906.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	2,785,000.00	3,536,782.90	
スウェーデンクローナ小計			23,735,000.00	23,622,004.33	(315,117,537)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-24/03/14	3,820,000.00	3,820,206.28	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-25/03/13	3,190,000.00	3,113,631.40	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,750,000.00	2,641,193.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,400,000.00	2,305,834.56	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,340,000.00	2,255,806.80	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	2,250,000.00	2,114,648.10	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	3,150,000.00	2,846,466.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.25%-31/09/17	2,040,000.00	1,796,738.16	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.125%-32/05/18	1,900,000.00	1,792,578.75	
ノルウェークローネ小計			23,840,000.00	22,687,103.55	

				(315,804,481)	
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-0.0%-24/11/15	1,760,000.00	1,687,030.40	
		KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	3,270,000.00	3,231,989.52	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	4,310,000.00	3,990,784.16	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	3,130,000.00	2,808,678.82	
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-31/11/15	1,350,000.00	1,115,629.81	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	9,250,000.00	12,406,211.00	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	1,300,000.00	829,653.50	
デンマーククローネ小計			24,370,000.00	26,069,977.21	(507,061,056)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-24/04/25	2,110,000.00	1,998,402.10	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-24/07/25	310,000.00	278,608.82	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.25%-24/10/25	1,980,000.00	1,829,302.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.75%-25/04/25	1,440,000.00	1,260,014.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,570,000.00	2,363,500.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,590,000.00	2,248,016.40	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,950,000.00	1,534,981.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	810,000.00	722,528.10	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,140,000.00	1,803,228.20	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,160,000.00	1,805,176.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	555,000.00	537,045.75	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	2,665,000.00	2,139,701.85	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	2,025,000.00	1,396,237.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-32/04/25	1,500,000.00	1,018,200.00	
ポーランドズロチ小計			24,805,000.00	20,934,944.12	(647,199,610)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-24/04/21	755,000.00	751,542.13	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-24/11/21	1,715,000.00	1,624,561.12	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-25/04/21	1,000,000.00	1,004,783.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	950,000.00	875,424.13	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	1,130,000.00	1,170,566.09	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,310,000.00	1,188,115.26	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	1,170,000.00	1,245,178.23	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	980,000.00	961,017.75	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	850,000.00	810,271.21	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	720,000.00	702,084.98	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	1,030,000.00	1,031,239.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	890,000.00	862,092.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,300,000.00	1,233,118.21	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	1,180,000.00	988,494.01	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,378,000.00	1,191,836.55	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,790,000.00	1,467,796.11	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,580,000.00	1,313,360.85	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	1,270,000.00	1,098,211.12	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,090,000.00	1,197,349.74	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-33/11/21	790,000.00	761,508.91	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-34/05/21	650,000.00	669,754.54	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	530,000.00	489,382.97	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	750,000.00	762,680.47	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	582,000.00	550,743.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	790,000.00	686,048.98	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	720,000.00	632,773.18	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	1,020,000.00	667,897.80	
豪ドル小計			27,920,000.00	25,937,833.84 (2,413,515,438)	
ニュージーランドドル	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.5%-24/05/15	500,000.00	470,024.72	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-25/04/15	590,000.00	565,197.96	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.5%-26/05/15	135,000.00	118,264.08	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-27/04/15	700,000.00	704,873.89	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.0%-29/04/20	680,000.00	635,467.43	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.5%-31/05/15	350,000.00	285,112.75	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.5%-33/04/14	300,000.00	284,093.12	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-37/04/15	380,000.00	318,640.39	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.75%-41/05/15	115,000.00	77,788.19	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-51/05/15	500,000.00	382,040.92	
ニュージーランドドル小計			4,250,000.00	3,841,503.45 (336,477,287)	
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-72/08/01	140,000.00	151,787.86	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.0%-24/02/01	505,000.00	497,029.64	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-24/09/01	540,000.00	538,444.80	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	470,000.00	463,185.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-25/11/01	229,000.00	213,657.00	

		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	470,000.00	457,780.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-26/11/01	205,000.00	192,597.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	533,000.00	545,792.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	290,000.00	284,925.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	450,000.00	445,500.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	540,000.00	534,060.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-31/07/01	300,000.00	269,327.95	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-32/08/01	120,000.00	116,699.39	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	355,000.00	366,892.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	501,000.00	460,536.73	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	220,000.00	203,720.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	287,000.00	284,128.56	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	332,000.00	334,988.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	367,000.00	309,381.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-51/10/01	222,000.00	188,200.50	
シンガポールドル小計			7,076,000.00	6,858,633.43	(689,841,350)
マレーシア アリンギ ット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.478%-24/06/14	775,000.00	774,418.75	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.059%-24/09/30	830,000.00	837,179.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.882%-25/03/14	620,000.00	622,759.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,550,000.00	1,559,997.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	780,000.00	783,120.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	1,070,000.00	1,073,745.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,100,000.00	1,102,200.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,320,000.00	1,312,080.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	985,000.00	886,992.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	729,353.17	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,100,000.00	1,064,525.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	960,000.00	962,400.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,170,000.00	1,233,180.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	590,000.00	627,178.20	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	1,490,000.00	1,379,740.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.696%-42/10/15	390,000.00	406,185.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	660,000.00	706,975.83	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	620,000.00	645,028.71	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	510,000.00	542,375.61	

		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	1,560,000.00	1,443,780.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.181%-24/07/15	800,000.00	807,760.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	750,000.00	769,771.80	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.892%-27/03/15	330,000.00	332,414.51	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	936,035.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,620,000.00	1,605,420.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	910,000.00	933,546.25	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,044,759.94	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	980,000.00	955,512.72	
			26,155,000.00	26,078,433.99	
		マレーシアリングット小計		(802,193,492)	
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-24/04/11	14,000,000.00	14,174,216.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.47%-24/09/02	11,000,000.00	11,012,661.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.94%-24/10/17	16,000,000.00	16,152,648.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.99%-25/04/09	13,000,000.00	12,842,654.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-25/08/25	13,000,000.00	12,890,124.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	10,000,000.00	10,149,925.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	12,000,000.00	12,184,308.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	16,000,000.00	16,038,208.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-26/12/05	8,000,000.00	8,152,016.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	25,000,000.00	25,161,575.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.28%-27/12/03	5,000,000.00	5,150,977.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	12,000,000.00	12,174,702.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	11,000,000.00	11,085,690.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-29/05/23	14,000,000.00	14,476,703.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-29/09/25	12,000,000.00	11,849,436.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	11,000,000.00	10,868,209.55	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	8,000,000.00	8,276,400.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	10,000,000.00	10,116,345.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	8,000,000.00	7,910,936.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.76%-32/05/15	6,000,000.00	5,939,073.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-32/08/15	3,000,000.00	2,951,197.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	8,000,000.00	8,695,652.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	7,000,000.00	7,507,944.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.53%-51/10/18	7,000,000.00	7,286,247.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.32%-52/04/15	7,000,000.00	7,069,622.00	

中国元小計			267,000,000.00	270,117,471.55 (5,262,995,827)
イスラエル シケル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-1.5%-23/11/30	760,000.00	747,476.90
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-24/03/31	1,420,000.00	1,425,001.69
		ISRAEL FIXED BOND-0.4%-24/10/31	280,000.00	264,733.72
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-25/04/30	1,360,000.00	1,270,027.40
		ISRAEL FIXED BOND-1.75%-25/08/31	1,240,000.00	1,187,568.55
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-26/02/27	530,000.00	484,103.87
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	950,000.00	1,046,729.40
		ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,270,000.00	1,200,907.85
		ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,040,000.00	981,501.70
		ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	1,515,000.00	1,293,895.74
		ISRAEL FIXED BOND-1.3%-32/04/30	150,000.00	126,401.79
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	1,050,000.00	825,565.19
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,160,000.00	1,487,101.67
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,300,000.00	1,352,575.49
イスラエルシケル小計			14,025,000.00	13,693,590.96 (544,725,570)
合計				148,467,081,975 (148,467,081,975)

(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。

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 211 銘柄	100.0%	50.5%
加ドル	国債証券 34 銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 14 銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 336 銘柄	100.0%	34.1%
英ポンド	国債証券 53 銘柄	100.0%	4.8%
スウェーデンクローナ	国債証券 7 銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 9 銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7 銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 14 銘柄	100.0%	0.4%
豪ドル	国債証券 27 銘柄	100.0%	1.6%
ニュージーランドドル	国債証券 10 銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 20 銘柄	100.0%	0.5%

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	25 銘柄	100.0%	3.5%
イスラエルシェケル	国債証券	14 銘柄	100.0%	0.4%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2022年6月15日現在	2022年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	82,190,901	396,330,315
株式	40,571,484,680	44,307,234,410
派生商品評価勘定	-	3,505,650
未収入金	-	16,539,700
未収配当金	352,157,819	7,495,575
前払金	15,752,000	-
流動資産合計	41,021,585,400	44,731,105,650
資産合計	41,021,585,400	44,731,105,650
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	21,575,200	-
前受金	-	4,360,000
未払解約金	10,176,696	45,741,225
未払利息	35	646
流動負債合計	31,751,931	50,101,871
負債合計	31,751,931	50,101,871
純資産の部		
元本等		
元本	22,429,103,841	22,694,142,047
剰余金		
剰余金又は欠損金(△)	18,560,729,628	21,986,861,732
元本等合計	40,989,833,469	44,681,003,779
純資産合計	40,989,833,469	44,681,003,779
負債純資産合計	41,021,585,400	44,731,105,650

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6月15日現在	2022年12月15日現在
1.	期首	2021年12月16日	2022年6月16日
	期首元本額	21,660,098,146円	22,429,103,841円
	期首からの追加設定元本額	1,713,014,095円	1,185,829,090円
	期首からの一部解約元本額	944,008,400円	920,790,884円
	元本の内訳 ※		
	DCインデックスバランス（株式20）	777,678,129円	783,480,641円
	DCインデックスバランス（株式40）	2,027,436,158円	2,126,221,759円
	DCインデックスバランス（株式60）	4,044,186,651円	4,281,088,994円
	DCインデックスバランス（株式80）	4,371,341,836円	4,679,696,456円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,494,965,320円	1,740,586,733円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	3,223,742,152円	3,215,724,391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）	603,320,077円	566,179,113円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	45,986,576円	—円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	39,658,089円	—円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	47,186,971円	—円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	42,247,582円	—円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	2,647,178,954円	2,335,766,487円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	252,276,862円	236,743,507円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	706,908,176円	672,027,613円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,065,297,432円	1,030,656,811円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,039,692,876円	1,025,969,542円	
計	22,429,103,841円	22,694,142,047円	
2.	受益権の総数	22,429,103,841口	22,694,142,047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	571,065,000円	582,415,000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12月16日 至 2022年6月15日	自 2022年6月16日 至 2022年12月15日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	2022年6月15日現在	2022年12月15日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、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6月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	△3,277,860,977
合計	△3,277,860,977

(2022年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,262,989,709
合計	1,262,989,709

(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6月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	466,042,000	—	444,480,000	△21,562,000
合計		466,042,000	—	444,480,000	△21,562,000

(2022年12月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	330,875,000	—	334,390,000	3,515,000
合計		330,875,000	—	334,390,000	3,515,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2022年6月15日現在		2022年12月15日現在	
1口当たり純資産額	1.8275円	1口当たり純資産額	1.9688円
(1万口当たり純資産額)	(18,275円)	(1万口当たり純資産額)	(19,688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	3,700.00	2,960,000	
ニッセイ	21,800	529.00	11,532,200	
マルハニチロ	3,400	2,416.00	8,214,400	
雪国まいたけ	1,800	1,002.00	1,803,600	
カネコ種苗	700	1,414.00	989,800	
サカタのタネ	2,800	4,520.00	12,656,000	
ホクト	1,900	1,885.00	3,581,500	
ホクリヨウ	300	697.00	209,100	
住石ホールディングス	3,400	455.00	1,547,000	
日鉄鉱業	900	3,100.00	2,790,000	
三井松島ホールディングス	1,000	3,270.00	3,270,000	
I N P E X	80,600	1,485.00	119,691,000	
石油資源開発	2,500	4,050.00	10,125,000	
K&Oエナジーグループ	1,000	2,314.00	2,314,000	
ショーボンドホールディングス	3,000	5,840.00	17,520,000	
ミライト・ワン	7,600	1,544.00	11,734,400	
サンヨーホームズ	400	710.00	284,000	
日本アクア	1,000	872.00	872,000	
ファーストコーポレーション	700	715.00	500,500	
ベステラ	600	950.00	570,000	
キャンディル	500	499.00	249,500	
ダイセキ環境ソリューション	500	826.00	413,000	
第一カッター興業	600	1,081.00	648,600	
安藤・間	12,700	842.00	10,693,400	
東急建設	6,300	645.00	4,063,500	
コムシスホールディングス	7,400	2,450.00	18,130,000	
ビーアールホールディングス	3,600	334.00	1,202,400	
高松コンストラクショングループ	1,500	1,919.00	2,878,500	
東建コーポレーション	700	7,470.00	5,229,000	
ソネック	300	975.00	292,500	
ヤマウラ	1,200	994.00	1,192,800	
オリエンタル白石	8,100	282.00	2,284,200	
大成建設	15,200	4,230.00	64,296,000	

大林組	54,600	1,018.00	55,582,800
清水建設	45,900	720.00	33,048,000
飛島建設	1,800	1,015.00	1,827,000
長谷工コーポレーション	15,800	1,514.00	23,921,200
松井建設	1,600	577.00	923,200
銭高組	200	2,642.00	528,400
鹿島建設	33,800	1,539.00	52,018,200
不動テトラ	1,100	1,490.00	1,639,000
大末建設	600	1,197.00	718,200
鉄建建設	1,100	1,789.00	1,967,900
西松建設	2,600	3,970.00	10,322,000
三井住友建設	12,500	418.00	5,225,000
大豊建設	600	4,065.00	2,439,000
ナカノフドー建設	1,400	323.00	452,200
奥村組	2,500	2,957.00	7,392,500
東鉄工業	2,100	2,593.00	5,445,300
イチケン	400	1,774.00	709,600
富士ピー・エス	900	444.00	399,600
浅沼組	1,300	2,963.00	3,851,900
戸田建設	18,900	730.00	13,797,000
熊谷組	2,700	2,564.00	6,922,800
北野建設	300	2,530.00	759,000
植木組	500	1,329.00	664,500
矢作建設工業	2,200	780.00	1,716,000
ピーエス三菱	2,000	612.00	1,224,000
日本ハウスホールディングス	3,200	381.00	1,219,200
新日本建設	2,300	739.00	1,699,700
東亜道路工業	300	5,880.00	1,764,000
日本道路	300	5,970.00	1,791,000
東亜建設工業	1,300	2,288.00	2,974,400
日本国土開発	4,700	573.00	2,693,100
若築建設	700	2,830.00	1,981,000
東洋建設	5,100	842.00	4,294,200
五洋建設	21,700	638.00	13,844,600
福田組	600	4,720.00	2,832,000
住友林業	11,700	2,449.00	28,653,300

日本基礎技術	1,100	508.00	558,800
巴コーポレーション	1,900	397.00	754,300
大和ハウス工業	42,600	3,187.00	135,766,200
ライト工業	2,900	1,943.00	5,634,700
積水ハウス	47,800	2,435.50	116,416,900
日特建設	1,500	911.00	1,366,500
北陸電気工事	1,200	666.00	799,200
ユアテック	3,400	725.00	2,465,000
日本リーテック	1,100	798.00	877,800
四電工	700	1,716.00	1,201,200
中電工	2,400	2,073.00	4,975,200
関電工	8,400	869.00	7,299,600
きんでん	10,800	1,453.00	15,692,400
東京エネシス	1,600	932.00	1,491,200
トーエネック	500	3,455.00	1,727,500
住友電設	1,500	2,406.00	3,609,000
日本電設工業	2,600	1,653.00	4,297,800
エクシオグループ	7,500	2,178.00	16,335,000
新日本空調	900	1,900.00	1,710,000
九電工	3,700	3,275.00	12,117,500
三機工業	3,400	1,568.00	5,331,200
日揮ホールディングス	15,100	1,813.00	27,376,300
中外炉工業	600	1,610.00	966,000
ヤマト	1,400	714.00	999,600
太平電業	1,000	3,195.00	3,195,000
高砂熱学工業	3,700	1,788.00	6,615,600
三晃金属工業	200	3,020.00	604,000
朝日工業社	700	2,115.00	1,480,500
明星工業	2,700	762.00	2,057,400
大気社	1,900	3,510.00	6,669,000
ダイダン	1,000	2,185.00	2,185,000
日比谷総合設備	1,300	1,917.00	2,492,100
フィル・カンパニー	300	1,010.00	303,000
テスホールディングス	1,700	1,125.00	1,912,500
インフロニア・ホールディングス	16,000	1,027.00	16,432,000
東洋エンジニアリング	2,100	584.00	1,226,400

レイズネクスト	2,300	1,253.00	2,881,900
ニッポン	4,100	1,589.00	6,514,900
日清製粉グループ本社	14,200	1,532.00	21,754,400
日東富士製粉	300	4,330.00	1,299,000
昭和産業	1,300	2,420.00	3,146,000
鳥越製粉	1,200	640.00	768,000
中部飼料	2,100	1,036.00	2,175,600
フィード・ワン	2,300	674.00	1,550,200
東洋精糖	300	862.00	258,600
日本甜菜製糖	900	1,630.00	1,467,000
DM三井製糖ホールディングス	1,500	2,015.00	3,022,500
塩水港精糖	1,900	196.00	372,400
日新製糖	800	1,882.00	1,505,600
森永製菓	3,200	3,840.00	12,288,000
中村屋	400	3,125.00	1,250,000
江崎グリコ	4,400	3,670.00	16,148,000
名糖産業	600	1,615.00	969,000
井村屋グループ	800	2,252.00	1,801,600
不二家	1,000	2,592.00	2,592,000
山崎製パン	10,200	1,590.00	16,218,000
第一屋製パン	300	400.00	120,000
モロゾフ	500	3,510.00	1,755,000
亀田製菓	1,000	4,440.00	4,440,000
寿スピリッツ	1,600	7,730.00	12,368,000
カルビー	7,000	3,030.00	21,210,000
森永乳業	2,800	4,625.00	12,950,000
六甲バター	1,100	1,385.00	1,523,500
ヤクルト本社	10,900	8,730.00	95,157,000
明治ホールディングス	9,500	6,690.00	63,555,000
雪印メグミルク	3,700	1,762.00	6,519,400
プリマハム	2,100	2,102.00	4,414,200
日本ハム	6,000	3,655.00	21,930,000
林兼産業	500	457.00	228,500
丸大食品	1,500	1,422.00	2,133,000
S Foods	1,700	2,942.00	5,001,400
柿安本店	600	2,128.00	1,276,800

伊藤ハム米久ホールディングス	11,900	685.00	8,151,500
サッポロホールディングス	5,000	3,545.00	17,725,000
アサヒグループホールディングス	35,400	4,315.00	152,751,000
麒麟ホールディングス	69,100	2,123.00	146,699,300
宝ホールディングス	10,400	1,079.00	11,221,600
オエノンホールディングス	4,600	282.00	1,297,200
養命酒製造	500	1,808.00	904,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	12,000	1,464.00	17,568,000
サントリー食品インターナショナル	10,800	4,630.00	50,004,000
ダイドーグループホールディングス	900	4,895.00	4,405,500
伊藤園	5,700	5,130.00	29,241,000
キーコーヒー	1,700	2,067.00	3,513,900
ユニカフェ	500	984.00	492,000
ジャパンフーズ	200	1,088.00	217,600
日清オイリオグループ	2,200	3,250.00	7,150,000
不二製油グループ本社	3,600	2,061.00	7,419,600
J-オイルミルズ	1,500	1,519.00	2,278,500
キッコーマン	10,100	7,490.00	75,649,000
味の素	37,500	4,494.00	168,525,000
ブルドックソース	600	1,760.00	1,056,000
キューピー	8,200	2,430.00	19,926,000
ハウス食品グループ本社	4,700	2,764.00	12,990,800
カゴメ	7,100	3,050.00	21,655,000
焼津水産化学工業	700	855.00	598,500
アリアケジャパン	1,300	4,570.00	5,941,000
ピエトロ	200	1,817.00	363,400
エバラ食品工業	400	3,085.00	1,234,000
やまみ	100	1,309.00	130,900
ニチレイ	7,000	2,768.00	19,376,000
東洋水産	7,700	5,480.00	42,196,000
イトアンドホールディングス	600	2,279.00	1,367,400
大冷	200	1,894.00	378,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,000	568.00	568,000
日清食品ホールディングス	5,500	10,550.00	58,025,000
永谷園ホールディングス	800	2,009.00	1,607,200

一正蒲鉾	700	722.00	505,400
フジッコ	1,600	1,902.00	3,043,200
ロック・フィールド	1,900	1,491.00	2,832,900
日本たばこ産業	100,700	2,823.00	284,276,100
ケンコーマヨネーズ	1,100	1,535.00	1,688,500
わらべや日洋ホールディングス	1,100	1,910.00	2,101,000
なとり	1,000	2,055.00	2,055,000
イフジ産業	300	949.00	284,700
ファーマフーズ	2,400	1,514.00	3,633,600
ユーグレナ	9,800	1,048.00	10,270,400
紀文食品	1,200	961.00	1,153,200
ピクルスホールディングス	900	1,066.00	959,400
ミヨシ油脂	600	1,002.00	601,200
理研ビタミン	1,300	1,788.00	2,324,400
片倉工業	1,400	1,839.00	2,574,600
グンゼ	1,200	4,010.00	4,812,000
東洋紡	6,700	1,019.00	6,827,300
ユニチカ	4,700	250.00	1,175,000
富士紡ホールディングス	600	3,490.00	2,094,000
倉敷紡績	1,200	2,245.00	2,694,000
シキボウ	900	976.00	878,400
日本毛織	4,100	992.00	4,067,200
ダイトウボウ	2,500	87.00	217,500
トーア紡コーポレーション	600	360.00	216,000
ダイドーリミテッド	2,200	269.00	591,800
帝国繊維	1,800	1,650.00	2,970,000
帝人	14,900	1,337.00	19,921,300
東レ	104,200	777.60	81,025,920
住江織物	300	1,810.00	543,000
日本フェルト	900	415.00	373,500
イチカワ	200	1,323.00	264,600
日東製網	200	1,397.00	279,400
アツギ	900	389.00	350,100
ダイニック	400	623.00	249,200
セーレン	3,000	2,574.00	7,722,000
ソトー	500	836.00	418,000

東海染工	100	1,118.00	111,800
小松マテーレ	2,200	800.00	1,760,000
ワコールホールディングス	3,000	2,335.00	7,005,000
ホギメディカル	2,100	3,530.00	7,413,000
クラウディアホールディングス	300	283.00	84,900
T S I ホールディングス	5,500	448.00	2,464,000
マツオカコーポレーション	400	1,155.00	462,000
ワールド	2,000	1,282.00	2,564,000
三陽商会	600	1,255.00	753,000
ナイガイ	400	260.00	104,000
オンワードホールディングス	10,100	323.00	3,262,300
ルックホールディングス	400	2,629.00	1,051,600
ゴールドウイン	2,800	9,410.00	26,348,000
デザート	2,700	3,170.00	8,559,000
キング	700	495.00	346,500
ヤマトインターナショナル	1,200	249.00	298,800
特種東海製紙	800	2,814.00	2,251,200
王子ホールディングス	64,800	543.00	35,186,400
日本製紙	8,100	976.00	7,905,600
三菱製紙	1,800	283.00	509,400
北越コーポレーション	9,800	828.00	8,114,400
中越パルプ工業	600	960.00	576,000
巴川製紙所	500	706.00	353,000
大王製紙	6,800	1,077.00	7,323,600
阿波製紙	300	303.00	90,900
レンゴー	14,100	869.00	12,252,900
トーモク	900	1,601.00	1,440,900
ザ・パック	1,200	2,412.00	2,894,400
北の達人コーポレーション	6,500	298.00	1,937,000
クラレ	24,700	1,118.00	27,614,600
旭化成	97,200	1,002.00	97,394,400
共和レザー	1,000	512.00	512,000
昭和電工	15,000	2,259.00	33,885,000
住友化学	115,500	494.00	57,057,000
住友精化	700	4,260.00	2,982,000
日産化学	7,400	6,690.00	49,506,000

ラサ工業	600	2,025.00	1,215,000	
クレハ	1,300	9,030.00	11,739,000	
多木化学	600	4,930.00	2,958,000	
テイカ	1,100	1,235.00	1,358,500	
石原産業	2,800	1,128.00	3,158,400	
片倉コープアグリ	300	1,594.00	478,200	
日本曹達	1,700	4,285.00	7,284,500	
東ソー	20,800	1,630.00	33,904,000	
トクヤマ	5,000	1,867.00	9,335,000	
セントラル硝子	2,500	3,115.00	7,787,500	
東亜合成	8,000	1,140.00	9,120,000	
大阪ソーダ	900	4,290.00	3,861,000	
関東電化工業	3,000	987.00	2,961,000	
デンカ	5,700	3,185.00	18,154,500	
信越化学工業	26,600	17,730.00	471,618,000	
日本カーバイド工業	600	1,278.00	766,800	
堺化学工業	1,200	1,822.00	2,186,400	
第一稀元素化学工業	1,400	1,118.00	1,565,200	
エア・ウォーター	14,700	1,580.00	23,226,000	
日本酸素ホールディングス	15,100	2,158.00	32,585,800	
日本化学工業	500	1,801.00	900,500	
東邦アセチレン	400	1,116.00	446,400	
日本パーカライジング	7,700	964.00	7,422,800	
高压ガス工業	2,300	665.00	1,529,500	
四国化成工業	1,900	1,343.00	2,551,700	
戸田工業	400	2,768.00	1,107,200	
ステラ ケミファ	900	2,561.00	2,304,900	
保土谷化学工業	400	2,971.00	1,188,400	
日本触媒	2,400	5,410.00	12,984,000	
大日精化工業	1,100	1,737.00	1,910,700	
カネカ	3,600	3,410.00	12,276,000	
三菱瓦斯化学	11,600	1,926.00	22,341,600	
三井化学	13,100	3,190.00	41,789,000	
J S R	14,500	2,833.00	41,078,500	
東京応化工業	2,700	6,780.00	18,306,000	
大阪有機化学工業	1,200	2,067.00	2,480,400	

三菱ケミカルグループ	105,000	722.80	75,894,000
KHネオケム	2,600	2,776.00	7,217,600
ダイセル	22,900	1,015.00	23,243,500
住友ベークライト	2,300	4,280.00	9,844,000
積水化学工業	32,300	1,885.00	60,885,500
日本ゼオン	9,300	1,342.00	12,480,600
アイカ工業	3,900	3,235.00	12,616,500
UBE	8,000	1,978.00	15,824,000
積水樹脂	2,300	1,783.00	4,100,900
タキロンシーアイ	3,500	509.00	1,781,500
旭有機材	1,000	2,715.00	2,715,000
ニチバン	1,000	1,739.00	1,739,000
リケンテクノス	3,400	485.00	1,649,000
大倉工業	700	1,998.00	1,398,600
積水化成成品工業	2,200	393.00	864,600
群栄化学工業	400	2,370.00	948,000
タイガースポリマー	700	406.00	284,200
ミライアル	500	1,583.00	791,500
ダイキアクシス	600	710.00	426,000
ダイキョーニシカワ	3,400	571.00	1,941,400
竹本容器	600	757.00	454,200
森六ホールディングス	800	1,733.00	1,386,400
恵和	500	3,355.00	1,677,500
日本化薬	11,900	1,191.00	14,172,900
カーリットホールディングス	1,400	711.00	995,400
日本精化	900	2,361.00	2,124,900
扶桑化学工業	1,500	3,545.00	5,317,500
トリケミカル研究所	2,100	2,278.00	4,783,800
ADEKA	5,400	2,245.00	12,123,000
日油	4,800	5,540.00	26,592,000
新日本理化	2,200	251.00	552,200
ハリマ化成グループ	1,100	849.00	933,900
花王	37,900	5,404.00	204,811,600
第一工業製薬	600	1,941.00	1,164,600
石原ケミカル	700	1,251.00	875,700
日華化学	600	875.00	525,000

ニイタカ	300	2,149.00	644,700
三洋化成工業	1,000	4,160.00	4,160,000
有機合成薬品工業	1,200	305.00	366,000
大日本塗料	1,900	762.00	1,447,800
日本ペイントホールディングス	68,900	1,155.00	79,579,500
関西ペイント	14,300	1,786.00	25,539,800
神東塗料	1,400	129.00	180,600
中国塗料	2,900	994.00	2,882,600
日本特殊塗料	1,000	865.00	865,000
藤倉化成	2,100	413.00	867,300
太陽ホールディングス	2,400	2,458.00	5,899,200
D I C	6,100	2,468.00	15,054,800
サカタインクス	3,500	1,100.00	3,850,000
東洋インキS Cホールディングス	3,100	1,880.00	5,828,000
T & K TOKA	1,400	1,074.00	1,503,600
富士フイルムホールディングス	29,900	7,247.00	216,685,300
資生堂	32,500	6,360.00	206,700,000
ライオン	18,700	1,480.00	27,676,000
高砂香料工業	1,100	2,698.00	2,967,800
マンダム	3,400	1,438.00	4,889,200
ミルボン	2,300	5,610.00	12,903,000
ファンケル	6,800	2,524.00	17,163,200
コーセー	3,200	14,320.00	45,824,000
コタ	1,300	1,735.00	2,255,500
ポーラ・オルビスホールディングス	8,000	1,847.00	14,776,000
ノエビアホールディングス	1,400	5,810.00	8,134,000
アジュバンホールディングス	400	950.00	380,000
新日本製薬	900	1,385.00	1,246,500
エステー	1,200	1,540.00	1,848,000
アグロ カネショウ	600	1,716.00	1,029,600
コニシ	2,600	1,728.00	4,492,800
長谷川香料	3,200	3,120.00	9,984,000
星光PMC	800	544.00	435,200
小林製薬	4,800	8,360.00	40,128,000
荒川化学工業	1,300	1,028.00	1,336,400
メック	1,300	2,358.00	3,065,400

日本高純度化学	400	2,579.00	1,031,600	
タカラバイオ	4,200	1,796.00	7,543,200	
JCU	1,800	3,305.00	5,949,000	
新田ゼラチン	1,000	995.00	995,000	
OATアグリオ	600	1,681.00	1,008,600	
デクセリアルズ	4,500	3,005.00	13,522,500	
アース製薬	1,400	5,240.00	7,336,000	
北興化学工業	1,600	879.00	1,406,400	
大成ラミック	500	3,130.00	1,565,000	
クミアイ化学工業	6,200	1,006.00	6,237,200	
日本農薬	2,800	761.00	2,130,800	
アキレス	1,000	1,293.00	1,293,000	
有沢製作所	2,600	1,339.00	3,481,400	
日東電工	11,300	8,400.00	94,920,000	
レック	2,200	852.00	1,874,400	
三光合成	2,100	459.00	963,900	
きもと	2,400	232.00	556,800	
藤森工業	1,200	3,180.00	3,816,000	
前澤化成工業	1,000	1,389.00	1,389,000	
未来工業	600	1,463.00	877,800	
ウェーブロックホールディングス	500	645.00	322,500	
JSP	1,100	1,491.00	1,640,100	
エフピコ	2,900	3,555.00	10,309,500	
天馬	1,300	2,129.00	2,767,700	
信越ポリマー	2,900	1,224.00	3,549,600	
東リ	3,600	231.00	831,600	
ニフコ	5,600	3,420.00	19,152,000	
バルカー	1,300	2,692.00	3,499,600	
ユニ・チャーム	32,500	5,232.00	170,040,000	
ショーエイコーポレーション	500	552.00	276,000	
協和キリン	18,800	3,100.00	58,280,000	
武田薬品工業	137,900	4,180.00	576,422,000	代用有価証券 10,000株
アステラス製薬	149,400	2,166.00	323,600,400	
住友ファーマ	11,500	1,054.00	12,121,000	
塩野義製薬	19,900	6,995.00	139,200,500	

わかもと製薬	1,600	233.00	372,800	
日本新薬	3,700	8,000.00	29,600,000	
中外製薬	48,800	3,574.00	174,411,200	
科研製薬	2,700	3,915.00	10,570,500	
エーザイ	19,000	9,502.00	180,538,000	
ロート製薬	7,500	4,520.00	33,900,000	
小野薬品工業	30,100	3,431.00	103,273,100	
久光製薬	3,500	3,880.00	13,580,000	
持田製薬	1,800	3,405.00	6,129,000	
参天製薬	29,200	1,125.00	32,850,000	
扶桑薬品工業	500	2,035.00	1,017,500	
日本ケミファ	200	1,690.00	338,000	
ツムラ	4,900	3,010.00	14,749,000	
キッセイ薬品工業	2,400	2,559.00	6,141,600	
生化学工業	3,000	960.00	2,880,000	
栄研化学	2,500	1,852.00	4,630,000	
鳥居薬品	800	2,903.00	2,322,400	
JCRファーマ	5,300	1,830.00	9,699,000	
東和薬品	2,400	2,167.00	5,200,800	
富士製薬工業	1,000	1,003.00	1,003,000	
ゼリア新薬工業	2,200	2,302.00	5,064,400	
第一三共	135,800	4,506.00	611,914,800	
キョーリン製薬ホールディングス	3,300	1,746.00	5,761,800	
大幸薬品	2,800	456.00	1,276,800	
ダイト	1,200	2,504.00	3,004,800	
大塚ホールディングス	35,700	4,590.00	163,863,000	
大正製薬ホールディングス	3,500	5,560.00	19,460,000	
ペプチドリーム	7,500	1,745.00	13,087,500	
あすか製薬ホールディングス	1,500	1,259.00	1,888,500	
サワイグループホールディングス	3,500	4,095.00	14,332,500	
日本コークス工業	14,100	89.00	1,254,900	
ニチレキ	1,800	1,257.00	2,262,600	
ユシロ化学工業	800	803.00	642,400	
ビーピー・カストロール	600	935.00	561,000	
富士石油	3,200	259.00	828,800	
MORESCO	500	1,157.00	578,500	

出光興産	17,300	3,140.00	54,322,000
E N E O Sホールディングス	281,900	458.90	129,363,910
コスモエネルギーホールディングス	5,900	3,820.00	22,538,000
横浜ゴム	8,900	2,170.00	19,313,000
TOYO TIRE	8,900	1,580.00	14,062,000
ブリヂストン	49,800	5,000.00	249,000,000
住友ゴム工業	15,300	1,197.00	18,314,100
藤倉コンポジット	1,000	845.00	845,000
オカモト	900	3,735.00	3,361,500
フコク	800	1,086.00	868,800
ニッタ	1,600	2,930.00	4,688,000
住友理工	3,000	586.00	1,758,000
三ツ星ベルト	2,300	3,445.00	7,923,500
バンドー化学	2,400	1,002.00	2,404,800
日東紡績	1,900	2,026.00	3,849,400
A G C	15,900	4,650.00	73,935,000
日本板硝子	7,900	631.00	4,984,900
石塚硝子	200	1,459.00	291,800
日本山村硝子	600	566.00	339,600
日本電気硝子	6,300	2,526.00	15,913,800
オハラ	700	1,240.00	868,000
住友大阪セメント	2,200	3,150.00	6,930,000
太平洋セメント	9,900	2,073.00	20,522,700
日本ヒューム	1,300	654.00	850,200
日本コンクリート工業	3,000	229.00	687,000
三谷セキサン	700	4,030.00	2,821,000
アジアパイルホールディングス	2,400	551.00	1,322,400
東海カーボン	13,000	1,158.00	15,054,000
日本カーボン	900	4,435.00	3,991,500
東洋炭素	1,000	3,985.00	3,985,000
ノリタケカンパニーリミテド	800	4,035.00	3,228,000
TOTO	10,300	4,870.00	50,161,000
日本碍子	18,400	1,793.00	32,991,200
日本特殊陶業	11,800	2,604.00	30,727,200
ダントーホールディングス	1,000	247.00	247,000
MARUWA	600	17,320.00	10,392,000

品川リフラクトリーズ	400	3,960.00	1,584,000
黒崎播磨	300	4,970.00	1,491,000
ヨータイ	1,000	1,427.00	1,427,000
東京窯業	1,500	268.00	402,000
ニッカトー	700	486.00	340,200
フジミインコーポレーテッド	1,200	7,380.00	8,856,000
クニミネ工業	500	859.00	429,500
エーアンドエーマテリアル	300	881.00	264,300
ニチアス	3,900	2,421.00	9,441,900
ニチハ	2,000	2,755.00	5,510,000
日本製鉄	71,800	2,291.00	164,493,800
神戸製鋼所	32,300	636.00	20,542,800
合同製鐵	800	2,046.00	1,636,800
JFEホールディングス	42,900	1,595.00	68,425,500
東京製鐵	4,600	1,268.00	5,832,800
共英製鋼	1,900	1,266.00	2,405,400
大和工業	2,700	4,675.00	12,622,500
東京鐵鋼	800	1,401.00	1,120,800
大阪製鐵	800	1,104.00	883,200
淀川製鋼所	1,900	2,572.00	4,886,800
丸一鋼管	4,900	2,815.00	13,793,500
モリ工業	400	2,846.00	1,138,400
大同特殊鋼	2,000	4,355.00	8,710,000
日本高周波鋼業	800	315.00	252,000
日本冶金工業	1,200	4,415.00	5,298,000
山陽特殊製鋼	1,600	2,258.00	3,612,800
愛知製鋼	1,000	2,231.00	2,231,000
日本金属	500	955.00	477,500
大平洋金属	1,200	2,039.00	2,446,800
新日本電工	10,500	390.00	4,095,000
栗本鐵工所	800	1,758.00	1,406,400
虹技	300	932.00	279,600
日本鑄鐵管	200	929.00	185,800
三菱製鋼	1,100	1,026.00	1,128,600
日亜鋼業	2,100	246.00	516,600
日本精線	200	4,285.00	857,000

エンビプロ・ホールディングス	1,200	804.00	964,800
シンニッタン	2,200	223.00	490,600
新家工業	400	2,246.00	898,400
大紀アルミニウム工業所	2,300	1,325.00	3,047,500
日本軽金属ホールディングス	4,300	1,547.00	6,652,100
三井金属鉱業	4,700	3,195.00	15,016,500
東邦亜鉛	1,000	2,214.00	2,214,000
三菱マテリアル	10,700	2,229.00	23,850,300
住友金属鉱山	18,600	4,874.00	90,656,400
DOWAホールディングス	3,600	4,365.00	15,714,000
古河機械金属	2,400	1,316.00	3,158,400
エス・サイエンス	10,700	26.00	278,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,400	4,355.00	10,452,000
東邦チタニウム	2,900	3,220.00	9,338,000
UACJ	2,300	2,295.00	5,278,500
CKサンエツ	400	4,070.00	1,628,000
古河電気工業	5,400	2,629.00	14,196,600
住友電気工業	55,400	1,593.00	88,252,200
フジクラ	17,300	1,156.00	19,998,800
昭和電線ホールディングス	1,800	1,819.00	3,274,200
タツタ電線	3,300	429.00	1,415,700
カナレ電気	300	1,496.00	448,800
平河ヒューテック	900	1,164.00	1,047,600
リョービ	1,700	1,233.00	2,096,100
アーレスティ	1,900	440.00	836,000
アサヒホールディングス	6,500	2,035.00	13,227,500
稲葉製作所	1,000	1,405.00	1,405,000
宮地エンジニアリンググループ	400	3,495.00	1,398,000
トーカロ	4,400	1,208.00	5,315,200
アルファC o	600	949.00	569,400
SUMCO	30,500	2,017.00	61,518,500
川田テクノロジーズ	400	3,370.00	1,348,000
RS Technologies	500	8,240.00	4,120,000
ジェイテックコーポレーション	200	2,505.00	501,000
信和	900	783.00	704,700
東洋製罐グループホールディングス	10,600	1,618.00	17,150,800

ホッカホールディングス	900	1,323.00	1,190,700
コロナ	900	873.00	785,700
横河ブリッジホールディングス	2,100	1,888.00	3,964,800
駒井ハルテック	300	1,593.00	477,900
高田機工	100	2,438.00	243,800
三和ホールディングス	14,800	1,260.00	18,648,000
文化シャッター	4,600	1,103.00	5,073,800
三協立山	2,200	553.00	1,216,600
アルインコ	1,200	1,024.00	1,228,800
東洋シャッター	400	510.00	204,000
L I X I L	23,300	2,042.00	47,578,600
日本ファイルコン	1,100	454.00	499,400
ノーリツ	2,400	1,506.00	3,614,400
長府製作所	1,600	1,989.00	3,182,400
リンナイ	2,900	10,020.00	29,058,000
ダイニチ工業	800	667.00	533,600
日東精工	2,300	527.00	1,212,100
三洋工業	200	1,782.00	356,400
岡部	2,600	723.00	1,879,800
ジーテクト	1,800	1,492.00	2,685,600
東プレ	2,800	1,202.00	3,365,600
高周波熱錬	2,700	694.00	1,873,800
東京製綱	1,000	867.00	867,000
サンコール	1,400	633.00	886,200
モリテック スチール	1,300	238.00	309,400
パイオラックス	2,200	1,699.00	3,737,800
エイチワン	1,700	630.00	1,071,000
日本発條	14,200	885.00	12,567,000
中央発條	900	725.00	652,500
アドバネクス	200	1,137.00	227,400
立川ブラインド工業	700	1,169.00	818,300
三益半導体工業	1,500	2,570.00	3,855,000
日本ドライケミカル	400	1,542.00	616,800
日本製鋼所	4,300	2,882.00	12,392,600
三浦工業	6,600	3,195.00	21,087,000
タクマ	4,800	1,279.00	6,139,200

ツガミ	3,500	1,250.00	4,375,000
オークマ	1,600	5,110.00	8,176,000
芝浦機械	1,800	2,586.00	4,654,800
アマダ	25,100	1,087.00	27,283,700
アイダエンジニアリング	3,300	828.00	2,732,400
TAKISAWA	400	1,081.00	432,400
FUJI	6,800	2,068.00	14,062,400
牧野フライス製作所	1,700	4,585.00	7,794,500
オーエスジー	7,500	1,952.00	14,640,000
ダイジェット工業	200	832.00	166,400
旭ダイヤモンド工業	4,500	703.00	3,163,500
DMG森精機	9,500	1,834.00	17,423,000
ソディック	4,300	756.00	3,250,800
ディスコ	2,500	40,850.00	102,125,000
日東工器	800	1,533.00	1,226,400
日進工具	1,300	1,085.00	1,410,500
パンチ工業	1,400	414.00	579,600
富士ダイス	800	600.00	480,000
豊和工業	900	963.00	866,700
ニデックオーケーケー	600	1,030.00	618,000
東洋機械金属	1,100	551.00	606,100
島精機製作所	2,500	1,999.00	4,997,500
オプトラン	2,300	2,436.00	5,602,800
NCホールディングス	300	2,077.00	623,100
イワキポンプ	1,100	1,260.00	1,386,000
フリー	1,600	1,176.00	1,881,600
ヤマシンフィルタ	3,700	501.00	1,853,700
日阪製作所	1,500	822.00	1,233,000
やまびこ	2,600	1,144.00	2,974,400
野村マイクロ・サイエンス	500	4,855.00	2,427,500
平田機工	800	5,610.00	4,488,000
ペガサスミシン製造	1,800	914.00	1,645,200
マルマエ	800	1,764.00	1,411,200
タツモ	900	1,704.00	1,533,600
ナブテスコ	9,900	3,500.00	34,650,000
三井海洋開発	2,000	1,456.00	2,912,000

レオン自動機	1,600	1,114.00	1,782,400
SMC	5,100	61,560.00	313,956,000
ホソカワミクロン	1,200	2,841.00	3,409,200
ユニオンツール	700	3,465.00	2,425,500
オイレス工業	2,200	1,485.00	3,267,000
日精エー・エス・ビー機械	700	4,800.00	3,360,000
サトーホールディングス	2,200	1,908.00	4,197,600
技研製作所	1,600	3,115.00	4,984,000
日本エアータック	800	1,263.00	1,010,400
カワタ	500	844.00	422,000
日精樹脂工業	1,200	990.00	1,188,000
オカダアイヨン	500	1,600.00	800,000
ワイエイシイホールディングス	700	1,647.00	1,152,900
小松製作所	73,600	3,121.00	229,705,600
住友重機械工業	9,300	2,903.00	26,997,900
日立建機	6,200	3,165.00	19,623,000
日工	2,300	615.00	1,414,500
巴工業	700	2,392.00	1,674,400
井関農機	1,500	1,237.00	1,855,500
TOWA	1,600	1,940.00	3,104,000
丸山製作所	300	1,559.00	467,700
北川鉄工所	600	1,213.00	727,800
ローツェ	800	8,230.00	6,584,000
タカキタ	500	469.00	234,500
クボタ	83,100	1,999.00	166,116,900
荏原実業	800	2,342.00	1,873,600
三菱化工機	500	2,086.00	1,043,000
月島機械	2,100	1,000.00	2,100,000
帝国電機製作所	1,200	2,283.00	2,739,600
新東工業	3,200	666.00	2,131,200
澁谷工業	1,500	2,465.00	3,697,500
アイチ コーポレーション	2,300	773.00	1,777,900
小森コーポレーション	3,600	842.00	3,031,200
鶴見製作所	1,200	2,000.00	2,400,000
住友精密工業	200	3,645.00	729,000
酒井重工業	300	3,525.00	1,057,500

荏原製作所	6,400	5,170.00	33,088,000
石井鐵工所	200	2,430.00	486,000
西島製作所	1,400	1,573.00	2,202,200
北越工業	1,600	1,186.00	1,897,600
ダイキン工業	18,700	22,535.00	421,404,500
オルガノ	2,200	3,145.00	6,919,000
トーヨーカネツ	600	2,534.00	1,520,400
栗田工業	8,800	5,880.00	51,744,000
椿本チエイン	2,200	3,025.00	6,655,000
大同工業	700	757.00	529,900
木村化工機	1,200	731.00	877,200
アネスト岩田	2,700	903.00	2,438,100
ダイフク	8,100	6,930.00	56,133,000
サムコ	500	3,870.00	1,935,000
加藤製作所	800	756.00	604,800
油研工業	200	1,825.00	365,000
タダノ	8,300	971.00	8,059,300
フジテック	5,700	3,250.00	18,525,000
CKD	4,300	2,024.00	8,703,200
キトー	500	2,720.00	1,360,000
平和	5,200	2,440.00	12,688,000
理想科学工業	1,400	2,169.00	3,036,600
SANKYO	3,100	5,290.00	16,399,000
日本金銭機械	1,700	1,126.00	1,914,200
マースグループホールディングス	900	2,396.00	2,156,400
フクシマガリレイ	1,200	4,295.00	5,154,000
オーイズミ	600	437.00	262,200
ダイコク電機	900	1,910.00	1,719,000
竹内製作所	2,800	3,050.00	8,540,000
アマノ	4,500	2,432.00	10,944,000
JUKI	2,500	688.00	1,720,000
サンデン	2,500	209.00	522,500
ジャノメ	1,600	607.00	971,200
マックス	1,900	2,024.00	3,845,600
グローリー	4,100	2,200.00	9,020,000
新晃工業	1,600	1,468.00	2,348,800

大和冷機工業	2,400	1,169.00	2,805,600
セガサミーホールディングス	12,600	1,941.00	24,456,600
日本ピストンリング	500	1,220.00	610,000
リケン	600	2,261.00	1,356,600
T P R	1,800	1,232.00	2,217,600
ツバキ・ナカシマ	3,900	1,039.00	4,052,100
ホシザキ	10,100	4,620.00	46,662,000
大豊工業	1,400	667.00	933,800
日本精工	28,800	725.00	20,880,000
N T N	30,900	288.00	8,899,200
ジェイテクト	14,000	967.00	13,538,000
不二越	1,200	3,875.00	4,650,000
日本トムソン	3,800	582.00	2,211,600
T H K	9,100	2,663.00	24,233,300
ユーシン精機	1,200	678.00	813,600
前澤給装工業	1,100	965.00	1,061,500
イーグル工業	1,700	1,072.00	1,822,400
前澤工業	1,000	610.00	610,000
日本ピラー工業	1,500	2,914.00	4,371,000
キット	5,800	829.00	4,808,200
マキタ	19,500	3,180.00	62,010,000
三井E & Sホールディングス	7,100	399.00	2,832,900
日立造船	12,900	865.00	11,158,500
三菱重工業	27,500	5,676.00	156,090,000
I H I	9,900	4,070.00	40,293,000
サノヤスホールディングス	2,100	127.00	266,700
スター精密	3,000	1,718.00	5,154,000
日清紡ホールディングス	12,700	994.00	12,623,800
イビデン	9,000	5,440.00	48,960,000
コニカミノルタ	35,000	549.00	19,215,000
ブラザー工業	21,000	2,131.00	44,751,000
ミネベアミツミ	27,300	2,247.00	61,343,100
日立製作所	78,800	7,218.00	568,778,400
東芝	30,200	4,652.00	140,490,400
三菱電機	162,300	1,368.00	222,026,400
富士電機	9,500	5,520.00	52,440,000

東洋電機製造	600	868.00	520,800
安川電機	18,600	4,590.00	85,374,000
シンフォニアテクノロジー	1,700	1,501.00	2,551,700
明電舎	2,400	1,966.00	4,718,400
オリジン	400	1,277.00	510,800
山洋電気	700	6,110.00	4,277,000
デンヨー	1,200	1,526.00	1,831,200
PHCホールディングス	2,200	1,564.00	3,440,800
ソシオネクスト	1,600	6,660.00	10,656,000
東芝テック	2,300	3,545.00	8,153,500
芝浦メカトロニクス	300	11,150.00	3,345,000
マブチモーター	3,900	3,925.00	15,307,500
日本電産	38,100	8,048.00	306,628,800
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,200	498.00	597,600
トレックス・セミコンダクター	800	2,880.00	2,304,000
東光高岳	1,000	1,805.00	1,805,000
ダブル・スコープ	5,100	1,604.00	8,180,400
ダイヘン	1,400	4,075.00	5,705,000
ヤーマン	3,000	1,438.00	4,314,000
JVCケンウッド	14,300	397.00	5,677,100
ミマキエンジニアリング	1,400	647.00	905,800
I-PEX	900	1,280.00	1,152,000
日新電機	3,800	1,313.00	4,989,400
大崎電気工業	3,600	544.00	1,958,400
オムロン	14,400	6,880.00	99,072,000
日東工業	2,100	2,314.00	4,859,400
I D E C	2,300	3,215.00	7,394,500
正興電機製作所	600	1,017.00	610,200
不二電機工業	300	1,147.00	344,100
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,100	2,138.00	10,903,800
サクサホールディングス	300	1,254.00	376,200
メルコホールディングス	400	3,100.00	1,240,000
テクノメディカ	400	1,723.00	689,200
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	500	1,511.00	755,500
日本電気	22,200	4,710.00	104,562,000
富士通	15,600	18,250.00	284,700,000

沖電気工業	7,100	713.00	5,062,300	
岩崎通信機	700	789.00	552,300	
電気興業	800	2,038.00	1,630,400	
サンケン電気	1,500	6,980.00	10,470,000	
ナカヨ	200	1,112.00	222,400	
アイホン	1,000	1,885.00	1,885,000	
ルネサスエレクトロニクス	102,400	1,303.00	133,427,200	
セイコーエプソン	20,900	2,093.00	43,743,700	
ワコム	12,400	629.00	7,799,600	
アルバック	3,700	6,070.00	22,459,000	
アクセル	600	1,570.00	942,000	
E I Z O	1,100	3,420.00	3,762,000	
日本信号	3,600	1,039.00	3,740,400	
京三製作所	3,300	414.00	1,366,200	
能美防災	2,100	1,570.00	3,297,000	
ホーチキ	1,200	1,423.00	1,707,600	
星和電機	600	457.00	274,200	
エレコム	3,800	1,419.00	5,392,200	
パナソニック ホールディングス	185,500	1,236.50	229,370,750	
シャープ	18,900	1,005.00	18,994,500	
アンリツ	11,000	1,419.00	15,609,000	
富士通ゼネラル	4,400	3,185.00	14,014,000	
ソニーグループ	109,900	11,045.00	1,213,845,500	代用有価証券 35,000株
TDK	24,900	4,760.00	118,524,000	
帝国通信工業	700	1,407.00	984,900	
タムラ製作所	6,700	826.00	5,534,200	
アルプスアルパイン	14,000	1,298.00	18,172,000	
池上通信機	400	542.00	216,800	
日本電波工業	1,900	1,829.00	3,475,100	
鈴木	900	899.00	809,100	
メイコー	1,700	2,945.00	5,006,500	
日本トリム	300	2,462.00	738,600	
ローランド ディー. ジー.	900	3,065.00	2,758,500	
フォスター電機	1,500	905.00	1,357,500	
SMK	400	2,403.00	961,200	

ヨコオ	1,200	2,436.00	2,923,200
ホシデン	3,800	1,608.00	6,110,400
ヒロセ電機	2,600	17,940.00	46,644,000
日本航空電子工業	3,200	2,272.00	7,270,400
TOA	1,800	789.00	1,420,200
マクセル	3,400	1,422.00	4,834,800
古野電気	2,000	1,016.00	2,032,000
スミダコーポレーション	1,400	1,500.00	2,100,000
アイコム	600	2,775.00	1,665,000
リオン	600	1,925.00	1,155,000
横河電機	17,200	2,490.00	42,828,000
新電元工業	600	3,195.00	1,917,000
アズビル	10,900	3,775.00	41,147,500
東亜ディーケーケー	800	827.00	661,600
日本光電工業	7,200	3,210.00	23,112,000
チノー	600	1,761.00	1,056,600
共和電業	1,600	369.00	590,400
日本電子材料	1,000	1,494.00	1,494,000
堀場製作所	3,500	6,220.00	21,770,000
アドバンテスト	12,200	9,840.00	120,048,000
小野測器	500	398.00	199,000
エスベック	1,200	1,933.00	2,319,600
キーエンス	15,600	56,340.00	878,904,000
日置電機	800	6,670.00	5,336,000
シスメックス	13,400	8,766.00	117,464,400
日本マイクロニクス	2,600	1,444.00	3,754,400
メガチップス	1,300	2,626.00	3,413,800
OBARA GROUP	700	3,540.00	2,478,000
澤藤電機	200	1,179.00	235,800
原田工業	700	844.00	590,800
コーセル	2,100	912.00	1,915,200
イリソ電子工業	1,400	4,585.00	6,419,000
オブテックスグループ	2,900	1,998.00	5,794,200
千代田インテグレ	600	2,378.00	1,426,800
レーザーテック	7,700	26,635.00	205,089,500
スタンレー電気	11,100	2,718.00	30,169,800

岩崎電気	500	2,438.00	1,219,000	
ウシオ電機	8,100	1,784.00	14,450,400	
岡谷電機産業	1,300	270.00	351,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,500	432.00	648,000	
エノモト	400	1,858.00	743,200	
日本セラミック	1,600	2,588.00	4,140,800	
遠藤照明	700	735.00	514,500	
古河電池	1,100	1,137.00	1,250,700	
双信電機	600	405.00	243,000	
山一電機	1,400	1,796.00	2,514,400	
図研	1,300	3,095.00	4,023,500	
日本電子	3,900	4,185.00	16,321,500	
カシオ計算機	11,500	1,353.00	15,559,500	
ファナック	15,300	20,860.00	319,158,000	
日本シイエムケイ	3,200	533.00	1,705,600	
エンプラス	400	4,280.00	1,712,000	
大真空	1,900	776.00	1,474,400	
ローム	7,200	10,710.00	77,112,000	
浜松ホトニクス	12,500	7,060.00	88,250,000	
三井ハイテック	1,600	7,060.00	11,296,000	
新光電気工業	5,500	3,760.00	20,680,000	
京セラ	24,200	6,968.00	168,625,600	
太陽誘電	7,600	4,320.00	32,832,000	
村田製作所	47,100	7,326.00	345,054,600	
双葉電子工業	2,900	567.00	1,644,300	
北陸電気工業	600	1,274.00	764,400	
ニチコン	3,200	1,341.00	4,291,200	
日本ケミコン	1,500	1,733.00	2,599,500	
KOA	2,400	2,054.00	4,929,600	
市光工業	2,200	394.00	866,800	
小糸製作所	18,700	2,032.00	37,998,400	
ミツバ	2,900	478.00	1,386,200	
SCREENホールディングス	2,700	9,270.00	25,029,000	
キヤノン電子	1,700	1,577.00	2,680,900	
キヤノン	85,300	3,098.00	264,259,400	代用有価証券 10,000株

リコー	39,000	1,063.00	41,457,000
象印マホービン	4,600	1,726.00	7,939,600
MUTOHホールディングス	200	1,748.00	349,600
東京エレクトロン	11,000	45,830.00	504,130,000
イノテック	1,000	1,290.00	1,290,000
トヨタ紡織	6,500	1,832.00	11,908,000
芦森工業	300	1,230.00	369,000
ユニプレス	2,800	811.00	2,270,800
豊田自動織機	11,400	7,750.00	88,350,000
モリタホールディングス	2,700	1,147.00	3,096,900
三櫻工業	2,400	648.00	1,555,200
デンソー	32,100	7,312.00	234,715,200
東海理化電機製作所	4,400	1,479.00	6,507,600
川崎重工業	11,700	3,245.00	37,966,500
名村造船所	3,900	423.00	1,649,700
日本車輛製造	600	1,954.00	1,172,400
三菱ロジスネクスト	2,500	851.00	2,127,500
近畿車輛	200	1,065.00	213,000
日産自動車	220,800	464.30	102,517,440
いすゞ自動車	45,200	1,713.00	77,427,600
トヨタ自動車	853,400	1,978.50	1,688,451,900
日野自動車	20,000	586.00	11,720,000
三菱自動車工業	60,600	598.00	36,238,800
エフテック	1,100	534.00	587,400
レシップホールディングス	600	485.00	291,000
GMB	300	764.00	229,200
ファルテック	200	602.00	120,400
武蔵精密工業	3,800	1,686.00	6,406,800
日産車体	2,800	825.00	2,310,000
新明和工業	4,900	1,067.00	5,228,300
極東開発工業	2,800	1,379.00	3,861,200
トピー工業	1,200	1,651.00	1,981,200
ティラド	400	2,545.00	1,018,000
タチエス	2,500	1,094.00	2,735,000
NOK	6,000	1,234.00	7,404,000
フタバ産業	4,300	360.00	1,548,000

K Y B	1,500	3,390.00	5,085,000
大同メタル工業	3,100	488.00	1,512,800
プレス工業	7,000	433.00	3,031,000
ミクニ	1,700	342.00	581,400
太平洋工業	3,600	1,090.00	3,924,000
河西工業	2,300	151.00	347,300
アイシン	12,000	3,655.00	43,860,000
マツダ	51,400	1,090.00	56,026,000
今仙電機製作所	1,100	686.00	754,600
本田技研工業	126,300	3,300.00	416,790,000
スズキ	28,500	4,724.00	134,634,000
S U B A R U	49,200	2,268.50	111,610,200
安永	700	747.00	522,900
ヤマハ発動機	24,400	3,315.00	80,886,000
T B K	1,700	251.00	426,700
エクセディ	2,600	1,623.00	4,219,800
豊田合成	4,500	2,148.00	9,666,000
愛三工業	2,500	704.00	1,760,000
盟和産業	200	942.00	188,400
日本プラスト	1,200	426.00	511,200
ヨロズ	1,500	749.00	1,123,500
エフ・シー・シー	2,800	1,378.00	3,858,400
シマノ	6,400	22,560.00	144,384,000
テイ・エス テック	7,100	1,598.00	11,345,800
ジャムコ	900	1,678.00	1,510,200
テルモ	48,600	4,027.00	195,712,200
クリエートメディック	500	915.00	457,500
日機装	3,800	1,004.00	3,815,200
日本エム・ディ・エム	900	962.00	865,800
島津製作所	18,900	4,035.00	76,261,500
J M S	1,400	524.00	733,600
長野計器	1,100	1,135.00	1,248,500
ブイ・テクノロジー	800	2,700.00	2,160,000
東京計器	1,200	1,315.00	1,578,000
愛知時計電機	600	1,342.00	805,200
インターアクション	900	1,551.00	1,395,900

オーバル	1,300	501.00	651,300
東京精密	3,400	4,505.00	15,317,000
マニー	6,800	2,263.00	15,388,400
ニコン	24,100	1,270.00	30,607,000
トプコン	8,200	1,597.00	13,095,400
オリンパス	97,200	2,643.00	256,899,600
理研計器	1,000	4,970.00	4,970,000
タムロン	1,200	3,425.00	4,110,000
HOYA	33,600	14,095.00	473,592,000
シード	700	497.00	347,900
ノーリツ鋼機	1,500	2,805.00	4,207,500
A&Dホロンホールディングス	2,300	1,096.00	2,520,800
朝日インテック	20,500	2,441.00	50,040,500
シチズン時計	17,000	588.00	9,996,000
リズム	500	1,714.00	857,000
大研医器	1,100	456.00	501,600
メニコン	5,300	2,941.00	15,587,300
シンシア	100	558.00	55,800
松風	700	2,401.00	1,680,700
セイコーグループ	2,400	3,100.00	7,440,000
ニプロ	12,900	1,037.00	13,377,300
KYORITSU	2,300	124.00	285,200
中本パックス	500	1,597.00	798,500
スノーピーク	2,700	2,319.00	6,261,300
パラマウントベッドホールディングス	3,600	2,577.00	9,277,200
トランザクション	1,200	1,246.00	1,495,200
粧美堂	400	360.00	144,000
ニホンフラッシュ	1,500	900.00	1,350,000
前田工織	1,700	3,105.00	5,278,500
永大産業	1,700	226.00	384,200
アートネイチャー	1,600	778.00	1,244,800
バンダイナムコホールディングス	14,200	8,867.00	125,911,400
アイフィスジャパン	400	615.00	246,000
SHOEI	1,600	5,490.00	8,784,000
フランスベッドホールディングス	2,000	940.00	1,880,000
パイロットコーポレーション	2,400	4,895.00	11,748,000

萩原工業	1,000	1,220.00	1,220,000
フジシールインターナショナル	3,200	1,816.00	5,811,200
タカラトミー	7,200	1,301.00	9,367,200
広済堂ホールディングス	1,100	2,136.00	2,349,600
エステールホールディングス	400	652.00	260,800
タカノ	600	680.00	408,000
プロネクサス	1,300	959.00	1,246,700
ホクシン	1,200	158.00	189,600
ウッドワン	500	908.00	454,000
大建工業	900	2,132.00	1,918,800
凸版印刷	20,300	2,097.00	42,569,100
大日本印刷	18,400	2,767.00	50,912,800
共同印刷	400	2,802.00	1,120,800
N I S S H A	3,000	1,926.00	5,778,000
光村印刷	100	1,185.00	118,500
TAKARA & COMPANY	1,100	2,152.00	2,367,200
アシックス	14,300	3,075.00	43,972,500
ツツミ	400	1,952.00	780,800
ローランド	1,200	3,885.00	4,662,000
小松ウオール工業	600	1,826.00	1,095,600
ヤマハ	9,800	5,430.00	53,214,000
河合楽器製作所	400	2,591.00	1,036,400
クリナップ	1,700	676.00	1,149,200
ピジョン	9,900	2,209.00	21,869,100
兼松サステック	100	1,571.00	157,100
キングジム	1,400	900.00	1,260,000
リンテック	3,100	2,227.00	6,903,700
イトーキ	3,200	581.00	1,859,200
任天堂	98,100	5,718.00	560,935,800
三菱鉛筆	2,200	1,407.00	3,095,400
タカラスタンダード	3,000	1,353.00	4,059,000
コクヨ	7,500	1,837.00	13,777,500
ナカバヤシ	1,700	492.00	836,400
グローブライド	1,300	2,651.00	3,446,300
オカムラ	4,700	1,385.00	6,509,500
美津濃	1,500	2,907.00	4,360,500

東京電力ホールディングス	140,000	512.00	71,680,000	
中部電力	57,200	1,304.00	74,588,800	
関西電力	60,000	1,176.00	70,560,000	
中国電力	24,700	649.00	16,030,300	
北陸電力	14,600	541.00	7,898,600	
東北電力	37,900	672.00	25,468,800	
四国電力	13,300	732.00	9,735,600	
九州電力	35,800	699.00	25,024,200	
北海道電力	15,000	448.00	6,720,000	
沖縄電力	3,700	1,016.00	3,759,200	
電源開発	11,700	2,120.00	24,804,000	
エフオン	1,200	526.00	631,200	
イーレックス	2,800	2,462.00	6,893,600	
レノバ	4,100	2,655.00	10,885,500	
東京瓦斯	32,800	2,614.00	85,739,200	
大阪瓦斯	31,500	2,145.00	67,567,500	
東邦瓦斯	6,100	2,636.00	16,079,600	
北海道瓦斯	900	1,652.00	1,486,800	
広島ガス	3,300	341.00	1,125,300	
西部ガスホールディングス	1,500	1,689.00	2,533,500	
静岡ガス	3,600	1,100.00	3,960,000	
メタウォーター	2,000	1,760.00	3,520,000	
SBSホールディングス	1,400	2,913.00	4,078,200	
東武鉄道	17,100	3,220.00	55,062,000	
相鉄ホールディングス	5,100	2,192.00	11,179,200	
東急	43,600	1,731.00	75,471,600	
京浜急行電鉄	17,600	1,359.00	23,918,400	
小田急電鉄	23,500	1,747.00	41,054,500	
京王電鉄	8,200	4,970.00	40,754,000	
京成電鉄	10,000	3,885.00	38,850,000	
富士急行	1,900	4,925.00	9,357,500	
東日本旅客鉄道	26,400	7,777.00	205,312,800	
西日本旅客鉄道	19,900	5,839.00	116,196,100	
東海旅客鉄道	12,000	16,585.00	199,020,000	
西武ホールディングス	18,800	1,424.00	26,771,200	
鴻池運輸	2,700	1,597.00	4,311,900	

西日本鉄道	4,100	2,638.00	10,815,800
ハマキョウレックス	1,200	3,360.00	4,032,000
サカイ引越センター	700	4,520.00	3,164,000
近鉄グループホールディングス	15,500	4,575.00	70,912,500
阪急阪神ホールディングス	20,700	4,145.00	85,801,500
南海電気鉄道	7,400	2,912.00	21,548,800
京阪ホールディングス	6,400	3,535.00	22,624,000
神戸電鉄	400	3,195.00	1,278,000
名古屋鉄道	17,100	2,224.00	38,030,400
山陽電気鉄道	1,200	2,126.00	2,551,200
アルプス物流	1,300	1,160.00	1,508,000
ヤマトホールディングス	19,800	2,343.00	46,391,400
山九	3,900	4,945.00	19,285,500
丸運	800	218.00	174,400
丸全昭和運輸	1,000	3,130.00	3,130,000
センコーグループホールディングス	8,200	995.00	8,159,000
トナミホールディングス	300	3,710.00	1,113,000
ニッコンホールディングス	5,000	2,426.00	12,130,000
日本石油輸送	200	2,210.00	442,000
福山通運	1,300	3,405.00	4,426,500
セイノーホールディングス	9,600	1,218.00	11,692,800
エスライン	500	825.00	412,500
神奈川中央交通	400	3,315.00	1,326,000
日立物流	3,400	8,900.00	30,260,000
AZ-COM丸和ホールディングス	3,800	1,578.00	5,996,400
C&Fロジホールディングス	1,500	1,199.00	1,798,500
九州旅客鉄道	11,000	2,981.00	32,791,000
SGホールディングス	29,800	2,034.00	60,613,200
NIPPON EXPRESSホールディングス	5,800	8,010.00	46,458,000
日本郵船	41,600	3,201.00	133,161,600
商船三井	27,400	3,405.00	93,297,000
川崎汽船	13,300	2,632.00	35,005,600
NSユニテッド海運	900	3,915.00	3,523,500
飯野海運	5,900	958.00	5,652,200
乾汽船	2,100	2,003.00	4,206,300

日本航空	38,100	2,737.00	104,279,700
ANAホールディングス	42,200	2,891.00	122,000,200
パスコ	300	1,377.00	413,100
トランコム	400	7,800.00	3,120,000
日新	1,200	2,066.00	2,479,200
三菱倉庫	3,300	3,230.00	10,659,000
三井倉庫ホールディングス	1,500	3,645.00	5,467,500
住友倉庫	4,300	1,989.00	8,552,700
澁澤倉庫	600	2,079.00	1,247,400
東陽倉庫	2,100	258.00	541,800
日本トランスシティ	3,200	517.00	1,654,400
ケイヒン	300	1,498.00	449,400
中央倉庫	800	945.00	756,000
川西倉庫	300	1,011.00	303,300
安田倉庫	1,000	933.00	933,000
ファイズホールディングス	300	957.00	287,100
東洋埠頭	500	1,323.00	661,500
上組	7,700	2,752.00	21,190,400
サンリツ	300	711.00	213,300
キムラユニティー	800	771.00	616,800
キューソー流通システム	900	1,007.00	906,300
東海運	900	282.00	253,800
エーアイテイナー	1,000	1,432.00	1,432,000
内外トランスライン	600	2,263.00	1,357,800
日本コンセプト	500	1,648.00	824,000
NEC ネットエスアイ	5,200	1,620.00	8,424,000
クロスキャット	900	1,543.00	1,388,700
システナ	26,200	429.00	11,239,800
デジタルアーツ	1,000	6,240.00	6,240,000
日鉄ソリューションズ	2,700	3,250.00	8,775,000
キューブシステム	900	1,113.00	1,001,700
コア	700	1,462.00	1,023,400
手間いらず	300	5,010.00	1,503,000
ラクーンホールディングス	1,500	1,155.00	1,732,500
ソリトンシステムズ	800	1,057.00	845,600
ソフトクリエイトホールディングス	700	3,245.00	2,271,500

T I S	17,500	3,725.00	65,187,500
J N Sホールディングス	700	338.00	236,600
グリー	8,300	729.00	6,050,700
GMOペパボ	200	1,950.00	390,000
コーエーテクモホールディングス	9,800	2,333.00	22,863,400
三菱総合研究所	800	4,860.00	3,888,000
ボルテージ	500	326.00	163,000
電算	200	1,612.00	322,400
A G S	700	712.00	498,400
ファインデックス	1,300	530.00	689,000
ブレインパッド	1,600	857.00	1,371,200
K L a b	3,100	429.00	1,329,900
ポールトゥウィンホールディングス	2,700	846.00	2,284,200
ネクソン	40,300	3,030.00	122,109,000
アイスタイル	5,000	612.00	3,060,000
エムアップホールディングス	1,900	1,348.00	2,561,200
エイチーム	1,100	858.00	943,800
エニグモ	2,000	648.00	1,296,000
テクノスジャパン	1,300	482.00	626,600
e n i s h	1,200	400.00	480,000
コロプラ	6,100	672.00	4,099,200
ブロードリーフ	9,200	442.00	4,066,400
クロス・マーケティンググループ	600	768.00	460,800
デジタルハーツホールディングス	1,000	1,898.00	1,898,000
システム情報	1,400	887.00	1,241,800
メディアドゥ	600	1,921.00	1,152,600
じげん	4,600	390.00	1,794,000
ブイキューブ	1,900	772.00	1,466,800
エンカレッジ・テクノロジー	400	513.00	205,200
サイバーリンクス	500	1,018.00	509,000
フィックスターズ	1,700	1,332.00	2,264,400
CARTA HOLDINGS	800	1,684.00	1,347,200
オブティム	1,300	1,148.00	1,492,400
セレス	600	926.00	555,600
S H I F T	1,100	28,090.00	30,899,000
ティーガイア	1,600	1,747.00	2,795,200

セック	200	2,777.00	555,400
テクマトリックス	2,900	1,745.00	5,060,500
プロシップ	700	1,573.00	1,101,100
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,800	2,149.00	10,315,200
GMOペイメントゲートウェイ	3,600	12,150.00	43,740,000
ザッパラス	600	366.00	219,600
システムリサーチ	500	2,106.00	1,053,000
インターネットイニシアティブ	8,700	2,568.00	22,341,600
さくらインターネット	1,700	512.00	870,400
ヴィンクス	500	1,640.00	820,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	4,000.00	2,000,000
SRAホールディングス	800	3,105.00	2,484,000
システムインテグレータ	500	458.00	229,000
朝日ネット	1,700	573.00	974,100
eBASE	2,200	597.00	1,313,400
アバントグループ	2,000	1,513.00	3,026,000
アドソル日進	700	1,460.00	1,022,000
ODKソリューションズ	400	616.00	246,400
フリービット	1,000	1,005.00	1,005,000
コムチュア	2,100	2,673.00	5,613,300
サイバーコム	300	1,453.00	435,900
アステリア	1,200	807.00	968,400
アイル	900	1,993.00	1,793,700
マークライنز	900	2,758.00	2,482,200
メディカル・データ・ビジョン	2,300	999.00	2,297,700
gumi	2,500	780.00	1,950,000
ショーケース	400	344.00	137,600
モバイルファクトリー	300	908.00	272,400
テラスカイ	700	2,721.00	1,904,700
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	800	1,953.00	1,562,400
PCIホールディングス	700	1,047.00	732,900
アイビーシー	300	433.00	129,900
ネオジャパン	500	1,039.00	519,500
PR TIMES	400	2,620.00	1,048,000
ラクス	7,400	1,727.00	12,779,800
ランドコンピュータ	400	912.00	364,800

ダブルスタンダード	600	2,131.00	1,278,600
オーブンドア	1,100	1,836.00	2,019,600
マイネット	500	449.00	224,500
アカツキ	800	2,239.00	1,791,200
ベネフィットジャパン	100	1,276.00	127,600
U b i c o mホールディングス	500	2,207.00	1,103,500
カナミックネットワーク	2,200	639.00	1,405,800
ノムラシステムコーポレーション	1,500	122.00	183,000
チェンジ	3,800	2,527.00	9,602,600
シンクロ・フード	1,000	449.00	449,000
オークネット	800	1,897.00	1,517,600
キャピタル・アセット・プランニング	300	580.00	174,000
エイトレッド	200	1,441.00	288,200
マクロミル	3,500	1,043.00	3,650,500
ビーグリー	300	1,266.00	379,800
オロ	500	1,878.00	939,000
ユーザーローカル	600	1,512.00	907,200
テモナ	300	297.00	89,100
マネーフォワード	3,800	4,620.00	17,556,000
サインポスト	600	731.00	438,600
電算システムホールディングス	800	2,248.00	1,798,400
ソルクシーズ	1,300	369.00	479,700
フェイス	500	529.00	264,500
プロトコーポレーション	1,900	1,237.00	2,350,300
ハイマックス	500	1,448.00	724,000
野村総合研究所	32,000	3,240.00	103,680,000
サイバネットシステム	1,300	921.00	1,197,300
CEホールディングス	800	584.00	467,200
日本システム技術	600	1,617.00	970,200
インテージホールディングス	2,100	1,400.00	2,940,000
東邦システムサイエンス	400	1,027.00	410,800
ソースネクスト	7,900	283.00	2,235,700
インフォコム	2,000	2,023.00	4,046,000
シンプレクス・ホールディングス	2,600	2,270.00	5,902,000
HEROZ	600	1,075.00	645,000
ラクスル	2,200	3,675.00	8,085,000

メルカリ	7,000	2,982.00	20,874,000
I P S	500	2,909.00	1,454,500
F I G	1,800	452.00	813,600
システムサポート	700	1,489.00	1,042,300
イーソル	1,000	931.00	931,000
アルテリア・ネットワークス	1,400	1,248.00	1,747,200
東海ソフト	300	935.00	280,500
ウイングアーク1st	1,600	2,192.00	3,507,200
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,647.00	658,800
サーバーワークス	300	2,653.00	795,900
東名	100	1,476.00	147,600
ヴィッツ	200	1,032.00	206,400
トピラシステムズ	400	915.00	366,000
S a n s a n	5,800	1,597.00	9,262,600
L i n k - U	300	897.00	269,100
ギフトィ	1,700	2,400.00	4,080,000
ベース	500	3,680.00	1,840,000
J M D C	2,600	4,995.00	12,987,000
フォーカスシステムズ	1,100	999.00	1,098,900
クレスコ	1,200	1,793.00	2,151,600
フジ・メディア・ホールディングス	15,000	1,080.00	16,200,000
オービック	5,200	20,830.00	108,316,000
ジャストシステム	2,200	3,085.00	6,787,000
T D C ソフト	1,300	1,514.00	1,968,200
Zホールディングス	221,700	358.90	79,568,130
トレンドマイクロ	9,000	6,570.00	59,130,000
I Dホールディングス	1,000	919.00	919,000
日本オラクル	3,000	8,340.00	25,020,000
アルファシステムズ	500	4,230.00	2,115,000
フューチャー	3,900	1,664.00	6,489,600
C A C H o l d i n g s	1,000	1,495.00	1,495,000
S Bテクノロジー	700	1,985.00	1,389,500
トーセ	400	756.00	302,400
オービックビジネスコンサルタント	3,100	4,280.00	13,268,000
伊藤忠テクノソリューションズ	8,400	3,165.00	26,586,000

アイティフォー	2,100	832.00	1,747,200
東計電算	200	5,670.00	1,134,000
エックスネット	200	1,032.00	206,400
大塚商会	8,800	4,340.00	38,192,000
サイボウズ	2,200	2,396.00	5,271,200
電通国際情報サービス	1,900	4,225.00	8,027,500
ACCESS	1,900	876.00	1,664,400
デジタルガレージ	2,800	4,270.00	11,956,000
EMシステムズ	2,600	851.00	2,212,600
ウェザーニューズ	600	7,450.00	4,470,000
C I J	1,400	932.00	1,304,800
ビジネスエンジニアリング	300	2,348.00	704,400
日本エンタープライズ	1,700	138.00	234,600
WOWOW	900	1,250.00	1,125,000
スカラ	1,500	752.00	1,128,000
インテリジェント ウェイブ	800	738.00	590,400
WOW WORLD GROUP	300	1,117.00	335,100
IMAGICA GROUP	1,300	702.00	912,600
ネットワンシステムズ	5,800	3,415.00	19,807,000
システムソフト	5,500	98.00	539,000
アルゴグラフィックス	1,400	3,720.00	5,208,000
マーベラス	2,600	672.00	1,747,200
エイベックス	2,700	1,608.00	4,341,600
B I P R O G Y	5,700	3,385.00	19,294,500
兼松エレクトロニクス	1,000	4,385.00	4,385,000
都築電気	800	1,290.00	1,032,000
T B Sホールディングス	8,000	1,568.00	12,544,000
日本テレビホールディングス	13,800	1,056.00	14,572,800
朝日放送グループホールディングス	1,500	628.00	942,000
テレビ朝日ホールディングス	3,800	1,358.00	5,160,400
スカパー J S A Tホールディングス	13,800	484.00	6,679,200
テレビ東京ホールディングス	1,100	1,832.00	2,015,200
日本BS放送	600	913.00	547,800
ビジョン	2,000	1,303.00	2,606,000
スマートバリュー	400	478.00	191,200
USEN-NEXT HOLDINGS	1,400	2,165.00	3,031,000

コネクシオ	1,000	1,242.00	1,242,000
日本通信	14,400	220.00	3,168,000
クロップス	300	1,043.00	312,900
日本電信電話	199,700	3,771.00	753,068,700
KDDI	120,500	4,035.00	486,217,500
ソフトバンク	250,400	1,482.50	371,218,000
光通信	1,800	18,150.00	32,670,000
エムティーアイ	1,400	526.00	736,400
GMOインターネットグループ	5,800	2,524.00	14,639,200
ファイバーゲート	700	940.00	658,000
アイドママーケティングコミュニケーション	400	277.00	110,800
KADOKAWA	8,200	2,650.00	21,730,000
学研ホールディングス	2,600	958.00	2,490,800
ゼンリン	2,700	842.00	2,273,400
昭文社ホールディングス	700	290.00	203,000
インプレスホールディングス	1,400	214.00	299,600
アイネット	900	1,310.00	1,179,000
松竹	900	12,090.00	10,881,000
東宝	9,700	5,320.00	51,604,000
東映	400	18,970.00	7,588,000
エヌ・ティ・ティ・データ	48,900	2,061.00	100,782,900
ピー・シー・エー	900	1,298.00	1,168,200
ビジネスブレイン太田昭和	700	1,924.00	1,346,800
DTS	3,400	3,090.00	10,506,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,800	6,300.00	49,140,000
シーイーシー	2,200	1,576.00	3,467,200
カプコン	15,500	4,325.00	67,037,500
アイ・エス・ビー	800	1,319.00	1,055,200
ジャステック	1,000	1,210.00	1,210,000
SCSK	12,700	2,085.00	26,479,500
NSW	600	2,156.00	1,293,600
アイネス	1,100	1,372.00	1,509,200
TKC	2,800	3,665.00	10,262,000
富士ソフト	1,800	7,800.00	14,040,000
NSD	5,600	2,383.00	13,344,800
コナミグループ	6,700	6,250.00	41,875,000

福井コンピュータホールディングス	1,100	2,870.00	3,157,000
J B C Cホールディングス	1,100	1,948.00	2,142,800
ミロク情報サービス	1,400	1,472.00	2,060,800
ソフトバンクグループ	90,100	6,291.00	566,819,100
高千穂交易	600	2,210.00	1,326,000
オルパヘルスケアホールディングス	300	1,580.00	474,000
伊藤忠食品	400	5,030.00	2,012,000
エレマテック	1,500	1,548.00	2,322,000
あらた	1,300	4,020.00	5,226,000
トーメンデバイス	200	5,560.00	1,112,000
東京エレクトロン デバイス	600	7,110.00	4,266,000
円谷フィールズホールディングス	1,400	2,612.00	3,656,800
双日	17,500	2,570.00	44,975,000
アルフレッサ ホールディングス	16,500	1,695.00	27,967,500
横浜冷凍	4,500	1,058.00	4,761,000
神栄	300	803.00	240,900
ラサ商事	800	1,028.00	822,400
アルコニックス	2,200	1,322.00	2,908,400
神戸物産	12,700	3,515.00	44,640,500
ハイパー	400	516.00	206,400
あい ホールディングス	2,700	2,176.00	5,875,200
ディーブイエックス	500	1,033.00	516,500
ダイワボウホールディングス	6,700	2,028.00	13,587,600
マクニカホールディングス	4,000	3,515.00	14,060,000
ラクト・ジャパン	700	2,127.00	1,488,900
グリムス	700	2,020.00	1,414,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,500	853.00	2,132,500
八洲電機	1,400	1,029.00	1,440,600
メディアスホールディングス	1,100	730.00	803,000
レスターホールディングス	1,600	2,134.00	3,414,400
ジュートックホールディングス	400	1,182.00	472,800
大光	800	664.00	531,200
O C H Iホールディングス	400	1,227.00	490,800
T O K A Iホールディングス	8,200	865.00	7,093,000
黒谷	500	591.00	295,500
C o m i n i x	400	728.00	291,200

三洋貿易	1,700	1,123.00	1,909,100
ビューティガレージ	300	3,165.00	949,500
ウイン・パートナーズ	1,200	991.00	1,189,200
ミタチ産業	500	1,162.00	581,000
シップヘルスケアホールディングス	5,900	2,715.00	16,018,500
明治電機工業	700	1,054.00	737,800
デリカフーズホールディングス	800	479.00	383,200
スターティアホールディングス	400	1,007.00	402,800
コメダホールディングス	4,000	2,454.00	9,816,000
ピーバンドットコム	300	524.00	157,200
アセンテック	700	503.00	352,100
富士興産	400	1,140.00	456,000
協栄産業	200	1,813.00	362,600
フルサト・マルカホールディングス	1,600	3,590.00	5,744,000
ヤマエグループホールディングス	1,000	1,467.00	1,467,000
小野建	1,500	1,453.00	2,179,500
南陽	300	1,872.00	561,600
佐鳥電機	1,100	1,301.00	1,431,100
エコートレーディング	400	640.00	256,000
伯東	1,000	4,070.00	4,070,000
コンドーテック	1,300	988.00	1,284,400
中山福	1,000	325.00	325,000
ナガイレーベン	2,100	2,062.00	4,330,200
三菱食品	1,500	3,200.00	4,800,000
松田産業	1,300	2,328.00	3,026,400
第一興商	3,200	3,940.00	12,608,000
メディパルホールディングス	17,100	1,796.00	30,711,600
S P K	800	1,402.00	1,121,600
萩原電気ホールディングス	700	2,535.00	1,774,500
アズワン	2,400	6,050.00	14,520,000
スズデン	600	2,284.00	1,370,400
シモジマ	1,200	933.00	1,119,600
ドウシシャ	1,800	1,554.00	2,797,200
小津産業	400	1,469.00	587,600
高速	900	1,762.00	1,585,800
たけびし	700	1,533.00	1,073,100

リックス	400	2,235.00	894,000
丸文	1,500	905.00	1,357,500
ハピネット	1,400	1,934.00	2,707,600
橋本総業ホールディングス	700	1,017.00	711,900
日本ライフライン	4,900	953.00	4,669,700
タカショー	1,500	708.00	1,062,000
I DOM	5,000	703.00	3,515,000
進和	1,100	2,060.00	2,266,000
エスケイジャパン	500	534.00	267,000
ダイترون	700	2,439.00	1,707,300
シークス	2,400	1,406.00	3,374,400
田中商事	600	565.00	339,000
オーハシテクニカ	900	1,395.00	1,255,500
白銅	600	2,482.00	1,489,200
ダイコー通産	200	1,066.00	213,200
伊藤忠商事	99,100	4,328.00	428,904,800
丸紅	129,900	1,590.00	206,541,000
高島	300	2,911.00	873,300
長瀬産業	7,800	2,064.00	16,099,200
蝶理	900	2,011.00	1,809,900
豊田通商	14,400	5,390.00	77,616,000
三共生興	2,400	487.00	1,168,800
兼松	6,400	1,533.00	9,811,200
ツカモトコーポレーション	300	1,384.00	415,200
三井物産	120,300	4,073.00	489,981,900
日本紙パルプ商事	900	4,985.00	4,486,500
カメイ	1,800	1,206.00	2,170,800
東都水産	100	5,220.00	522,000
OUGホールディングス	300	2,411.00	723,300
スターゼン	1,300	2,096.00	2,724,800
山善	4,500	1,015.00	4,567,500
椿本興業	300	3,890.00	1,167,000
住友商事	101,900	2,290.00	233,351,000
内田洋行	700	4,470.00	3,129,000
三菱商事	102,800	4,495.00	462,086,000
第一実業	600	4,335.00	2,601,000

キャノンマーケティングジャパン	3,800	3,075.00	11,685,000
西華産業	700	1,592.00	1,114,400
佐藤商事	1,200	1,213.00	1,455,600
菱洋エレクトロ	1,400	2,399.00	3,358,600
東京産業	1,600	776.00	1,241,600
ユアサ商事	1,500	3,600.00	5,400,000
神鋼商事	400	4,635.00	1,854,000
トルク	1,100	217.00	238,700
阪和興業	3,000	3,785.00	11,355,000
正栄食品工業	1,100	3,830.00	4,213,000
カナデン	1,400	1,148.00	1,607,200
菱電商事	1,400	1,687.00	2,361,800
岩谷産業	3,800	6,110.00	23,218,000
ナイス	500	1,434.00	717,000
ニチモウ	200	2,691.00	538,200
極東貿易	1,000	1,343.00	1,343,000
アステナホールディングス	2,900	440.00	1,276,000
三愛オブリ	4,600	1,243.00	5,717,800
稲畑産業	3,400	2,361.00	8,027,400
G S I クレオス	1,000	1,472.00	1,472,000
明和産業	2,300	688.00	1,582,400
クワザワホールディングス	700	419.00	293,300
ワキタ	3,100	1,194.00	3,701,400
東邦ホールディングス	4,100	2,148.00	8,806,800
サンゲツ	4,200	2,140.00	8,988,000
ミツウロコグループホールディングス	2,200	1,041.00	2,290,200
シナネンホールディングス	500	3,770.00	1,885,000
伊藤忠エネクス	4,100	1,021.00	4,186,100
サンリオ	4,700	4,505.00	21,173,500
サンワテクノス	900	1,515.00	1,363,500
リョーサン	1,800	2,939.00	5,290,200
新光商事	2,300	1,202.00	2,764,600
トーヨー	700	1,828.00	1,279,600
三信電気	700	2,269.00	1,588,300
東陽テクニカ	1,900	1,373.00	2,608,700
モスフードサービス	2,400	3,095.00	7,428,000

加賀電子	1,400	4,290.00	6,006,000
ソーダニッカ	1,300	629.00	817,700
立花エレテック	1,200	1,802.00	2,162,400
フォーバル	700	975.00	682,500
PAL TAC	2,600	4,455.00	11,583,000
三谷産業	3,000	317.00	951,000
太平洋興発	700	835.00	584,500
西本Wismettacホールディングス	400	3,590.00	1,436,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,630.00	326,000
コア商事ホールディングス	1,200	600.00	720,000
KPPグループホールディングス	3,900	868.00	3,385,200
ヤマタネ	700	1,682.00	1,177,400
丸紅建材リース	200	1,730.00	346,000
日鉄物産	1,100	5,060.00	5,566,000
泉州電業	800	3,275.00	2,620,000
トラスコ中山	3,500	2,128.00	7,448,000
オートバックスセブン	5,800	1,427.00	8,276,600
モリト	1,200	752.00	902,400
加藤産業	2,000	3,440.00	6,880,000
北恵	400	659.00	263,600
イエローハット	3,000	1,735.00	5,205,000
JKホールディングス	1,300	1,020.00	1,326,000
日伝	1,000	1,731.00	1,731,000
北沢産業	1,200	204.00	244,800
杉本商事	800	2,004.00	1,603,200
因幡電機産業	4,300	2,784.00	11,971,200
東テク	600	3,120.00	1,872,000
ミスミグループ本社	24,800	3,280.00	81,344,000
アルテック	1,100	311.00	342,100
タキヒヨー	500	874.00	437,000
蔵王産業	300	1,761.00	528,300
スズケン	5,100	3,705.00	18,895,500
ジェコス	1,100	797.00	876,700
グローセル	1,900	444.00	843,600
ローソン	4,100	5,150.00	21,115,000
サンエー	1,300	4,290.00	5,577,000

カワチ薬品	1,300	2,189.00	2,845,700
エービーシー・マート	2,400	7,200.00	17,280,000
ハードオフコーポレーション	700	1,388.00	971,600
アスクル	4,000	1,532.00	6,128,000
ゲオホールディングス	1,700	1,983.00	3,371,100
アダストリア	2,000	1,964.00	3,928,000
ジーフット	900	295.00	265,500
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	300	404.00	121,200
くら寿司	1,900	3,245.00	6,165,500
キャンドウ	600	2,204.00	1,322,400
I Kホールディングス	500	418.00	209,000
パルグループホールディングス	1,600	2,302.00	3,683,200
エディオン	6,500	1,272.00	8,268,000
サーラコーポレーション	3,500	710.00	2,485,000
ワッツ	800	709.00	567,200
ハローズ	700	2,943.00	2,060,100
フジオフードグループ本社	1,400	1,380.00	1,932,000
あみやき亭	400	2,905.00	1,162,000
ひらまつ	3,600	189.00	680,400
大黒天物産	600	5,190.00	3,114,000
ハニーズホールディングス	1,500	1,274.00	1,911,000
ファーマライズホールディングス	400	657.00	262,800
アルペン	1,400	2,021.00	2,829,400
ハブ	600	610.00	366,000
クオールホールディングス	2,300	1,181.00	2,716,300
ジーンズホールディングス	1,000	4,785.00	4,785,000
ビックカメラ	10,900	1,276.00	13,908,400
DCMホールディングス	10,000	1,165.00	11,650,000
ペッパーフードサービス	3,500	171.00	598,500
Monotaro	23,300	2,000.00	46,600,000
東京一番フーズ	400	506.00	202,400
アークランドサービスホールディングス	1,400	2,201.00	3,081,400
J. フロント リテイリング	20,400	1,154.00	23,541,600
ドトール・日レスホールディングス	2,900	1,701.00	4,932,900
マツキヨココカラ&カンパニー	10,000	6,330.00	63,300,000
ブロンコビリー	900	2,524.00	2,271,600

ZOZO	10,900	3,320.00	36,188,000
トレジャー・ファクトリー	500	2,491.00	1,245,500
物語コーポレーション	900	6,300.00	5,670,000
三越伊勢丹ホールディングス	27,700	1,319.00	36,536,300
H a m e e	700	722.00	505,400
マーケットエンタープライズ	200	999.00	199,800
ウエルシアホールディングス	8,500	3,100.00	26,350,000
クリエイトSDホールディングス	2,700	3,240.00	8,748,000
丸善C H I ホールディングス	2,000	334.00	668,000
ミサワ	300	614.00	184,200
ティーライフ	200	1,288.00	257,600
シュッピン	1,300	1,238.00	1,609,400
オイシックス・ラ・大地	2,200	2,087.00	4,591,400
ネクステージ	3,800	2,642.00	10,039,600
ジョイフル本田	5,300	1,879.00	9,958,700
鳥貴族ホールディングス	600	2,200.00	1,320,000
ホットランド	1,200	1,474.00	1,768,800
すかいらーくホールディングス	22,500	1,584.00	35,640,000
S F Pホールディングス	900	1,744.00	1,569,600
綿半ホールディングス	1,300	1,335.00	1,735,500
ヨシックスホールディングス	300	2,115.00	634,500
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	1,114.00	6,015,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	700	1,565.00	1,095,500
B E E N O S	900	2,634.00	2,370,600
あさひ	1,400	1,361.00	1,905,400
日本調剤	1,100	1,197.00	1,316,700
コスモス薬品	1,900	13,950.00	26,505,000
トーエル	700	743.00	520,100
セブン&アイ・ホールディングス	56,700	5,688.00	322,509,600
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	12,400	930.00	11,532,000
ツルハホールディングス	4,000	9,400.00	37,600,000
サンマルクホールディングス	1,300	1,686.00	2,191,800
フェリシモ	400	1,031.00	412,400
トリドールホールディングス	4,100	2,744.00	11,250,400
TOKYO BASE	1,700	284.00	482,800

ウイルプラスホールディングス	300	1,084.00	325,200
JMホールディングス	1,400	1,683.00	2,356,200
サツドラホールディングス	800	704.00	563,200
アレンザホールディングス	1,200	998.00	1,197,600
串カツ田中ホールディングス	400	1,744.00	697,600
バロックジャパンリミテッド	1,100	813.00	894,300
クスリのアオキホールディングス	1,600	8,360.00	13,376,000
力の源ホールディングス	900	947.00	852,300
FOOD & LIFE COMPANIE	9,400	2,720.00	25,568,000
メディカルシステムネットワーク	1,400	416.00	582,400
一家ホールディングス	400	629.00	251,600
ジャパングラフトホールディングス	500	644.00	322,000
はるやまホールディングス	700	439.00	307,300
ノジマ	5,400	1,324.00	7,149,600
カップ・クリエイト	2,600	1,372.00	3,567,200
ライトオン	1,300	615.00	799,500
良品計画	21,200	1,525.00	32,330,000
パリティホールディングス	2,100	272.00	571,200
アドヴァングループ	1,600	899.00	1,438,400
アルビス	500	2,384.00	1,192,000
コナカ	1,800	335.00	603,000
ハウス オブ ローゼ	200	1,634.00	326,800
G-7ホールディングス	2,100	1,519.00	3,189,900
イオン北海道	2,400	1,149.00	2,757,600
コジマ	3,200	608.00	1,945,600
ヒマラヤ	500	941.00	470,500
コーナン商事	2,200	3,310.00	7,282,000
エコス	600	1,839.00	1,103,400
ワタミ	2,000	1,027.00	2,054,000
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	36,900	2,390.00	88,191,000
西松屋チェーン	3,700	1,366.00	5,054,200
ゼンショーホールディングス	9,000	3,385.00	30,465,000
幸楽苑ホールディングス	1,100	1,002.00	1,102,200
ハークスレイ	600	800.00	480,000
サイゼリヤ	2,700	2,952.00	7,970,400

VTホールディングス	6,300	513.00	3,231,900
魚力	500	2,140.00	1,070,000
フジ・コーポレーション	900	1,291.00	1,161,900
ユナイテッドアローズ	1,800	1,825.00	3,285,000
ハイデイ日高	2,500	1,966.00	4,915,000
YU-WA Creation Holdings	1,100	203.00	223,300
コロワイド	7,600	1,782.00	13,543,200
ピーシーデポコーポレーション	1,900	261.00	495,900
壺番屋	1,300	4,590.00	5,967,000
PLANT	400	640.00	256,000
スギホールディングス	3,300	6,270.00	20,691,000
薬王堂ホールディングス	900	2,719.00	2,447,100
スクロール	2,500	724.00	1,810,000
ヨンドシーホールディングス	1,400	1,743.00	2,440,200
木曽路	2,500	2,100.00	5,250,000
SRSホールディングス	2,700	862.00	2,327,400
千趣会	3,000	400.00	1,200,000
リテールパートナーズ	2,500	1,284.00	3,210,000
ケーヨー	2,700	906.00	2,446,200
上新電機	1,500	1,908.00	2,862,000
日本瓦斯	8,800	2,117.00	18,629,600
ロイヤルホールディングス	3,200	2,394.00	7,660,800
東天紅	100	795.00	79,500
いなげや	1,600	1,193.00	1,908,800
チヨダ	1,600	776.00	1,241,600
ライフコーポレーション	1,400	2,608.00	3,651,200
リンガーハット	2,100	2,218.00	4,657,800
MrMaxHD	2,300	663.00	1,524,900
AOKIホールディングス	3,000	668.00	2,004,000
オークワ	2,600	923.00	2,399,800
コメリ	2,500	2,603.00	6,507,500
青山商事	3,500	876.00	3,066,000
しまむら	1,900	12,530.00	23,807,000
はせがわ	800	345.00	276,000
高島屋	12,400	1,720.00	21,328,000

松屋	2,800	992.00	2,777,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,000	1,193.00	9,544,000
近鉄百貨店	500	2,490.00	1,245,000
丸井グループ	12,100	2,289.00	27,696,900
アクシアル リテイリング	1,100	3,435.00	3,778,500
イオン	55,700	2,853.00	158,912,100
イズミ	2,500	2,982.00	7,455,000
平和堂	2,800	2,069.00	5,793,200
フジ	2,500	1,835.00	4,587,500
ヤオコー	1,900	6,840.00	12,996,000
ゼビオホールディングス	2,200	934.00	2,054,800
ケーズホールディングス	13,100	1,120.00	14,672,000
O l y m p i c グループ	600	521.00	312,600
日産東京販売ホールディングス	2,100	299.00	627,900
シルバーライフ	400	1,908.00	763,200
Genky DrugStores	800	3,475.00	2,780,000
ナルミヤ・インターナショナル	300	878.00	263,400
ブックオフグループホールディングス	1,000	1,329.00	1,329,000
ギフトホールディングス	300	3,815.00	1,144,500
アインホールディングス	2,300	6,270.00	14,421,000
元気寿司	500	3,140.00	1,570,000
ヤマダホールディングス	67,400	467.00	31,475,800
アーケランズ	2,400	1,507.00	3,616,800
ニトリホールディングス	6,700	15,830.00	106,061,000
愛眼	1,300	172.00	223,600
ケーユーホールディングス	1,000	1,315.00	1,315,000
吉野家ホールディングス	6,400	2,325.00	14,880,000
松屋フーズホールディングス	800	3,920.00	3,136,000
サガミホールディングス	2,700	1,213.00	3,275,100
関西フードマーケット	1,500	1,327.00	1,990,500
王将フードサービス	1,100	6,020.00	6,622,000
プレナス	1,800	2,637.00	4,746,600
ミニストップ	1,200	1,428.00	1,713,600
アークス	3,000	2,118.00	6,354,000
バローホールディングス	3,200	1,786.00	5,715,200
ベルク	800	5,810.00	4,648,000

大庄	900	1,067.00	960,300	
ファーストリテイリング	2,500	84,570.00	211,425,000	
サンドラッグ	6,200	3,770.00	23,374,000	
サックスパー ホールディングス	1,600	754.00	1,206,400	
ヤマザワ	300	1,311.00	393,300	
やまや	300	2,499.00	749,700	
ベルーナ	4,000	687.00	2,748,000	
いよぎんホールディングス	18,200	680.00	12,376,000	
しずおかフィナンシャルグループ	34,600	958.00	33,146,800	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	12,900	943.00	12,164,700	
島根銀行	500	444.00	222,000	
じもとホールディングス	1,000	395.00	395,000	
めぶきフィナンシャルグループ	75,800	302.00	22,891,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	2,301.00	4,602,000	
九州フィナンシャルグループ	26,900	405.00	10,894,500	
ゆうちょ銀行	43,500	1,045.00	45,457,500	
富山第一銀行	3,900	557.00	2,172,300	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	84,300	483.00	40,716,900	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,700	851.00	8,254,700	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,450.00	2,030,000	
第四北越フィナンシャルグループ	2,400	2,544.00	6,105,600	
ひろぎんホールディングス	19,900	621.00	12,357,900	
おきなわフィナンシャルグループ	1,500	2,030.00	3,045,000	
十六フィナンシャルグループ	2,000	2,581.00	5,162,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,300	4,435.00	5,765,500	
プロクレアホールディングス	1,900	2,119.00	4,026,100	
あいちフィナンシャルグループ	2,100	2,174.00	4,565,400	
新生銀行	4,500	2,263.00	10,183,500	
あおぞら銀行	9,600	2,594.00	24,902,400	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,003,500	761.70	764,365,950	代用有価証券 100,000株
りそなホールディングス	195,400	643.90	125,818,060	
三井住友トラスト・ホールディングス	28,400	4,263.00	121,069,200	
三井住友フィナンシャルグループ	111,900	4,689.00	524,699,100	代用有価証券 10,000株
千葉銀行	42,600	850.00	36,210,000	
群馬銀行	29,700	435.00	12,919,500	

武蔵野銀行	2,000	1,887.00	3,774,000
千葉興業銀行	3,500	387.00	1,354,500
筑波銀行	6,700	201.00	1,346,700
七十七銀行	4,900	1,888.00	9,251,200
秋田銀行	1,000	1,727.00	1,727,000
山形銀行	1,700	1,158.00	1,968,600
岩手銀行	1,000	1,856.00	1,856,000
東邦銀行	12,100	206.00	2,492,600
東北銀行	800	983.00	786,400
ふくおかフィナンシャルグループ	12,200	2,682.00	32,720,400
スルガ銀行	13,500	409.00	5,521,500
八十二銀行	31,400	503.00	15,794,200
山梨中央銀行	1,600	1,026.00	1,641,600
大垣共立銀行	2,900	1,735.00	5,031,500
福井銀行	1,400	1,435.00	2,009,000
清水銀行	600	1,483.00	889,800
富山銀行	200	1,660.00	332,000
滋賀銀行	2,500	2,468.00	6,170,000
南都銀行	2,300	2,285.00	5,255,500
百五銀行	14,500	340.00	4,930,000
京都銀行	4,800	5,440.00	26,112,000
紀陽銀行	5,500	1,414.00	7,777,000
ほくほくフィナンシャルグループ	9,700	868.00	8,419,600
山陰合同銀行	9,500	715.00	6,792,500
鳥取銀行	500	1,089.00	544,500
百十四銀行	1,400	1,719.00	2,406,600
四国銀行	2,400	876.00	2,102,400
阿波銀行	2,300	2,028.00	4,664,400
大分銀行	900	1,860.00	1,674,000
宮崎銀行	1,000	2,285.00	2,285,000
佐賀銀行	900	1,560.00	1,404,000
琉球銀行	3,500	805.00	2,817,500
セブン銀行	54,800	258.00	14,138,400
みずほフィナンシャルグループ	221,400	1,695.50	375,383,700
高知銀行	500	659.00	329,500
山口フィナンシャルグループ	16,900	782.00	13,215,800

長野銀行	500	1,240.00	620,000
名古屋銀行	1,000	3,085.00	3,085,000
北洋銀行	23,300	230.00	5,359,000
大光銀行	500	1,150.00	575,000
愛媛銀行	2,100	854.00	1,793,400
トマト銀行	500	997.00	498,500
京葉銀行	7,100	522.00	3,706,200
栃木銀行	6,900	296.00	2,042,400
北日本銀行	500	1,867.00	933,500
東和銀行	2,800	524.00	1,467,200
福島銀行	1,700	217.00	368,900
大東銀行	600	628.00	376,800
トモニホールディングス	12,400	332.00	4,116,800
フィデアホールディングス	1,600	1,328.00	2,124,800
池田泉州ホールディングス	19,600	226.00	4,429,600
F P G	6,200	1,166.00	7,229,200
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,300	1,243.00	1,615,900
マーキュリアホールディングス	900	596.00	536,400
S B I ホールディングス	22,200	2,613.00	58,008,600
ジャフコ グループ	5,100	2,412.00	12,301,200
大和証券グループ本社	109,400	584.00	63,889,600
野村ホールディングス	281,900	487.50	137,426,250
岡三証券グループ	13,600	399.00	5,426,400
丸三証券	5,100	404.00	2,060,400
東洋証券	5,100	276.00	1,407,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	16,800	353.00	5,930,400
光世証券	400	388.00	155,200
水戸証券	4,200	216.00	907,200
いちよし証券	2,900	618.00	1,792,200
松井証券	9,100	778.00	7,079,800
マネックスグループ	17,100	428.00	7,318,800
極東証券	1,900	595.00	1,130,500
岩井コスモホールディングス	1,800	1,271.00	2,287,800
アイザワ証券グループ	2,300	701.00	1,612,300
マネーパートナーズグループ	1,800	286.00	514,800
スパークス・グループ	1,700	1,732.00	2,944,400

かんぽ生命保険	18,600	2,203.00	40,975,800
SOMPOホールディングス	26,300	5,668.00	149,068,400
アニコムホールディングス	5,300	637.00	3,376,100
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	34,500	3,998.00	137,931,000
第一生命ホールディングス	77,900	2,622.00	204,253,800
東京海上ホールディングス	154,100	2,835.00	436,873,500
T&Dホールディングス	41,000	1,640.00	67,240,000
アドバンスクリエイト	900	1,073.00	965,700
全国保証	4,000	5,070.00	20,280,000
あんしん保証	700	254.00	177,800
ジェイリース	500	3,020.00	1,510,000
イントラスト	600	794.00	476,400
日本モーゲージサービス	800	862.00	689,600
C a s a	500	872.00	436,000
アルヒ	1,900	1,004.00	1,907,600
プレミアグループ	2,600	1,822.00	4,737,200
ネットプロテクションズホールディングス	5,100	537.00	2,738,700
クレディセゾン	9,700	1,782.00	17,285,400
芙蓉総合リース	1,400	8,640.00	12,096,000
みずほリース	2,300	3,340.00	7,682,000
東京センチュリー	2,900	4,640.00	13,456,000
日本証券金融	6,100	1,128.00	6,880,800
アイフル	25,200	419.00	10,558,800
リコーリース	1,500	3,680.00	5,520,000
イオンフィナンシャルサービス	8,800	1,425.00	12,540,000
アコム	27,200	321.00	8,731,200
ジャックス	1,600	4,270.00	6,832,000
オリエントコーポレーション	4,000	1,168.00	4,672,000
オリックス	102,400	2,245.50	229,939,200
三菱HCキャピタル	59,600	649.00	38,680,400
九州リースサービス	700	685.00	479,500
日本取引所グループ	43,000	1,897.00	81,571,000
イー・ギャランティ	2,500	2,297.00	5,742,500
アサックス	700	601.00	420,700
NECキャピタルソリューション	800	2,070.00	1,656,000

大東建託	5,600	14,230.00	79,688,000
いちご	18,100	308.00	5,574,800
日本駐車場開発	18,800	311.00	5,846,800
スター・マイカ・ホールディングス	1,600	731.00	1,169,600
S R Eホールディングス	800	4,270.00	3,416,000
A Dワークスグループ	4,600	156.00	717,600
ヒューリック	35,800	1,142.00	40,883,600
三栄建築設計	800	1,554.00	1,243,200
野村不動産ホールディングス	9,600	3,180.00	30,528,000
三重交通グループホールディングス	3,500	485.00	1,697,500
サムティ	2,500	2,286.00	5,715,000
ディア・ライフ	2,500	626.00	1,565,000
コーセーアールイー	700	795.00	556,500
地主	1,200	1,992.00	2,390,400
プレサンスコーポレーション	2,100	1,559.00	3,273,900
T H Eグローバル社	1,400	210.00	294,000
ハウスコム	400	1,120.00	448,000
J P M C	900	1,021.00	918,900
サンセイランディック	600	856.00	513,600
エストラスト	400	595.00	238,000
フージャースホールディングス	2,500	762.00	1,905,000
オープンハウスグループ	5,600	5,580.00	31,248,000
東急不動産ホールディングス	46,100	706.00	32,546,600
飯田グループホールディングス	13,500	2,124.00	28,674,000
イーランド	300	1,567.00	470,100
ムゲンエステート	1,300	513.00	666,900
ビーロッド	1,300	640.00	832,000
ファーストブラザーズ	400	875.00	350,000
A n d D oホールディングス	1,100	845.00	929,500
シーアールイー	800	1,303.00	1,042,400
プロパティエージェント	300	1,254.00	376,200
ケイアイスター不動産	800	4,945.00	3,956,000
アグレ都市デザイン	400	1,580.00	632,000
グッドコムアセット	1,600	907.00	1,451,200
ジェイ・エス・ビー	400	4,045.00	1,618,000
ロードスターキャピタル	700	1,851.00	1,295,700

テンポイノベーション	600	1,004.00	602,400
グローバル・リンク・マネジメント	400	1,381.00	552,400
フェイスネットワーク	300	1,351.00	405,300
パーク24	12,000	2,029.00	24,348,000
パラカ	600	1,955.00	1,173,000
三井不動産	66,600	2,633.00	175,357,800
三菱地所	97,100	1,838.00	178,469,800
平和不動産	2,500	4,030.00	10,075,000
東京建物	14,600	1,867.00	27,258,200
京阪神ビルディング	2,100	1,323.00	2,778,300
住友不動産	27,700	3,439.00	95,260,300
テーオーシー	2,900	678.00	1,966,200
東京楽天地	300	4,320.00	1,296,000
スターツコーポレーション	2,200	2,688.00	5,913,600
フジ住宅	2,300	658.00	1,513,400
空港施設	2,100	530.00	1,113,000
明和地所	1,000	701.00	701,000
ゴールドクレスト	1,500	1,744.00	2,616,000
エスリード	800	1,852.00	1,481,600
日神グループホールディングス	2,700	441.00	1,190,700
日本エスコン	3,600	846.00	3,045,600
MIRARTHホールディングス	8,000	384.00	3,072,000
AVANTIA	900	793.00	713,700
イオンモール	8,000	1,710.00	13,680,000
毎日コムネット	800	719.00	575,200
ファースト住建	700	1,002.00	701,400
カチタス	4,100	3,220.00	13,202,000
トーセイ	2,600	1,450.00	3,770,000
サンフロンティア不動産	2,700	1,138.00	3,072,600
FJネクストホールディングス	1,700	974.00	1,655,800
インテリックス	600	531.00	318,600
ランドビジネス	1,100	228.00	250,800
グランディハウス	1,500	560.00	840,000
日本空港ビルデング	5,400	6,380.00	34,452,000
明豊ファシリティワークス	800	724.00	579,200
日本工営	1,100	3,455.00	3,800,500

L I F U L L	5,400	236.00	1,274,400
M I X I	3,600	2,477.00	8,917,200
ジェイエイシーリクルートメント	1,400	2,581.00	3,613,400
日本M&Aセンターホールディングス	27,400	1,726.00	47,292,400
メンバーズ	500	2,035.00	1,017,500
中広	200	379.00	75,800
UTグループ	2,400	2,396.00	5,750,400
アイティメディア	600	1,706.00	1,023,600
E・Jホールディングス	1,000	1,321.00	1,321,000
夢真ビーネックスグループ	5,800	1,800.00	10,440,000
コシダカホールディングス	4,800	1,072.00	5,145,600
アルトナー	400	1,011.00	404,400
パソナグループ	1,900	1,947.00	3,699,300
CDS	400	1,850.00	740,000
リンクアンドモチベーション	4,600	703.00	3,233,800
エス・エム・エス	6,100	3,435.00	20,953,500
サニーサイドアップグループ	600	587.00	352,200
パーソルホールディングス	17,900	2,968.00	53,127,200
リニカル	900	675.00	607,500
クックパッド	4,300	200.00	860,000
エスクリ	700	322.00	225,400
アイ・ケイ・ケイホールディングス	800	632.00	505,600
学情	700	1,495.00	1,046,500
スタジオアリス	800	2,075.00	1,660,000
シミックホールディングス	900	1,700.00	1,530,000
エプコ	300	728.00	218,400
N J S	400	2,060.00	824,000
総合警備保障	5,900	3,505.00	20,679,500
カカクコム	11,900	2,147.00	25,549,300
アイロムグループ	600	2,349.00	1,409,400
セントケア・ホールディング	1,000	864.00	864,000
サイネックス	300	550.00	165,000
ルネサンス	1,100	887.00	975,700
ディップ	2,800	3,865.00	10,822,000
デジタルホールディングス	1,200	1,224.00	1,468,800
新日本科学	1,700	2,335.00	3,969,500

キャリアデザインセンター	300	1,620.00	486,000
ベネフィット・ワン	7,400	2,080.00	15,392,000
エムスリー	31,600	4,056.00	128,169,600
ツカダ・グローバルホールディング	1,000	380.00	380,000
プラス	200	1,108.00	221,600
アウトソーシング	9,500	1,002.00	9,519,000
ウェルネット	1,400	620.00	868,000
ワールドホールディングス	700	2,812.00	1,968,400
ディー・エヌ・エー	6,800	1,827.00	12,423,600
博報堂DYホールディングス	20,400	1,320.00	26,928,000
ぐるなび	2,900	413.00	1,197,700
タカミヤ	2,100	388.00	814,800
ジャパンベストレスクューシステム	1,000	859.00	859,000
ファンコミュニケーションズ	3,100	440.00	1,364,000
ライク	600	2,007.00	1,204,200
ビジネス・ブレークスルー	600	387.00	232,200
エスプール	4,600	912.00	4,195,200
WDBホールディングス	800	2,192.00	1,753,600
ティア	1,000	424.00	424,000
CDG	200	1,105.00	221,000
アドウェイズ	2,200	522.00	1,148,400
バリューコマース	1,200	1,967.00	2,360,400
インフォマート	16,600	428.00	7,104,800
J Pホールディングス	4,600	277.00	1,274,200
エコナックホールディングス	2,800	92.00	257,600
CLホールディングス	400	806.00	322,400
プレステージ・インターナショナル	6,700	702.00	4,703,400
アミューズ	900	1,781.00	1,602,900
ドリームインキュベータ	500	2,440.00	1,220,000
クイック	1,200	2,033.00	2,439,600
TAC	800	211.00	168,800
電通グループ	16,800	4,300.00	72,240,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	1,433.00	716,500
ぴあ	500	3,195.00	1,597,500
イオンファンタジー	700	2,911.00	2,037,700
シーティーエス	1,800	857.00	1,542,600

ネクシィーズグループ	500	669.00	334,500
H. U. グループホールディングス	4,700	2,791.00	13,117,700
アルプス技研	1,400	2,139.00	2,994,600
ダイオーズ	300	1,496.00	448,800
日本空調サービス	1,700	705.00	1,198,500
オリエンタルランド	16,900	19,665.00	332,338,500
ダスキン	3,600	2,951.00	10,623,600
明光ネットワークジャパン	2,100	621.00	1,304,100
ファルコホールディングス	700	1,770.00	1,239,000
秀英予備校	400	442.00	176,800
ラウンドワン	13,400	505.00	6,767,000
リゾートトラスト	6,300	2,382.00	15,006,600
ビー・エム・エル	2,000	3,390.00	6,780,000
りらいあコミュニケーションズ	2,600	1,019.00	2,649,400
リソー教育	7,400	356.00	2,634,400
早稲田アカデミー	900	1,120.00	1,008,000
ユー・エス・エス	16,400	2,232.00	36,604,800
東京個別指導学院	1,900	539.00	1,024,100
サイバーエージェント	38,200	1,216.00	46,451,200
楽天グループ	73,900	625.00	46,187,500
クリーク・アンド・リバー社	900	2,023.00	1,820,700
モーニングスター	2,600	465.00	1,209,000
テー・オー・ダブリュー	3,400	298.00	1,013,200
山田コンサルティンググループ	800	1,149.00	919,200
セントラルスポーツ	600	2,370.00	1,422,000
フルキャストホールディングス	1,500	3,000.00	4,500,000
エン・ジャパン	2,900	2,349.00	6,812,100
リソルホールディングス	100	4,580.00	458,000
テクノプロ・ホールディングス	10,700	3,635.00	38,894,500
アトラグループ	400	206.00	82,400
インターワークス	400	370.00	148,000
アイ・アールジャパンホールディングス	800	1,853.00	1,482,400
K e e P e r 技研	1,200	4,180.00	5,016,000
ファーストロジック	300	862.00	258,600
三機サービス	300	908.00	272,400
G u n o s y	1,000	651.00	651,000

デザインワン・ジャパン	500	216.00	108,000
イー・ガーディアン	600	2,722.00	1,633,200
リブセンス	800	308.00	246,400
ジャパンマテリアル	4,900	2,395.00	11,735,500
ベクトル	2,500	1,394.00	3,485,000
ウチヤマホールディングス	700	279.00	195,300
チャーム・ケア・コーポレーション	1,300	1,234.00	1,604,200
キャリアリンク	600	3,105.00	1,863,000
I B J	1,000	936.00	936,000
アサンテ	800	1,604.00	1,283,200
バリューHR	1,400	1,635.00	2,289,000
M&Aキャピタルパートナーズ	1,500	4,635.00	6,952,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	1,103.00	661,800
ERIホールディングス	500	1,127.00	563,500
アビスト	300	2,939.00	881,700
シグマクシス・ホールディングス	2,400	1,436.00	3,446,400
ウィルグループ	1,300	1,268.00	1,648,400
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	1,700	153.00	260,100
メドピア	1,300	1,578.00	2,051,400
レアジョブ	300	989.00	296,700
リクルートホールディングス	118,300	4,321.00	511,174,300
エラン	2,100	993.00	2,085,300
土木管理総合試験所	700	312.00	218,400
日本郵政	209,400	1,070.00	224,058,000
ベルシステム24ホールディングス	2,100	1,366.00	2,868,600
鎌倉新書	1,800	1,024.00	1,843,200
SMN	400	492.00	196,800
一蔵	200	446.00	89,200
グローバルキッズCOMPANY	300	588.00	176,400
エアトリ	1,000	2,608.00	2,608,000
アトラエ	1,300	1,373.00	1,784,900
ストライク	800	4,760.00	3,808,000
ソラスト	4,400	753.00	3,313,200
セラク	600	1,238.00	742,800
インソース	2,000	2,905.00	5,810,000
バイカレント・コンサルティング	12,600	5,140.00	64,764,000

Orchestra Holdings	300	1,942.00	582,600
アイモバイル	800	1,182.00	945,600
キャリアインデックス	600	352.00	211,200
MS-Japan	500	999.00	499,500
船場	300	769.00	230,700
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,700	1,710.00	9,747,000
フルテック	200	1,241.00	248,200
グリーンズ	600	1,093.00	655,800
ツナググループ・ホールディングス	500	531.00	265,500
GameWith	500	370.00	185,000
MS&Consulting	200	628.00	125,600
ウェルビー	1,200	751.00	901,200
エル・ティー・エス	200	3,075.00	615,000
ミダックホールディングス	1,000	2,768.00	2,768,000
日総工産	1,200	587.00	704,400
キュービーネットホールディングス	800	1,363.00	1,090,400
RPAホールディングス	2,200	280.00	616,000
スプリックス	600	923.00	553,800
マネジメントソリューションズ	900	3,925.00	3,532,500
プロレド・パートナーズ	400	501.00	200,400
and factory	500	363.00	181,500
テノ.ホールディングス	200	537.00	107,400
フロンティア・マネジメント	500	1,353.00	676,500
ピアラ	300	650.00	195,000
コプロ・ホールディングス	300	1,019.00	305,700
ギークス	200	858.00	171,600
カーブスホールディングス	4,900	906.00	4,439,400
フォーラムエンジニアリング	900	870.00	783,000
Fast Fitness Japan	500	1,183.00	591,500
ダイレクトマーケティングミックス	1,800	1,480.00	2,664,000
ポピンズ	200	1,712.00	342,400
LITALICO	1,200	2,313.00	2,775,600
アドバンテッジリスクマネジメント	700	407.00	284,900
リログループ	8,900	2,239.00	19,927,100
東祥	1,100	1,124.00	1,236,400

ビーウィズ	500	1,122.00	561,000
TREホールディングス	3,400	1,511.00	5,137,400
人・夢・技術グループ	700	1,931.00	1,351,700
エイチ・アイ・エス	4,200	1,979.00	8,311,800
ラックランド	500	2,981.00	1,490,500
共立メンテナンス	2,700	5,850.00	15,795,000
イチネンホールディングス	1,700	1,282.00	2,179,400
建設技術研究所	800	3,425.00	2,740,000
スペース	1,100	908.00	998,800
燦ホールディングス	700	1,809.00	1,266,300
スバル興業	100	9,290.00	929,000
東京テアトル	600	1,140.00	684,000
タナベコンサルティンググループ	600	658.00	394,800
ナガワ	400	7,390.00	2,956,000
東京都競馬	1,300	3,810.00	4,953,000
常磐興産	600	1,212.00	727,200
カナモト	2,900	2,315.00	6,713,500
西尾レントオール	1,500	3,220.00	4,830,000
トランス・コスモス	2,000	3,275.00	6,550,000
乃村工藝社	7,000	947.00	6,629,000
藤田観光	700	2,898.00	2,028,600
KNT-CTホールディングス	1,000	1,620.00	1,620,000
日本管財	1,700	2,551.00	4,336,700
トーカイ	1,400	1,969.00	2,756,600
白洋舎	200	2,114.00	422,800
セコム	16,300	8,134.00	132,584,200
セントラル警備保障	900	2,344.00	2,109,600
丹青社	3,100	710.00	2,201,000
メイテック	6,400	2,491.00	15,942,400
応用地質	1,600	2,177.00	3,483,200
船井総研ホールディングス	3,400	2,755.00	9,367,000
進学会ホールディングス	500	302.00	151,000
オオバ	1,000	669.00	669,000
いであ	400	1,775.00	710,000
学究社	600	1,793.00	1,075,800
ベネッセホールディングス	6,000	1,994.00	11,964,000

イオンディライト	1,800	3,000.00	5,400,000	
ナック	700	938.00	656,600	
ダイセキ	3,300	4,455.00	14,701,500	
ステップ	600	1,820.00	1,092,000	
合 計	18,080,400		44,307,234,410	

(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6月15日現在	2022年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
預金	621,206,543	303,213,694
コール・ローン	1,599,829,970	1,743,162,589
株式	228,190,935,256	248,978,169,684
投資証券	5,633,395,197	5,871,568,844
派生商品評価勘定	90,712,645	34,156,145
未収入金	41,752,959	580,051
未収配当金	308,157,720	289,470,100
差入委託証拠金	474,982,389	2,006,859,583
流動資産合計	236,960,972,679	259,227,180,690
資産合計	236,960,972,679	259,227,180,690
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	158,808,027	42,961,073
未払金	7,760	3,237,100
未払解約金	40,386,287	22,573,274
未払利息	697	2,845
流動負債合計	199,202,771	68,774,292
負債合計	199,202,771	68,774,292
純資産の部		
元本等		
元本	59,803,606,565	60,264,747,727
剰余金		
剰余金又は欠損金(△)	176,958,163,343	198,893,658,671
元本等合計	236,761,769,908	259,158,406,398
純資産合計	236,761,769,908	259,158,406,398
負債純資産合計	236,960,972,679	259,227,180,690

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 6 月 15 日現在	2022 年 12 月 15 日現在
1.	期首	2021 年 12 月 16 日	2022 年 6 月 16 日
	期首元本額	62,271,175,728 円	59,803,606,565 円
	期首からの追加設定元本額	4,389,469,559 円	6,652,512,959 円
	期首からの一部解約元本額	6,857,038,722 円	6,191,371,797 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）	28,224,580,157 円	30,297,136,142 円
	DC インデックスバランス（株式 20）	117,650,029 円	117,948,562 円
	DC インデックスバランス（株式 40）	311,581,626 円	320,400,325 円
	DC インデックスバランス（株式 60）	622,227,394 円	643,489,107 円
	DC インデックスバランス（株式 80）	669,506,159 円	707,055,714 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	1,425,455,379 円	1,441,704,173 円
	日興五大陸株式ファンド	3,752,729,441 円	3,631,602,575 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）	14,764,881 円	14,003,581 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）	89,961,945 円	86,196,465 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）	5,911,056,803 円	5,918,140,127 円
	グローバル 3 倍 3 分法ファンド（適格機関投資家向け）	12,286,822,515 円	11,011,449,444 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 80）	3,481,865 円	— 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 60）	2,914,533 円	— 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 40）	3,518,782 円	— 円
	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 20）	3,188,755 円	— 円
	国際分散型ファンド 40（適格機関投資家向け）	1,962,413,877 円	1,752,322,548 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 20）	19,310,821 円	17,780,507 円

年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	53,473,246 円	50,821,739 円
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	80,281,654 円	77,405,650 円
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	78,497,020 円	76,875,596 円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,170,189,683 円	4,100,415,472 円
	計	59,803,606,565 円	60,264,747,727 円
2.	受益権の総数	59,803,606,565 口	60,264,747,727 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 12 月 16 日 至 2022 年 6 月 15 日	自 2022 年 6 月 16 日 至 2022 年 12 月 15 日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	2022 年 6 月 15 日現在	2022 年 12 月 15 日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、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 6 月 15 日現在）

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	△48,776,992,756
投資証券	△1,199,855,777
合計	△49,976,848,533

(2022年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	10,364,761,548
投資証券	453,574,765
合計	10,818,336,313

(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6月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,558,359,158	—	2,400,974,581	△157,384,577
合計		2,558,359,158	—	2,400,974,581	△157,384,577

(2022年12月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,236,961,880	—	4,260,917,849	23,955,969
合計		4,236,961,880	—	4,260,917,849	23,955,969

(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6月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,916,698,840	—	2,007,407,390	90,708,550
	米ドル	1,602,382,860	—	1,683,450,800	81,067,940
	ユーロ	314,315,980	—	323,956,590	9,640,610
	売建	519,195,500	—	520,614,855	△1,419,355
	米ドル	498,071,000	—	499,494,450	△1,423,450
	ユーロ	21,124,500	—	21,120,405	4,095
合計		2,435,894,340	—	2,528,022,245	89,289,195

(2022年12月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,967,071,862	—	1,934,310,965	△32,760,897
	米ドル	1,430,539,070	—	1,400,122,120	△30,416,950
	ユーロ	536,532,792	—	534,188,845	△2,343,947
合計		1,967,071,862	—	1,934,310,965	△32,760,897

(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6月15日現在		2022年12月15日現在	
1口当たり純資産額	3.9590円	1口当たり純資産額	4.3003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	45.04	574,260.00	
	BAKER HUGHES CO	38,325	28.98	1,110,658.50	
	CHENIERE ENERGY INC	8,900	163.20	1,452,480.00	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	3,750	99.16	371,850.00	
	CHEVRON CORP	71,841	172.33	12,380,359.53	
	CONOCOPHILLIPS	49,666	112.87	5,605,801.42	
	COTERRA ENERGY INC	30,170	24.70	745,199.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	24,180	61.92	1,497,225.60	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	6,540	136.84	894,933.60	
	EOG RESOURCES INC	22,542	125.93	2,838,714.06	
	EQT CORP	12,660	37.81	478,674.60	
	EXXON MOBIL CORP	160,701	106.46	17,108,228.46	
	HALLIBURTON CO	34,567	36.55	1,263,423.85	
	HESS CORP	10,740	136.16	1,462,358.40	
	HF SINCLAIR CORP	5,940	50.63	300,742.20	
	KINDER MORGAN INC	75,410	18.11	1,365,675.10	
	MARATHON OIL CORP	28,380	27.47	779,598.60	
	MARATHON PETROLEUM CORP	19,732	110.94	2,189,068.08	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	36,121	63.68	2,300,185.28	
	ONEOK INC	16,840	66.59	1,121,375.60	
	OVINTIV INC	9,400	50.16	471,504.00	
	PHILLIPS 66	18,125	101.28	1,835,700.00	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,740	225.12	1,967,548.80	
	SCHLUMBERGER LTD	54,441	50.43	2,745,459.63	
	TARGA RESOURCES CORP	8,180	73.27	599,348.60	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	245	2,592.06	635,054.70	
VALERO ENERGY CORP	15,292	119.73	1,830,911.16		
WILLIAMS COS INC	45,994	33.72	1,550,917.68		
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8,495	325.12	2,761,894.40		
ALBEMARLE CORP	4,460	247.86	1,105,455.60		

ALCOA CORP	6,700	45.50	304,850.00
AMCOR PLC	54,600	12.48	681,408.00
AVERY DENNISON CORP	3,040	181.85	552,824.00
BALL CORP	12,500	54.46	680,750.00
CELANESE CORP	4,090	105.98	433,458.20
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,820	93.00	727,260.00
CLEVELAND-CLIFFS INC	21,150	15.66	331,209.00
CORTEVA INC	28,172	61.70	1,738,212.40
CROWN HOLDINGS INC	4,565	83.51	381,223.15
DOW INC	28,025	51.36	1,439,364.00
DUPONT DE NEMOURS INC	19,162	69.64	1,334,441.68
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,815	86.33	415,678.95
ECOLAB INC	9,820	150.44	1,477,320.80
FMC CORP	4,840	126.79	613,663.60
FREEMONT-MCMORAN INC	56,338	39.43	2,221,407.34
INTERNATIONAL PAPER CO	13,670	37.10	507,157.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,645	105.63	1,018,801.35
LINDE PLC	19,370	342.01	6,624,733.70
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,570	83.68	884,497.60
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,360	365.70	863,052.00
MOSAIC CO/THE	13,580	45.41	616,667.80
NEWMONT CORP	30,452	47.11	1,434,593.72
NUCOR CORP	9,989	147.93	1,477,672.77
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	135.33	484,481.40
PPG INDUSTRIES INC	8,774	132.77	1,164,923.98
RPM INTERNATIONAL INC	4,960	101.66	504,233.60
SEALED AIR CORP	5,746	52.61	302,297.06
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,426	248.68	2,344,057.68
STEEL DYNAMICS INC	7,140	108.66	775,832.40
VULCAN MATERIALS CO	5,563	184.60	1,026,929.80
WESTLAKE CORP	1,360	110.17	149,831.20
WESTROCK CO	9,989	36.78	367,395.42
3M CO	21,306	126.09	2,686,473.54
AERCAP HOLDINGS NV	5,620	59.19	332,647.80
ALLEGION PLC	3,340	109.77	366,631.80
AMETEK INC	9,033	141.75	1,280,427.75

BOEING CO/THE	21,872	188.25	4,117,404.00	
CARLISLE COS INC	2,250	249.32	560,970.00	
CARRIER GLOBAL CORP	32,338	43.80	1,416,404.40	
CATERPILLAR INC	20,496	234.48	4,805,902.08	
CUMMINS INC	5,535	241.84	1,338,584.40	
DEERE & CO	11,220	438.44	4,919,296.80	
DOVER CORP	5,350	140.70	752,745.00	
EATON CORP PLC	15,546	161.36	2,508,502.56	
EMERSON ELECTRIC CO	22,490	97.72	2,197,722.80	
FASTENAL CO	21,616	49.58	1,071,721.28	
FERGUSON PLC	7,900	131.57	1,039,403.00	
FORTIVE CORP	13,454	66.86	899,534.44	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,050	61.90	312,595.00	
GENERAC HOLDINGS INC	2,440	101.15	246,806.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	9,397	249.02	2,340,040.94	
GENERAL ELECTRIC CO	42,827	81.47	3,489,115.69	
HEICO CORP	1,800	156.61	281,898.00	
HEICO CORP-CLASS A	3,120	123.40	385,008.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	26,246	214.72	5,635,541.12	
HOWMET AEROSPACE INC	14,463	39.00	564,057.00	
HUBBELL INC	1,980	248.86	492,742.80	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,530	233.38	357,071.40	
IDEX CORP	2,880	238.54	686,995.20	
ILLINOIS TOOL WORKS	12,005	224.22	2,691,761.10	
INGERSOLL-RAND INC	15,158	54.73	829,597.34	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,570	51.47	338,157.90	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	27,484	66.55	1,829,060.20	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,220	218.04	1,574,248.80	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,385	258.75	358,368.75	
LOCKHEED MARTIN CORP	9,256	485.19	4,490,918.64	
MASCO CORP	9,849	50.14	493,828.86	
NORDSON CORP	2,345	235.91	553,208.95	
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,689	531.78	3,025,296.42	
OTIS WORLDWIDE CORP	15,644	80.25	1,255,431.00	
OWENS CORNING	3,550	93.85	333,167.50	
PACCAR INC	12,924	102.76	1,328,070.24	

PARKER HANNIFIN CORP	4,775	296.99	1,418,127.25
PENTAIR PLC	6,918	45.84	317,121.12
PLUG POWER INC	19,280	15.21	293,248.80
QUANTA SERVICES INC	5,710	152.09	868,433.90
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	57,106	99.95	5,707,744.70
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,303	269.17	1,158,238.51
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,420	42.94	275,674.80
SMITH (A.O.) CORP	5,020	58.88	295,577.60
SNAP-ON INC	1,975	233.00	460,175.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,806	81.28	471,911.68
TEXTRON INC	7,956	72.02	572,991.12
TRANE TECHNOLOGIES PLC	8,866	176.54	1,565,203.64
TRANSDIGM GROUP INC	1,985	628.01	1,246,599.85
UNITED RENTALS INC	2,805	368.14	1,032,632.70
WABTEC CORP	6,470	103.41	669,062.70
WW GRAINGER INC	1,667	576.02	960,225.34
XYLEM INC	7,048	114.75	808,758.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,070	105.80	536,406.00
CINTAS CORP	3,592	459.28	1,649,733.76
CLARIVATE PLC	10,850	9.03	97,975.50
COPART INC	16,860	62.47	1,053,244.20
COSTAR GROUP INC	14,910	81.26	1,211,586.60
EQUIFAX INC	4,764	202.95	966,853.80
JACOBS SOLUTIONS INC	4,880	122.57	598,141.60
LEIDOS HOLDINGS INC	4,960	106.80	529,728.00
REPUBLIC SERVICES INC	8,130	135.93	1,105,110.90
ROBERT HALF INTL INC	4,415	75.59	333,729.85
ROLLINS INC	8,265	38.13	315,144.45
TRANSUNION	7,270	62.38	453,502.60
VERISK ANALYTICS INC	5,800	182.97	1,061,226.00
WASTE CONNECTIONS INC	9,566	140.48	1,343,831.68
WASTE MANAGEMENT INC	16,004	166.54	2,665,306.16
AMERCO-NON VOTING	3,375	58.03	195,851.25
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,930	96.21	474,315.30
CSX CORP	83,039	32.67	2,712,884.13
DELTA AIR LINES INC	5,515	34.31	189,219.65

EXPEDITORS INTL WASH INC	6,467	112.79	729,412.93
FEDEX CORP	9,448	178.07	1,682,405.36
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	51,400	3.31	170,134.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,140	187.27	588,027.80
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,140	57.24	351,453.60
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,305	258.42	2,404,598.10
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,655	309.40	1,130,857.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	38.14	208,625.80
UBER TECHNOLOGIES INC	58,440	27.47	1,605,346.80
UNION PACIFIC CORP	24,141	217.58	5,252,598.78
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	28,487	184.31	5,250,438.97
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	2,920	17.86	52,151.20
APTIV PLC	10,450	96.60	1,009,470.00
BORGWARNER INC	9,120	41.16	375,379.20
FORD MOTOR COMPANY	150,375	13.48	2,027,055.00
GENERAL MOTORS CORP	52,975	38.36	2,032,121.00
LEAR CORP	2,290	129.62	296,829.80
LUCID GROUP INC	16,510	7.68	126,796.80
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	13,410	24.54	329,081.40
TESLA INC	102,905	156.80	16,135,504.00
DR HORTON INC	12,896	87.40	1,127,110.40
GARMIN LTD	5,865	95.79	561,808.35
HASBRO INC	5,188	59.96	311,072.48
LENNAR CORP-CL A	10,040	90.82	911,832.80
LULULEMON ATHLETICA INC	4,460	333.33	1,486,651.80
MOHAWK INDUSTRIES INC	1,878	101.94	191,443.32
NEWELL BRANDS INC	14,666	13.66	200,337.56
NIKE INC -CL B	48,938	111.45	5,454,140.10
NVR INC	118	4,746.65	560,104.70
PULTE GROUP INC	8,850	46.33	410,020.50
VF CORP	12,170	28.04	341,246.80
WHIRLPOOL CORP	2,079	146.00	303,534.00
AIRBNB INC-CLASS A	14,330	93.93	1,346,016.90
ARAMARK	8,880	42.65	378,732.00
BOOKING HOLDINGS INC	1,553	2,006.80	3,116,560.40
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,970	49.69	396,029.30

CARNIVAL CORP	38,787	8.93	346,367.91
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,065	1,538.29	1,638,278.85
DARDEN RESTAURANTS INC	4,853	143.95	698,589.35
DOMINO'S PIZZA INC	1,375	366.74	504,267.50
EXPEDIA GROUP INC	6,032	92.79	559,709.28
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,650	136.05	1,448,932.50
LAS VEGAS SANDS CORP	12,900	48.75	628,875.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,673	159.33	1,700,529.09
MCDONALD'S CORP	28,631	274.53	7,860,068.43
MGM RESORTS INTERNATIONAL	12,900	36.93	476,397.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,748	55.28	483,589.44
STARBUCKS CORP	44,554	102.19	4,552,973.26
VAIL RESORTS INC	1,520	262.12	398,422.40
WYNN RESORTS LTD	4,180	86.32	360,817.60
YUM! BRANDS INC	10,554	131.22	1,384,895.88
ACTIVISION BLIZZARD INC	30,360	77.04	2,338,934.40
ALPHABET INC-CL A	231,650	95.07	22,022,965.50
ALPHABET INC-CL C	214,290	95.31	20,423,979.90
CHARTER COMMUNICATION-A	4,476	328.34	1,469,649.84
COMCAST CORP-CLASS A	171,394	35.35	6,058,777.90
DISH NETWORK CORP-A	9,279	15.74	146,051.46
ELECTRONIC ARTS INC	10,834	124.66	1,350,566.44
FOX CORP - CLASS A	13,084	31.80	416,071.20
FOX CORP- CLASS B	5,466	29.77	162,722.82
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,096	33.45	504,961.20
LIBERTY BROADBAND-C	4,850	77.03	373,595.50
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	3,325	40.97	136,225.25
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	5,726	40.81	233,678.06
LIBERTY MEDIA COR-LIBERTY-C	7,780	60.45	470,301.00
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,420	73.09	469,237.80
MATCH GROUP INC	10,912	44.56	486,238.72
META PLATFORMS INC-CLASS A	88,110	121.59	10,713,294.90
NETFLIX INC	17,155	317.83	5,452,373.65
NEWS CORP - CLASS A	14,750	18.68	275,530.00
OMNICOM GROUP	7,807	80.89	631,508.23
PARAMOUNT GLOBAL	22,823	19.36	441,853.28

PINTEREST INC- CLASS A	22,100	26.22	579,462.00
ROBLOX CORP -CLASS A	13,390	33.13	443,610.70
ROKU INC	4,700	50.50	237,350.00
SEA LTD-ADR	14,470	64.98	940,260.60
SIRIUS XM HOLDINGS INC	30,280	6.12	185,313.60
SNAP INC - A	45,300	9.54	432,162.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	6,370	104.81	667,639.70
THE WALT DISNEY CO.	70,512	94.15	6,638,704.80
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	17,500	50.94	891,450.00
WARNER BROS DISCOVERY INC	86,760	10.98	952,624.80
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	9,840	31.36	308,582.40
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,328	143.46	333,974.88
AMAZON.COM INC	354,230	91.58	32,440,383.40
AUTOZONE INC	747	2,360.47	1,763,271.09
BATH & BODY WORKS INC	9,270	42.22	391,379.40
BEST BUY CO INC	7,814	80.82	631,527.48
BURLINGTON STORES INC	2,585	196.17	507,099.45
CARMAX INC	5,949	67.71	402,806.79
CHEWY INC - CLASS A	3,410	42.85	146,118.50
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	8,725	247.48	2,159,263.00
DOLLAR TREE INC	8,466	146.50	1,240,269.00
DOORDASH INC - A	9,130	58.50	534,105.00
EBAY INC	21,897	43.75	957,993.75
ETSY INC	4,800	132.03	633,744.00
GENUINE PARTS CO	5,321	179.08	952,884.68
HOME DEPOT INC	39,720	333.43	13,243,839.60
LKQ CORP	10,260	53.80	551,988.00
LOWE'S COS INC	24,412	212.11	5,178,029.32
MERCADOLIBRE INC	1,730	867.30	1,500,429.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,450	814.50	1,995,525.00
POOL CORP	1,540	334.81	515,607.40
ROSS STORES INC	13,442	117.42	1,578,359.64
TARGET CORP	17,860	152.51	2,723,828.60
TJX COMPANIES INC	45,076	79.29	3,574,076.04
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,230	215.32	910,803.60
ULTA BEAUTY INC	1,970	462.85	911,814.50

COSTCO WHOLESALE CORP	17,114	483.52	8,274,961.28
KROGER CO	25,910	44.76	1,159,731.60
SYSCO CORP	19,236	82.14	1,580,045.04
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	27,082	40.63	1,100,341.66
WALMART INC	58,062	146.67	8,515,953.54
ALTRIA GROUP INC	69,698	47.13	3,284,866.74
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	21,453	92.80	1,990,838.40
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,680	68.94	805,219.20
BUNGE LTD	5,847	96.23	562,656.81
CAMPBELL SOUP CO	7,885	57.00	449,445.00
COCA-COLA CO/THE	159,292	63.99	10,193,095.08
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	7,710	54.95	423,664.50
CONAGRA BRANDS INC	18,040	38.48	694,179.20
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,270	239.55	1,501,978.50
DARLING INGREDIENTS INC	5,880	62.08	365,030.40
GENERAL MILLS INC	23,059	87.33	2,013,742.47
HERSHEY CO/THE	5,395	236.01	1,273,273.95
HORMEL FOODS CORP	11,500	46.51	534,865.00
JM SMUCKER CO/THE	4,100	154.17	632,097.00
KELLOGG CO	9,818	73.72	723,782.96
KEURIG DR PEPPER INC	30,620	37.34	1,143,350.80
KRAFT HEINZ CO/THE	28,131	40.16	1,129,740.96
LAMB WESTON HOLDING INC	5,290	87.08	460,653.20
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,420	86.27	898,933.40
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,570	52.89	400,377.30
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	53,245	67.26	3,581,258.70
MONSTER BEVERAGE CORP	14,810	101.90	1,509,139.00
PEPSICO INC	53,491	183.36	9,808,109.76
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	60,098	102.46	6,157,641.08
TYSON FOODS INC-CL A	10,906	64.35	701,801.10
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,310	82.21	847,585.10
CLOROX COMPANY	4,646	148.26	688,815.96
COLGATE-PALMOLIVE CO	30,440	79.34	2,415,109.60
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,790	249.22	2,190,643.80
KIMBERLY-CLARK CORP	13,663	139.10	1,900,523.30
PROCTER & GAMBLE CO	92,369	152.84	14,117,677.96

ABBOTT LABORATORIES	67,826	111.26	7,546,320.76
ABIOMED INC	1,870	380.11	710,805.70
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,840	195.81	556,100.40
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,054	165.27	1,000,544.58
BAXTER INTERNATIONAL INC	19,439	52.30	1,016,659.70
BECTON DICKINSON AND CO	10,992	254.04	2,792,407.68
BOSTON SCIENTIFIC CORP	55,168	47.18	2,602,826.24
CARDINAL HEALTH INC	10,305	78.55	809,457.75
CENTENE CORP	22,367	83.00	1,856,461.00
CIGNA CORP	12,200	334.68	4,083,096.00
COOPER COS INC/THE	2,025	324.86	657,841.50
CVS HEALTH CORP	50,718	100.68	5,106,288.24
DAVITA INC	2,108	74.71	157,488.68
DENTSPLY SIRONA INC	8,222	32.05	263,515.10
DEXCOM INC	15,030	121.49	1,825,994.70
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	24,120	75.82	1,828,778.40
ELEVANCE HEALTH INC	9,216	520.15	4,793,702.40
HCA HEALTHCARE INC	8,830	244.70	2,160,701.00
HENRY SCHEIN INC	5,280	83.17	439,137.60
HOLOGIC INC	10,508	75.89	797,452.12
HUMANA INC	4,875	521.51	2,542,361.25
IDEXX LABORATORIES INC	3,230	430.03	1,388,996.90
INSULET CORP	2,745	311.85	856,028.25
INTUITIVE SURGICAL INC	13,805	280.65	3,874,373.25
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,415	230.62	787,567.30
MASIMO CORP	2,020	145.00	292,900.00
MCKESSON CORP	5,449	372.31	2,028,717.19
MEDTRONIC PLC	51,448	78.79	4,053,587.92
MOLINA HEALTHCARE INC	2,145	349.51	749,698.95
NOVOCURE LTD	3,430	76.16	261,228.80
QUEST DIAGNOSTICS	4,386	151.11	662,768.46
RESMED INC	5,380	220.86	1,188,226.80
STERIS PLC	4,240	193.72	821,372.80
STRYKER CORP	13,273	253.82	3,368,952.86
TELEFLEX INC	1,760	253.28	445,772.80
UNITEDHEALTH GROUP INC	36,200	538.36	19,488,632.00

UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,890	130.83	378,098.70
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	5,370	176.27	946,569.90
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,642	128.24	980,010.08
ABBVIE INC	68,346	164.86	11,267,521.56
AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,510	154.81	1,781,863.10
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,720	233.91	1,104,055.20
AMGEN INC	20,706	271.13	5,614,017.78
AVANTOR INC	27,110	21.17	573,918.70
BIO-RAD LABORATORIES-A	860	429.90	369,714.00
BIO-TECHNE CORP	5,920	86.81	513,915.20
BIOGEN INC	5,543	289.05	1,602,204.15
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,140	108.38	773,833.20
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	82,495	77.14	6,363,664.30
CATALENT INC	6,520	46.26	301,615.20
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,910	214.33	409,370.30
DANAHER CORP	26,749	274.23	7,335,378.27
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	16,526	12.80	211,532.80
ELI LILLY & CO	31,169	363.50	11,329,931.50
EXACT SCIENCES CORP	6,510	45.54	296,465.40
GILEAD SCIENCES INC	48,504	88.40	4,287,753.60
HORIZON THERAPEUTICS PLC	8,450	113.13	955,948.50
ILLUMINA INC	5,915	209.98	1,242,031.70
INCYTE CORP	7,110	82.67	587,783.70
IQVIA HOLDINGS INC	7,008	214.21	1,501,183.68
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,450	157.50	385,875.00
JOHNSON & JOHNSON	101,691	179.76	18,279,974.16
MERCK & CO. INC.	97,873	111.55	10,917,733.15
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	835	1,474.76	1,231,424.60
MODERNA INC	12,875	208.95	2,690,231.25
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,630	119.24	432,841.20
PERKINELMER INC	4,910	143.71	705,616.10
PFIZER INC	216,830	54.48	11,812,898.40
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,150	750.00	3,112,500.00
REPLIGEN CORP	2,250	177.42	399,195.00
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	13,010	41.46	539,394.60
SEAGEN INC	5,320	132.05	702,506.00

TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	43,590	9.26	403,643.40
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	15,144	567.23	8,590,131.12
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,845	312.09	3,072,526.05
VIATRIS INC	45,819	11.32	518,671.08
WATERS CORP	2,331	343.97	801,794.07
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,780	243.58	677,152.40
ZOETIS INC	18,135	151.78	2,752,530.30
BANK OF AMERICA CORP	280,229	32.28	9,045,792.12
CITIGROUP INC	74,847	45.98	3,441,465.06
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,310	39.06	754,248.60
FIFTH THIRD BANCORP	25,549	32.29	824,977.21
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	450	744.82	335,169.00
FIRST HORIZON CORP	19,800	24.42	483,516.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,750	122.98	830,115.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	53,720	13.93	748,319.60
JPMORGAN CHASE & CO	113,400	133.41	15,128,694.00
KEYCORP	34,648	17.09	592,134.32
M & T BANK CORP	6,913	143.79	994,020.27
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	15,940	149.62	2,384,942.80
REGIONS FINANCIAL CORP	35,164	21.12	742,663.68
SIGNATURE BANK	2,390	116.65	278,793.50
SVB FINANCIAL GROUP	2,375	230.57	547,603.75
TRUIST FINANCIAL CORP	51,660	42.22	2,181,085.20
US BANCORP	54,561	43.29	2,361,945.69
WEBSTER FINANCIAL CORP	6,370	45.17	287,732.90
WELLS FARGO & CO	146,790	42.18	6,191,602.20
ALLY FINANCIAL INC	12,240	25.48	311,875.20
AMERICAN EXPRESS CO	24,894	154.11	3,836,414.34
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,225	321.93	1,360,154.25
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	15,800	66.08	1,044,064.00
ARES MANAGEMENT CORP-A	5,690	72.46	412,297.40
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	29,472	44.94	1,324,471.68
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	50,265	309.29	15,546,461.85
BLACKROCK INC	5,820	711.52	4,141,046.40
BLACKSTONE INC	26,850	80.60	2,164,110.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15,435	96.60	1,491,021.00

CARLYLE GROUP INC/THE	7,650	30.32	231,948.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,940	121.68	479,419.20
CME GROUP INC	13,930	174.92	2,436,635.60
COINBASE GLOBAL INC –CLASS A	4,730	40.19	190,098.70
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,750	103.45	1,112,087.50
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,420	29.92	431,446.40
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,400	449.30	629,020.00
FRANKLIN RESOURCES INC	11,755	27.10	318,560.50
FUTU HOLDINGS LTD–ADR	2,500	70.33	175,825.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,193	360.38	4,754,493.34
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	21,690	103.93	2,254,241.70
INVESCO LTD	13,527	19.52	264,047.04
KKR & CO INC –A	21,790	49.35	1,075,336.50
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,005	214.45	644,422.25
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,420	285.53	405,452.60
MOODY' S CORP	6,502	297.62	1,935,125.24
MORGAN STANLEY	50,143	90.50	4,537,941.50
MSCI INC	3,120	498.48	1,555,257.60
NASDAQ INC	12,955	63.59	823,808.45
NORTHERN TRUST CORP	7,690	88.24	678,565.60
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	7,010	110.28	773,062.80
S&P GLOBAL INC	13,265	353.84	4,693,687.60
SCHWAB (CHARLES) CORP	56,443	77.32	4,364,172.76
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,175	60.78	253,756.50
STATE STREET CORP	14,137	79.89	1,129,404.93
SYNCHRONY FINANCIAL	19,010	34.35	652,993.50
T ROWE PRICE GROUP INC	8,675	118.58	1,028,681.50
TRADEWEB MARKETS INC–CLASS A	4,200	64.21	269,682.00
AFLAC INC	23,424	70.39	1,648,815.36
ALLSTATE CORP	10,513	129.90	1,365,638.70
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,660	135.00	359,100.00
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	30,345	62.66	1,901,417.70
AON PLC	8,362	306.14	2,559,942.68
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,535	60.32	876,751.20
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,940	193.11	1,533,293.40
ASSURANT INC	1,960	125.64	246,254.40

BROWN & BROWN INC	9,090	58.17	528,765.30
CHUBB LTD	16,395	216.82	3,554,763.90
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,880	106.41	625,690.80
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	940	271.00	254,740.00
EVEREST RE GROUP LTD	1,469	325.39	477,997.91
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	11,071	37.99	420,587.29
GLOBE LIFE INC	3,586	118.08	423,434.88
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,382	75.21	931,250.22
LINCOLN NATIONAL CORP	6,453	32.38	208,948.14
LOEWS CORP	7,105	56.25	399,656.25
MARKEL CORP	500	1,292.35	646,175.00
MARSH & MCLENNAN COS	19,443	172.37	3,351,389.91
METLIFE INC	26,335	72.84	1,918,241.40
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,520	88.17	839,378.40
PROGRESSIVE CORP	22,820	126.58	2,888,555.60
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	13,972	102.07	1,426,122.04
TRAVELERS COS INC/THE	8,889	186.64	1,659,042.96
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,198	245.63	1,031,154.74
WR BERKLEY CORP	8,091	72.99	590,562.09
CBRE GROUP INC - A	12,560	79.41	997,389.60
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,500	4.63	187,515.00
ZILLOW GROUP INC - C	6,370	37.95	241,741.50
ACCENTURE PLC-CL A	24,438	291.45	7,122,455.10
ADOBE INC	18,114	339.92	6,157,310.88
AFFIRM HOLDINGS INC	6,670	11.30	75,371.00
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,030	88.84	535,705.20
ANSYS INC	3,295	256.10	843,849.50
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,300	211.65	275,145.00
AUTODESK INC	8,380	200.06	1,676,502.80
AUTOMATIC DATA PROCESSING	16,146	260.08	4,199,251.68
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,530	39.37	296,456.10
BILL.COM HOLDINGS INC	3,630	123.86	449,611.80
BLACK KNIGHT INC	5,860	60.52	354,647.20
BLOCK INC	20,790	71.25	1,481,287.50
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4,400	140.85	619,740.00
CADENCE DESIGN SYS INC	10,570	165.47	1,749,017.90

CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,280	69.15	365,112.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,840	133.12	511,180.80
CLOUDFLARE INC-CLASS A	9,750	52.32	510,120.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	20,318	58.23	1,183,117.14
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	7,760	120.57	935,623.20
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,650	140.95	232,567.50
DATADOG INC-CLASS A	9,910	80.48	797,556.80
DOCUSIGN INC	7,480	59.55	445,434.00
DROPBOX INC-CLASS A	11,660	23.73	276,691.80
DYNATRACE INC	7,560	40.81	308,523.60
EPAM SYSTEMS INC	2,280	354.83	809,012.40
FAIR ISAAC CORP	970	606.68	588,479.60
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	22,978	72.41	1,663,836.98
FISERV INC	23,644	101.91	2,409,560.04
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,880	190.90	549,792.00
FORTINET INC	26,095	54.27	1,416,175.65
GARTNER INC	3,050	347.25	1,059,112.50
GEN DIGITAL INC	24,365	22.99	560,151.35
GLOBAL PAYMENTS INC	10,989	97.73	1,073,954.97
GODADDY INC-CLASS A	6,020	76.65	461,433.00
HUBSPOT INC	1,725	313.55	540,873.75
INTL BUSINESS MACHINES CORP	34,892	149.86	5,228,915.12
INTUIT INC	10,301	418.92	4,315,294.92
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,200	180.59	577,888.00
MASTERCARD INC	33,300	357.51	11,905,083.00
MICROSOFT CORP	273,724	257.22	70,407,287.28
MONGODB INC	2,520	210.65	530,838.00
OKTA INC	5,670	70.91	402,059.70
ORACLE CORP	62,053	81.82	5,077,176.46
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	68,020	7.35	499,947.00
PALO ALTO NETWORKS INC	11,715	160.23	1,877,094.45
PAYCHEX INC	12,032	122.67	1,475,965.44
PAYCOM SOFTWARE INC	1,945	327.72	637,415.40
PAYLOCITY HOLDING CORP	1,500	209.86	314,790.00
PAYPAL HOLDINGS INC	42,177	72.63	3,063,315.51
PTC INC	4,160	127.30	529,568.00

ROPER TECHNOLOGIES INC	4,200	438.79	1,842,918.00
SALESFORCE INC	38,566	134.75	5,196,768.50
SERVICENOW INC	7,765	418.39	3,248,798.35
SNOWFLAKE INC-CLASS A	8,490	149.20	1,266,708.00
SPLUNK INC	6,120	91.60	560,592.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	52.68	446,199.60
SYNOPSYS INC	6,012	332.03	1,996,164.36
TOAST INC-CLASS A	10,580	19.77	209,166.60
TWILIO INC - A	6,435	51.03	328,378.05
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,570	334.61	525,337.70
UNITY SOFTWARE INC	9,650	32.53	313,914.50
VERISIGN INC	3,690	200.86	741,173.40
VISA INC-CLASS A SHARES	63,322	213.32	13,507,849.04
VMWARE INC-CLASS A	7,697	124.55	958,661.35
WESTERN UNION CO	14,561	14.11	205,455.71
WIX.COM LTD	2,280	84.79	193,321.20
WORKDAY INC-CLASS A	7,680	179.29	1,376,947.20
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	8,530	73.22	624,566.60
ZSCALER INC	3,190	123.14	392,816.60
AMPHENOL CORP-CL A	22,940	81.72	1,874,656.80
APPLE INC	621,044	143.21	88,939,711.24
ARISTA NETWORKS INC	9,330	130.99	1,222,136.70
ARROW ELECTRONICS INC	2,520	109.28	275,385.60
CDW CORP/DE	5,195	192.03	997,595.85
CISCO SYSTEMS INC	160,090	49.30	7,892,437.00
COGNEX CORP	6,480	51.54	333,979.20
CORNING INC	30,998	33.73	1,045,562.54
DELL TECHNOLOGIES -C	11,022	41.68	459,396.96
F5 INC	2,385	152.07	362,686.95
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	50,105	16.20	811,701.00
HP INC	40,475	28.36	1,147,871.00
JUNIPER NETWORKS INC	11,943	33.08	395,074.44
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,760	182.98	1,236,944.80
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,610	265.83	1,757,136.30
NETAPP INC	8,246	64.39	530,959.94
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,794	54.75	426,721.50

TE CONNECTIVITY LTD	11,995	124.25	1,490,378.75
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,750	421.07	736,872.50
TRIMBLE INC	9,520	54.56	519,411.20
WESTERN DIGITAL CORP	11,818	35.83	423,438.94
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,075	261.50	542,612.50
AT&T INC	277,717	18.90	5,248,851.30
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,435	18.98	103,156.30
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	12,791	19.50	249,424.50
LUMEN TECHNOLOGIES INC	34,386	5.77	198,407.22
T-MOBILE US INC	24,389	142.36	3,472,018.04
VERIZON COMMUNICATIONS INC	162,557	37.45	6,087,759.65
AES CORP	25,138	29.24	735,035.12
ALLIANT ENERGY CORP	9,590	56.05	537,519.50
AMEREN CORPORATION	10,152	89.79	911,548.08
AMERICAN ELECTRIC POWER	19,778	98.49	1,947,935.22
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,085	158.35	1,121,909.75
ATMOS ENERGY CORP	5,310	118.34	628,385.40
CENTERPOINT ENERGY INC	23,972	30.95	741,933.40
CMS ENERGY CORP	11,090	63.76	707,098.40
CONSOLIDATED EDISON INC	13,356	98.44	1,314,764.64
CONSTELLATION ENERGY	12,258	90.85	1,113,639.30
DOMINION ENERGY INC	30,991	59.27	1,836,836.57
DTE ENERGY COMPANY	7,188	120.60	866,872.80
DUKE ENERGY CORP	30,036	103.30	3,102,718.80
EDISON INTERNATIONAL	14,439	67.65	976,798.35
ENTERGY CORP	7,967	118.44	943,611.48
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,210	48.74	546,375.40
EVERGY INC	8,720	63.05	549,796.00
EVERSOURCE ENERGY	12,680	85.85	1,088,578.00
EXELON CORP	37,926	42.82	1,623,991.32
FIRSTENERGY CORP	20,205	42.34	855,479.70
NEXTERA ENERGY INC	76,110	87.05	6,625,375.50
NISOURCE INC	15,610	27.82	434,270.20
NRG ENERGY INC	8,760	32.47	284,437.20
P G & E CORP	57,990	16.40	951,036.00
PPL CORP	30,338	29.42	892,543.96

	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	18,748	61.18	1,147,002.64	
	SEMPRA ENERGY	11,762	163.75	1,926,027.50	
	SOUTHERN CO	40,555	71.11	2,883,866.05	
	UGI CORP	8,500	38.84	330,140.00	
	VISTRA CORP	14,720	24.35	358,432.00	
	WEC ENERGY GROUP INC	11,770	97.72	1,150,164.40	
	XCEL ENERGY INC	20,304	71.25	1,446,660.00	
	ADVANCED MICRO DEVICES	61,584	68.93	4,244,985.12	
	ANALOG DEVICES INC	20,007	171.68	3,434,801.76	
	APPLIED MATERIALS INC	33,073	109.64	3,626,123.72	
	BROADCOM INC	15,625	574.44	8,975,625.00	
	ENPHASE ENERGY INC	5,170	332.80	1,720,576.00	
	ENTEGRIS INC	5,660	73.09	413,689.40	
	FIRST SOLAR INC	3,910	160.09	625,951.90	
	INTEL CORP	158,632	28.26	4,482,940.32	
	KLA CORP	5,704	406.21	2,317,021.84	
	LAM RESEARCH CORP	5,272	468.24	2,468,561.28	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	33,394	42.65	1,424,254.10	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	21,258	76.11	1,617,946.38	
	MICRON TECHNOLOGY INC	42,927	54.59	2,343,384.93	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,705	395.39	674,139.95	
	NVIDIA CORP	96,200	176.74	17,002,388.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	10,447	171.57	1,792,391.79	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	16,540	67.59	1,117,938.60	
	QORVO INC	4,240	100.94	427,985.60	
	QUALCOMM INC	43,242	121.71	5,262,983.82	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,440	97.06	625,066.40	
	SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	2,120	335.61	711,493.20	
	TERADYNE INC	6,190	94.15	582,788.50	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	35,402	175.82	6,224,379.64	
	WOLFSPEED INC	5,080	81.22	412,597.60	
米ドル小計		13,140,497		1,333,349,416.46 (180,642,178,942)	
加ドル	ARC RESOURCES LTD	25,510	18.18	463,771.80	
	CAMECO CORP	16,352	30.00	490,560.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	44,054	75.88	3,342,817.52	

CENOVUS ENERGY INC	53,603	25.05	1,342,755.15
ENBRIDGE INC	78,977	53.83	4,251,331.91
IMPERIAL OIL LTD	8,922	65.89	587,870.58
KEYERA CORP	8,460	29.38	248,554.80
PARKLAND CORP	6,170	31.12	192,010.40
PEMBINA PIPELINE CORP	23,552	46.56	1,096,581.12
SUNCOR ENERGY INC	53,489	42.18	2,256,166.02
TC ENERGY CORP	36,643	57.40	2,103,308.20
TOURMALINE OIL CORP	12,040	73.77	888,190.80
AGNICO EAGLE MINES LTD	16,806	71.30	1,198,267.80
BARRICK GOLD CORP	69,624	23.59	1,642,430.16
CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	59.22	340,515.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	32.33	732,274.50
FRANCO-NEVADA CORP	7,175	194.84	1,397,977.00
IVANHOE MINES LTD-CL A	24,510	12.28	300,982.80
KINROSS GOLD CORP	46,025	5.79	266,484.75
LUNDIN MINING CORP	25,010	8.75	218,837.50
NUTRIEN LTD	20,478	103.08	2,110,872.24
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,660	22.52	172,503.20
TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,975	51.08	918,163.00
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,450	102.45	251,002.50
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	16,865	53.74	906,325.10
CAE INC	12,305	28.20	347,001.00
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,260	102.61	334,508.60
WSP GLOBAL INC	4,590	165.17	758,130.30
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,410	39.33	291,435.30
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,040	77.32	312,372.80
THOMSON REUTERS CORP	6,546	157.73	1,032,500.58
AIR CANADA	7,190	19.23	138,263.70
CANADIAN NATL RAILWAY CO	22,418	170.53	3,822,941.54
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	35,491	106.22	3,769,854.02
TFI INTERNATIONAL INC	3,210	146.65	470,746.50
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,668	80.94	863,467.92
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,570	106.54	167,267.80
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,040	38.35	269,984.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	10,998	91.25	1,003,567.50

QUEBECOR INC -CL B	6,110	28.27	172,729.70
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	18,725	36.73	687,769.25
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,250	148.13	333,292.50
DOLLARAMA INC	10,360	81.07	839,885.20
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	31,090	62.33	1,937,839.70
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	36.48	253,536.00
LOBLAW COMPANIES LTD	6,339	123.42	782,359.38
METRO INC	9,570	77.78	744,354.60
WESTON (GEORGE) LTD	2,808	176.73	496,257.84
SAPUTO INC	9,620	34.30	329,966.00
BANK OF MONTREAL	25,641	122.31	3,136,150.71
BANK OF NOVA SCOTIA	47,539	66.62	3,167,048.18
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	33,740	56.09	1,892,476.60
NATIONAL BANK OF CANADA	12,600	93.53	1,178,478.00
ROYAL BANK OF CANADA	54,439	129.42	7,045,495.38
TORONTO-DOMINION BANK	70,270	87.50	6,148,625.00
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	13,859	40.00	554,360.00
BROOKFIELD CORP	55,439	45.55	2,525,246.45
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	13,800	19.27	265,926.00
IGM FINANCIAL INC	3,335	38.79	129,364.65
ONEX CORPORATION	2,765	66.00	182,490.00
TMX GROUP LTD	2,170	139.27	302,215.90
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	791.53	712,377.00
GREAT-WEST LIFECO INC	11,324	30.32	343,343.68
IA FINANCIAL CORP INC	4,075	76.93	313,489.75
INTACT FINANCIAL CORP	7,215	197.14	1,422,365.10
MANULIFE FINANCIAL CORP	71,921	24.18	1,739,049.78
POWER CORP OF CANADA	20,479	33.34	682,769.86
SUN LIFE FINANCIAL INC	21,544	63.13	1,360,072.72
FIRSTSERVICE CORP	1,500	167.97	251,955.00
CGI INC	8,030	118.57	952,117.10
CONSTELLATION SOFTWARE INC	740	2,147.73	1,589,320.20
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,740	95.59	357,506.60
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,250	36.71	82,597.50
OPEN TEXT CORP	11,190	39.94	446,928.60
SHOPIFY INC - CLASS-A	46,230	51.82	2,395,638.60

	BCE INC	3,000	61.74	185,220.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	13,875	61.38	851,647.50	
	TELUS CORP	12,662	27.71	350,864.02	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	27,080	9.64	261,051.20	
	ALTAGAS LTD	11,170	24.41	272,659.70	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	43.56	237,184.20	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	37.79	172,322.40	
	EMERA INC	10,460	53.49	559,505.40	
	FORTIS INC	19,055	55.79	1,063,078.45	
	HYDRO ONE LTD	13,230	37.33	493,875.90	
	NORTHLAND POWER INC	8,600	38.91	334,626.00	
加ドル小計		1,567,180		91,840,028.71 (9,187,676,472)	
ユーロ	ENI SPA	96,426	13.61	1,312,357.86	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	18,755	11.77	220,746.35	
	NESTE OYJ	16,380	46.12	755,445.60	
	OMV AG	5,480	47.57	260,683.60	
	REPSOL SA	54,849	14.34	786,808.90	
	TENARIS SA	17,895	15.78	282,472.57	
	TOTALENERGIES SE	96,127	57.48	5,525,379.96	
	AIR LIQUIDE SA	20,149	138.16	2,783,785.84	
	AKZO NOBEL	6,937	65.30	452,986.10	
	ARCELORMITTAL	20,552	25.04	514,622.08	
	ARKEMA	2,215	85.76	189,958.40	
	BASF SE	34,575	47.23	1,632,977.25	
	COVESTRO AG	7,410	37.00	274,170.00	
	CRH PLC	28,450	38.06	1,082,949.25	
	EVONIK INDUSTRIES AG	8,230	18.13	149,251.05	
	HEIDELBERGCEMENT AG	5,715	52.50	300,037.50	
	KONINKLIJKE DSM NV	6,392	125.55	802,515.60	
	OCI NV	4,810	36.10	173,641.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,050	36.07	326,433.50	
	SOLVAY SA	2,811	94.94	266,876.34	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	19,785	13.64	269,966.32	
	SYMRISE AG	5,790	107.10	620,109.00	
	UMICORE	7,960	35.50	282,580.00	

UPM-KYMMENE OYJ	21,098	36.48	769,655.04
VOESTALPINE AG	4,249	24.56	104,355.44
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,896	26.92	293,320.32
AIRBUS GROUP SE	22,658	113.00	2,560,354.00
ALSTOM	11,635	23.98	279,007.30
BOUYGUES SA	8,460	29.03	245,593.80
BRENTAG SE	5,605	58.70	329,013.50
CNH INDUSTRIAL NV	39,510	15.29	604,305.45
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	18,426	47.00	866,022.00
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	18,186	30.75	559,219.50
DASSAULT AVIATION SA	900	156.40	140,760.00
EIFFAGE	3,250	94.28	306,410.00
FERROVIAL SA	18,485	25.64	473,955.40
GEA GROUP AG	6,020	39.70	238,994.00
IMCD NV	2,120	147.50	312,700.00
KINGSPAN GROUP PLC	5,900	53.50	315,650.00
KNORR-BREMSE AG	2,970	53.34	158,419.80
KONE OYJ-B	13,614	48.96	666,541.44
LEGRAND SA	10,058	80.02	804,841.16
MTU AERO ENGINES AG	2,020	203.70	411,474.00
PRYSMIAN SPA	9,565	35.60	340,514.00
RATIONAL AG	230	603.00	138,690.00
RHEINMETALL AG	1,730	197.65	341,934.50
SAFRAN SA	13,080	118.16	1,545,532.80
SCHNEIDER ELECTRIC SE	20,688	139.50	2,885,976.00
SIEMENS AG-REG	29,746	133.02	3,956,812.92
SIEMENS ENERGY AG	15,843	17.55	278,044.65
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	8,870	17.99	159,571.30
THALES SA	4,015	119.65	480,394.75
VINCI SA	19,890	95.48	1,899,097.20
WARTSILA OYJ ABP	18,180	8.42	153,221.04
BUREAU VERITAS SA	10,920	25.23	275,511.60
RANDSTAD NV	4,675	56.80	265,540.00
TELEPERFORMANCE	2,240	226.50	507,360.00
WOLTERS KLUWER	10,027	104.60	1,048,824.20
ADP	1,090	130.50	142,245.00

AENA SA	2, 870	126. 25	362, 337. 50
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23, 880	8. 09	193, 236. 96
DEUTSCHE POST AG-REG	36, 733	38. 90	1, 429, 097. 36
GETLINK	17, 310	15. 66	271, 074. 60
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13, 355	83. 85	1, 119, 816. 75
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2, 210	80. 80	178, 568. 00
CONTINENTAL AG	4, 385	58. 30	255, 645. 50
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	4, 380	101. 55	444, 789. 00
FERRARI NV	4, 824	212. 00	1, 022, 688. 00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	29, 922	64. 56	1, 931, 764. 32
MICHELIN (CGDE)	25, 266	27. 02	682, 687. 32
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5, 670	55. 16	312, 757. 20
RENAULT SA	8, 247	33. 79	278, 707. 36
STELLANTIS NV	85, 706	13. 89	1, 190, 627. 75
VALEO SA	7, 420	17. 52	130, 035. 50
VOLKSWAGEN AG	1, 151	175. 00	201, 425. 00
VOLKSWAGEN AG-PFD	7, 003	137. 76	964, 733. 28
ADIDAS AG	6, 451	123. 98	799, 794. 98
HERMES INTERNATIONAL	1, 237	1, 578. 00	1, 951, 986. 00
KERING	2, 782	524. 70	1, 459, 715. 40
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	10, 749	727. 40	7, 818, 822. 60
MONCLER SPA	8, 080	51. 52	416, 281. 60
PUMA SE	4, 200	54. 62	229, 404. 00
SEB SA	987	81. 90	80, 835. 30
ACCOR SA	6, 056	25. 21	152, 671. 76
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6, 356	139. 70	887, 933. 20
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3, 900	39. 09	152, 451. 00
SODEXO	3, 240	93. 66	303, 458. 40
BOLLORE SE	33, 530	5. 31	178, 044. 30
PUBLICIS GROUPE	8, 645	61. 94	535, 471. 30
SCOUT24 SE	2, 970	52. 12	154, 796. 40
UBISOFT ENTERTAINMENT	3, 510	26. 82	94, 138. 20
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	27, 730	23. 29	645, 831. 70
VIVENDI SE	26, 070	8. 92	232, 752. 96
D' IETEREN GROUP	1, 050	183. 00	192, 150. 00
DELIVERY HERO SE	6, 600	42. 60	281, 160. 00

INDITEX	42,275	25.52	1,078,858.00
JUST EAT TAKEAWAY	6,460	21.68	140,085.10
PROSUS	30,720	66.54	2,044,108.80
ZALANDO SE	8,260	34.48	284,804.80
CARREFOUR SA	22,633	15.60	353,187.96
HELLOFRESH SE	6,070	23.17	140,641.90
JERONIMO MARTINS	10,585	20.64	218,474.40
KESKO OYJ-B SHS	10,930	20.50	224,065.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	40,028	27.73	1,110,176.58
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	33,221	57.54	1,911,536.34
DANONE	24,624	49.73	1,224,551.52
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,850	10.19	202,271.50
HEINEKEN HOLDING NV	3,675	73.70	270,847.50
HEINEKEN NV	10,033	89.40	896,950.20
JDE PEET' S NV	4,010	27.72	111,157.20
KERRY GROUP PLC-A	6,460	87.36	564,345.60
PERNOD-RICARD SA	8,026	189.00	1,516,914.00
REMY COINTREAU	810	162.60	131,706.00
BEIERSDORF AG	4,715	108.50	511,577.50
HENKEL AG & CO KGAA	4,520	61.95	280,014.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,793	66.10	449,017.30
L' OREAL	9,396	355.50	3,340,278.00
AMPLIFON SPA	4,830	28.88	139,490.40
BIOMERIEUX	1,690	101.05	170,774.50
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	126.90	204,309.00
DIASORIN ITALIA SPA	930	139.20	129,456.00
ESSILORLUXOTTICA	10,755	183.90	1,977,844.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,613	30.54	232,501.02
FRESENIUS SE & CO KGAA	15,695	26.66	418,428.70
KONINKLIJKE PHILIPS NV	35,200	13.87	488,224.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,640	51.38	546,683.20
ARGENX SE	2,235	367.90	822,256.50
BAYER AG-REG	37,444	52.05	1,948,960.20
EUROFINS SCIENTIFIC	5,050	67.40	340,370.00
GRIFOLS SA	12,050	10.82	130,441.25
IPSEN	1,350	99.85	134,797.50

MERCK KGAA	5,150	190.00	978,500.00
ORION OYJ-CLASS B	4,500	50.44	226,980.00
QIAGEN N.V.	10,384	47.11	489,190.24
RECORDATI SPA	3,720	41.63	154,863.60
SANOFI	44,286	90.02	3,986,625.72
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	960	371.80	356,928.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	328.50	354,780.00
UCB SA	4,928	74.60	367,628.80
ABN AMRO BANK NV-CVA	15,170	12.40	188,183.85
AIB GROUP PLC	34,900	3.21	112,029.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	259,463	5.53	1,436,646.63
BANCO SANTANDER SA	662,389	2.76	1,831,505.58
BANK OF IRELAND GROUP PLC	38,600	7.81	301,697.60
BNP PARIBAS	43,142	53.51	2,308,528.42
CAIXABANK S.A	163,050	3.37	549,478.50
COMMERZBANK AG	40,474	7.75	313,835.39
CREDIT AGRICOLE SA	55,242	9.67	534,245.38
ERSTE GROUP BANK AG	13,018	28.31	368,539.58
FINECOBANK SPA	23,540	15.75	370,872.70
ING GROEP NV-CVA	146,925	11.37	1,671,712.65
INTESA SANPAOLO	613,793	2.08	1,281,292.88
KBC GROEP NV	9,719	57.50	558,842.50
MEDIOBANCA SPA	27,330	9.28	253,677.06
SOCIETE GENERALE	29,859	22.71	678,247.18
UNICREDIT SPA	79,316	12.77	1,013,182.58
AMUNDI SA	2,140	54.70	117,058.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	80,935	10.08	816,310.41
DEUTSCHE BOERSE AG	7,200	168.90	1,216,080.00
EURAZEO SE	1,487	59.10	87,881.70
EURONEXT NV	3,470	71.80	249,146.00
EXOR NV	4,164	72.16	300,474.24
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,452	77.44	267,322.88
SOFINA	655	221.00	144,755.00
WENDEL	1,000	89.80	89,800.00
AEGON NV	69,679	4.70	327,979.05
AGEAS	5,924	40.82	241,817.68

ALLIANZ SE-REG	15,913	204.00	3,246,252.00
ASSICURAZIONI GENERALI	42,248	17.38	734,270.24
AXA SA	71,452	27.08	1,934,920.16
HANNOVER RUECK SE-REG	2,275	187.05	425,538.75
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,316	307.30	1,633,606.80
NN GROUP NV	10,270	41.54	426,615.80
POSTE ITALIANE SPA	19,560	9.49	185,702.64
SAMPO OYJ-A SHS	17,799	48.75	867,701.25
AROUNDTOWN SA	35,980	2.60	93,871.82
LEG IMMOBILIEN SE	3,010	67.20	202,272.00
VONOVIA SE	27,119	24.36	660,618.84
ADYEN NV	830	1,504.00	1,248,320.00
AMADEUS IT GROUP SA	17,090	53.10	907,479.00
BECHTLE AG	3,070	36.13	110,919.10
CAP GEMINI SA	6,509	172.35	1,121,826.15
DASSAULT SYSTEMES SE	24,650	36.40	897,260.00
EDENRED	9,626	52.30	503,439.80
NEMETSCHEK SE	2,350	50.38	118,393.00
NEXI SPA	21,240	7.93	168,560.64
SAP SE	40,572	103.78	4,210,562.16
WORLDLINE SA	8,950	40.91	366,144.50
NOKIA OYJ	203,856	4.70	959,652.12
CELLNEX TELECOM SA	21,660	33.59	727,559.40
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	126,776	19.16	2,429,788.81
ELISA OYJ	5,465	51.78	282,977.70
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	9.69	147,118.66
KONINKLIJKE KPN NV	124,056	2.95	366,461.42
ORANGE S. A.	74,364	9.27	689,428.64
TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.21	84,187.83
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	46,470	2.22	103,442.22
TELEFONICA SA	195,629	3.32	650,857.68
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	4,000	19.36	77,460.00
ACCIONA SA	830	183.60	152,388.00
E. ON SE	90,999	9.29	845,926.70
EDF	21,315	12.00	255,780.00
EDP RENOVAVEIS SA	11,010	22.30	245,523.00

	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	105,831	4.73	500,686.46
	ELIA GROUP SA/NV	1,356	142.30	192,958.80
	ENAGAS SA	8,610	17.35	149,383.50
	ENDESA SA	12,050	18.04	217,382.00
	ENEL SPA	309,737	5.25	1,626,738.72
	ENGIE	71,874	14.34	1,031,104.40
	FORTUM OYJ	16,755	15.20	254,759.77
	IBERDROLA SA	232,242	11.05	2,567,435.31
	NATURGY ENERGY GROUP SA	6,252	26.96	168,553.92
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	15,580	17.43	271,559.40
	RWE AG	25,835	42.73	1,103,929.55
	SNAM SPA	91,120	4.90	446,943.60
	TERNA SPA	53,627	7.49	401,987.99
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,790	25.39	629,418.10
	VERBUND AG	2,780	83.80	232,964.00
	ASM INTERNATIONAL NV	1,765	278.60	491,729.00
	ASML HOLDING NV	15,722	585.60	9,206,803.20
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	49,285	31.80	1,567,263.00
	STMICROELECTRONICS NV	25,233	37.22	939,298.42
ユーロ小計		7,108,683		170,984,777.42 (24,743,207,140)
英ポンド	BP PLC	742,648	4.69	3,487,103.68
	SHELL PLC-NEW	281,587	22.96	6,465,237.52
	ANGLO AMERICAN PLC	48,104	31.32	1,506,857.80
	ANTOFAGASTA PLC	14,330	14.59	209,146.35
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,131	70.16	430,150.96
	GLENCORE PLC	389,873	5.41	2,109,212.93
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,339	21.05	154,485.95
	MONDI PLC	18,370	14.68	269,763.45
	RIO TINTO PLC	43,085	56.22	2,422,238.70
	ASHTED GROUP PLC	16,770	49.93	837,326.10
	BAE SYSTEMS PLC ORD	127,775	8.34	1,065,899.05
	BUNZL PLC	12,896	29.98	386,622.08
	DCC PLC	3,820	43.14	164,794.80
	MELROSE INDUSTRIES PLC	162,972	1.29	211,619.14
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	321,031	0.90	289,858.88

SMITHS GROUP PLC	13,603	16.14	219,620.43
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,890	113.95	329,315.50
EXPERIAN PLC	33,988	29.84	1,014,201.92
INTERTEK GROUP PLC	6,025	41.06	247,386.50
RELX PLC	73,335	23.40	1,716,039.00
RENTOKIL INITIAL PLC	95,400	5.34	509,626.80
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	4.03	164,345.92
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,515	38.14	172,202.10
BURBERRY GROUP PLC	15,504	21.36	331,165.44
PERSIMMON PLC	12,440	12.57	156,370.80
TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.02	126,882.02
COMPASS GROUP PLC	66,698	19.25	1,283,936.50
ENTAIN PLC	24,860	13.95	346,921.30
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	8,263	49.38	408,026.94
WHITBREAD PLC	8,110	26.75	216,942.50
AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	5.63	205,674.24
INFORMA PLC	56,580	6.22	351,927.60
PEARSON PLC	26,089	9.13	238,192.57
WPP PLC	41,144	8.32	342,318.08
JD SPORTS FASHION PLC	97,350	1.21	118,377.60
KINGFISHER PLC	78,137	2.40	187,528.80
NEXT PLC	5,667	59.22	335,599.74
OCADO GROUP PLC	22,670	6.88	156,105.62
SAINSBURY (J) PLC	70,601	2.20	155,675.20
TESCO PLC	288,058	2.25	650,146.90
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,125	16.29	213,806.25
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	83,477	32.68	2,728,028.36
COCA-COLA HBC AG-CDI	7,690	19.80	152,300.45
DIAGEO PLC	88,942	37.64	3,348,221.59
IMPERIAL BRANDS PLC	33,172	20.34	674,718.48
HALEON PLC	194,651	3.21	625,024.36
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	28,605	58.38	1,669,959.90
UNILEVER PLC	98,552	41.50	4,090,400.76
NMC HEALTH PLC	8,090	—	—
SMITH & NEPHEW PLC	33,906	11.25	381,442.50
ASTRAZENECA PLC	60,002	114.00	6,840,228.00

	GSK PLC	156,760	14.43	2,263,300.88
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,740	15.16	87,047.10
	BARCLAYS PLC	639,751	1.60	1,025,264.95
	HSBC HOLDINGS PLC	772,411	4.97	3,844,289.54
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,649,936	0.46	1,223,077.96
	NATWEST GROUP PLC	204,035	2.64	539,468.54
	STANDARD CHARTERED PLC	95,420	6.06	578,817.72
	3I GROUP PLC	36,819	13.45	495,215.55
	ABRDN PLC	88,515	1.89	168,045.72
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	8.85	115,279.08
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	12,467	76.14	949,237.38
	M&G PLC	99,522	1.85	184,812.35
	SCHRODERS PLC	30,300	4.60	139,380.00
	ST JAMES' S PLACE PLC	20,540	11.58	237,853.20
	ADMIRAL GROUP PLC	6,795	20.85	141,675.75
	AVIVA PLC	101,624	4.47	454,665.77
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	225,651	2.58	583,533.48
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,230	6.15	186,035.42
	PRUDENTIAL PLC	104,652	10.90	1,140,706.80
	AVEVA GROUP PLC	4,515	32.09	144,886.35
	SAGE GROUP PLC/THE	38,840	7.93	308,311.92
	HALMA PLC	14,690	21.77	319,801.30
	BT GROUP PLC	267,752	1.16	311,261.70
	VODAFONE GROUP PLC	996,528	0.86	860,402.27
	NATIONAL GRID PLC	138,508	10.27	1,423,169.70
	SEVERN TRENT PLC	9,023	27.44	247,591.12
	SSE PLC	39,837	17.25	687,387.43
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	10.36	270,578.32
英ボンド小計		10,930,146		69,650,075.36 (11,723,500,684)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,990	15.23	121,687.70
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	651.50	175,905.00
	GIVAUDAN-REG	378	3,008.00	1,137,024.00
	HOLCIM LTD	20,649	48.71	1,005,812.79
	SIG GROUP AG	10,900	21.68	236,312.00
	SIKA AG-REG	5,505	240.90	1,326,154.50

ABB LTD-REG	61,275	29.50	1,807,612.50
GEBERIT AG-REG	1,490	458.30	682,867.00
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,070	172.00	184,040.00
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	180.85	267,658.00
VAT GROUP AG	1,015	285.60	289,884.00
ADECCO GROUP AG-REG	6,817	31.36	213,781.12
SGS SA-REG	238	2,190.00	521,220.00
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,160	217.30	469,368.00
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	20,449	124.55	2,546,922.95
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,125	261.60	294,300.00
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,850	47.90	88,615.00
BARRY CALLEBAUT AG-REG	130	1,859.00	241,670.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	40	9,740.00	389,600.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	97,200.00	486,000.00
NESTLE SA-REG	107,090	111.04	11,891,273.60
ALCON INC	18,644	66.30	1,236,097.20
SONOVA HOLDING AG-REG	2,051	238.20	488,548.20
STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,370	112.95	493,591.50
BACHEM HOLDING AG-REG B	1,400	87.90	123,060.00
LONZA GROUP AG-REG	2,863	475.00	1,359,925.00
NOVARTIS AG-REG	83,753	86.13	7,213,645.89
ROCHE HOLDING AG-BR	1,020	375.60	383,112.00
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	27,153	307.55	8,350,905.15
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	142,598	2.89	412,963.80
JULIUS BAER GROUP LTD	8,420	54.58	459,563.60
PARTNERS GROUP HOLDING AG	850	888.40	755,140.00
UBS GROUP AG-REG	136,312	17.16	2,339,795.48
BALOISE HOLDING AG - REG	1,740	141.60	246,384.00
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,140	494.50	563,730.00
SWISS RE AG	11,379	86.42	983,373.18
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5,766	451.70	2,604,502.20
SWISS PRIME SITE-REG	2,711	81.50	220,946.50
TEMENOS AG	2,280	54.12	123,393.60
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	58.06	386,679.60
SWISSCOM AG-REG	1,144	510.00	583,440.00
スイスフラン小計	714,180		53,706,505.06

				(7,874,447,771)
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	10,290	398.90	4,104,681.00
	HOLMEN AB-B SHARES	3,520	420.10	1,478,752.00
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	22,680	139.15	3,155,922.00
	ALFA LAVAL AB	10,710	316.30	3,387,573.00
	ASSA ABLOY AB-B	37,490	237.30	8,896,377.00
	ATLAS COPCO AB-A SHS	111,390	134.76	15,010,916.40
	ATLAS COPCO AB-B SHS	56,870	122.02	6,939,277.40
	EPIROC AB-A	24,905	202.00	5,030,810.00
	EPIROC AB-B	15,450	176.40	2,725,380.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	78.06	1,170,900.00
	INDUTRADE AB	10,180	228.00	2,321,040.00
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	210.20	1,429,360.00
	LIFCO AB-B SHS	8,470	185.60	1,572,032.00
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	56,420	106.80	6,025,656.00
	SANDVIK AB	40,890	194.10	7,936,749.00
	SKANSKA AB-B SHS	14,390	171.25	2,464,287.50
	SKF AB-B SHARES-B	14,079	169.40	2,384,982.60
	VOLVO AB-A SHS	9,530	207.00	1,972,710.00
	VOLVO AB-B SHS-B	56,670	196.02	11,108,453.40
	SECURITAS AB-B SHS	17,788	87.24	1,551,825.12
	VOLVO CAR AB-B	20,400	51.13	1,043,052.00
	ELECTROLUX AB-B	8,095	151.00	1,222,345.00
	EVOLUTION AB	7,140	1,043.60	7,451,304.00
	EMBRACER GROUP AB	23,940	50.76	1,215,194.40
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,848	119.42	3,325,608.16
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	23,695	277.70	6,580,101.50
	GETINGE AB-B SHS	9,470	239.90	2,271,853.00
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	7,130	220.50	1,572,165.00
	NORDEA BANK ABP	131,132	108.56	14,235,689.92
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	62,450	121.25	7,572,062.50
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60,120	103.60	6,228,432.00
	SWEDBANK AB - A SHARES	34,550	173.70	6,001,335.00
EQT AB	10,680	247.60	2,644,368.00	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	262.00	1,305,808.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	261.20	1,561,976.00	

	INVESTOR AB-A SHS	19,180	205.70	3,945,326.00	
	INVESTOR AB-B SHS	69,350	198.08	13,736,848.00	
	KINNEVIK AB - B	8,285	158.90	1,316,486.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,590	469.30	1,684,787.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	23,220	53.32	1,238,090.40	
	SAGAX AB-B	7,910	256.70	2,030,497.00	
	ERICSSON LM-B SHS	123,815	66.92	8,285,699.80	
	HEXAGON AB-B SHS	80,990	120.00	9,718,800.00	
	TELE2 AB-B SHS	23,245	93.62	2,176,196.90	
	TELIA CO AB	118,530	27.99	3,317,654.70	
スウェーデンクローナ小計		1,459,251		202,349,365.20 (2,699,340,531)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	12,100	302.70	3,662,670.00	
	EQUINOR ASA	36,424	363.35	13,234,660.40	
	NORSK HYDRO A S	50,660	70.26	3,559,371.60	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,670	431.70	2,879,439.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,900	406.20	1,584,180.00	
	ADEVINTA ASA	11,400	71.00	809,400.00	
	MOWI ASA	16,360	160.85	2,631,506.00	
	ORKLA ASA	32,290	71.02	2,293,235.80	
	SALMAR ASA	2,100	370.00	777,000.00	
	DNB BANK ASA	35,845	185.15	6,636,701.75	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,410	193.20	1,431,612.00	
	TELENOR ASA	23,915	90.86	2,172,916.90	
ノルウェークローネ小計		239,074		41,672,693.45 (580,083,892)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,840	535.40	2,055,936.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,165	373.00	3,045,545.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	315	1,598.50	503,527.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	38,290	205.95	7,885,825.50	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	110	14,550.00	1,600,500.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	195	14,715.00	2,869,425.00	
	DSV A/S	7,250	1,112.50	8,065,625.00	
	PANDORA A/S	3,310	524.40	1,735,764.00	
	CARLSBERG AS-B	3,630	930.00	3,375,900.00	
	COLOPLAST-B	4,485	873.20	3,916,302.00	

	DEMANT A/S	3,640	198.00	720,720.00	
	GENMAB A/S	2,580	3,176.00	8,194,080.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	64,125	937.50	60,117,187.50	
	DANSKE BANK A/S	26,635	129.65	3,453,227.75	
	TRYG A/S	13,945	166.40	2,320,448.00	
	ORSTED A/S	7,570	663.60	5,023,452.00	
デンマーククローネ小計		188,085		114,883,465.25 (2,234,483,399)	
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	27.66	242,716.50	
	SANTOS LTD	121,660	7.16	871,085.60	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,370	27.80	232,686.00	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	71,206	35.65	2,538,493.90	
	BHP GROUP LTD	195,717	46.31	9,063,654.27	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	18.01	329,763.10	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	64,055	20.46	1,310,565.30	
	IGO LTD	24,300	14.97	363,771.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	16,955	29.93	507,463.15	
	MINERAL RESOURCES LTD	6,240	86.01	536,702.40	
	NEWCREST MINING LTD	35,809	21.07	754,495.63	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	42,190	10.97	462,824.30	
	ORICA LIMITED	17,675	15.49	273,785.75	
	PILBARA MINERALS LTD	91,400	4.55	415,870.00	
	RIO TINTO LTD	14,098	114.67	1,616,617.66	
	SOUTH32 LTD	207,787	4.21	874,783.27	
	REECE LTD	10,200	14.89	151,878.00	
	BRAMBLES LTD	54,798	12.24	670,727.52	
	AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	3.69	271,473.30	
	QANTAS AIRWAYS LTD	35,030	6.19	216,835.70	
	TRANSURBAN GROUP	113,696	14.06	1,598,565.76	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,520	33.68	792,153.60	
	IDP EDUCATION LTD	7,220	28.08	202,737.60	
	LOTTERY CORP LTD/THE	85,554	4.80	410,659.20	
	REA GROUP LTD	1,820	120.97	220,165.40	
	SEEK LTD	12,860	22.14	284,720.40	
	WESFARMERS LTD	42,585	48.19	2,052,171.15	
	COLES GROUP LTD	57,925	16.75	970,243.75	

	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	50,462	6.41	323,461.42	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	45,612	34.29	1,564,035.48	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	27,906	13.60	379,521.60	
	COCHLEAR LTD	2,527	209.99	530,644.73	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,105	65.80	467,509.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	30.90	545,694.00	
	CSL LTD	18,742	299.31	5,609,668.02	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	113,749	24.01	2,731,113.49	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	65,897	106.92	7,045,707.24	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	122,003	30.71	3,746,712.13	
	WESTPAC BANKING CORP	131,371	23.57	3,096,414.47	
	ASX LTD	7,105	69.14	491,239.70	
	MACQUARIE GROUP LTD	14,604	174.21	2,544,162.84	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	4.75	451,843.75	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	108,430	2.98	323,121.40	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	55,210	13.12	724,355.20	
	SUNCORP GROUP LTD	59,226	11.89	704,197.14	
	COMPUTERSHARE LTD	20,910	26.60	556,206.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	5,920	54.97	325,422.40	
	XERO LTD	4,930	75.15	370,489.50	
	TELSTRA GROUP LTD	181,484	4.08	740,454.72	
	APA GROUP	45,818	11.08	507,663.44	
	ORIGIN ENERGY LTD	68,320	7.49	511,716.80	
豪ドル小計		2,733,441		62,528,963.68 (5,818,320,070)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,165	8.09	381,564.85	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,130	22.22	513,948.60	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	5.25	402,029.25	
	MERCURY NZ LTD	20,400	5.55	113,220.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	57,830	5.05	292,330.65	
ニュージーランドドル小計		225,102		1,703,093.35 (149,173,946)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	103,208	45.00	4,644,360.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	52,500	96.25	5,053,125.00	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	71,000	15.00	1,065,000.00	
	MTR CORP	57,500	39.85	2,291,375.00	

	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	19.40	1,008,800.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	81,000	52.50	4,252,500.00	
	SANDS CHINA LTD	96,600	25.95	2,506,770.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	24.75	1,680,525.00	
	WH GROUP LTD	299,894	4.56	1,367,516.64	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	134,500	26.25	3,530,625.00	
	HANG SENG BANK LTD	29,100	128.20	3,730,620.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	45,800	343.60	15,736,880.00	
	AIA GROUP LTD	462,990	84.10	38,937,459.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	73,038	46.85	3,421,830.30	
	ESR GROUP LTD	75,800	17.68	1,340,144.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	14.80	1,154,400.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	26.30	1,522,796.30	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	61,666	22.20	1,368,985.20	
	SINO LAND CO	123,050	9.86	1,213,273.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,480	104.70	6,332,256.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	17,517	67.10	1,175,390.70	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	20.00	832,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	45.70	2,915,660.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	9.67	1,450,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	39.90	997,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	63,000	57.20	3,603,600.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	95,000	5.19	493,050.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	456,237	7.47	3,408,090.39	
	POWER ASSETS HOLDINGS	58,000	41.80	2,424,400.00	
香港ドル小計		3,054,081		119,459,431.53 (2,080,983,297)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	53,360	7.48	399,132.80	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	63,300	3.39	214,587.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	5.58	300,762.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.91	193,156.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	4.17	308,413.20	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	67,395	34.08	2,296,821.60	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	124,040	12.43	1,541,817.20	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	44,200	30.91	1,366,222.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	32,800	9.08	297,824.00	

	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	105,000	3.69	387,450.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	17,300	8.25	142,725.00	
	UOL GROUP LTD	15,550	6.72	104,496.00	
	VENTURE CORP LTD	9,900	17.21	170,379.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	354,480	2.59	918,103.20	
シンガポールドル小計		1,226,285		8,641,889.50 (869,201,245)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	26,090	26.69	696,342.10	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,010	577.20	582,972.00	
	BANK HAPOALIM BM	46,265	31.60	1,461,974.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	62,565	30.06	1,880,703.90	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	48,330	19.39	937,118.70	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,900	117.80	577,220.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,780	242.50	431,650.00	
	NICE LTD	2,440	704.40	1,718,736.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	68,700	6.05	415,772.40	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	4,700	157.20	738,840.00	
イスラエルシュケル小計		266,780		9,441,329.10 (375,572,295)	
合 計		42,852,785		248,978,169,684 (248,978,169,684)	

(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	6,250	956,062.50	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	12,110	391,637.40	
		AMERICAN TOWER CORP	17,989	3,954,881.65	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	18,847	414,257.06	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,220	898,257.60	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,717	397,560.18	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,700	432,086.00	
		CROWN CASTLE INC	16,900	2,323,412.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	10,635	1,112,846.40	
		EQUINIX INC	3,548	2,495,769.64	

		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,550	433,937.50	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	13,340	852,826.20	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,480	547,931.20	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,290	825,292.90	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,340	596,143.80	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	14,810	287,906.40	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	20,375	519,358.75	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	27,179	477,806.82	
		INVITATION HOMES INC	22,810	730,148.10	
		IRON MOUNTAIN INC	10,895	598,789.20	
		KIMCO REALTY CORP	23,760	522,957.60	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	23,470	278,354.20	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,300	707,178.00	
		PROLOGIS INC	35,875	4,361,682.50	
		PUBLIC STORAGE	5,919	1,776,765.42	
		REALTY INCOME CORP	22,221	1,436,809.86	
		REGENCY CENTERS CORP	6,005	393,507.65	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,175	1,229,078.25	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	12,404	1,484,882.84	
		SUN COMMUNITIES INC	4,640	674,052.80	
		UDR INC	12,100	491,018.00	
		VENTAS INC	17,025	791,151.75	
		VICI PROPERTIES INC	37,050	1,266,739.50	
		WELLTOWER INC	18,090	1,218,361.50	
		WEYERHAEUSER CO	27,758	906,853.86	
		WP CAREY INC	7,310	588,089.50	
			498,087	37,374,394.53	
				(5,063,482,970)	
米ドル小計					
加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	121,604.00	
加ドル小計			2,800	121,604.00	
				(12,165,264)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	111,746.25	
		GECINA SA	1,950	191,295.00	
		KLEPIERRE	8,402	189,129.02	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,990	264,919.10	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,730	216,594.60	

ユーロ小計			24,997	973,683.97 (140,901,807)
英ポンド	投資証券	BRITISH LAND COMPANY PLC	30,601	122,526.40
		LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	169,222.14
		SEGRO PLC	45,033	371,071.92
英ポンド小計			102,258	662,820.46 (111,565,939)
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	42,067	344,949.40
		GOODMAN GROUP	63,582	1,182,625.20
		GPT GROUP	71,335	313,874.00
		LENDLEASE GROUP	23,367	175,252.50
		MIRVAC GROUP	159,875	354,922.50
		SCENTRE GROUP	198,271	586,882.16
		STOCKLAND	82,300	320,970.00
		VICINITY CENTRES	154,902	309,804.00
豪ドル小計			795,699	3,589,279.76 (333,982,481)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	86,800	4,938,920.00
香港ドル小計			86,800	4,938,920.00 (86,035,986)
シンガポ ールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,243	384,315.54
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	429,589.80
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	144,556	234,180.72
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	106,000	179,140.00
シンガポールドル小計			598,355	1,227,226.06 (123,434,397)
合計				5,871,568,844 (5,871,568,844)

(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 601 銘柄	97.3%	—	71.0%
	投資証券 36 銘柄	—	2.7%	2.0%

加ドル	株式	86 銘柄	99.9%	—	3.6%
	投資証券	1 銘柄	—	0.1%	0.0%
ユーロ	株式	222 銘柄	99.4%	—	9.7%
	投資証券	5 銘柄	—	0.6%	0.1%
英ポンド	株式	79 銘柄	99.1%	—	4.6%
	投資証券	3 銘柄	—	0.9%	0.0%
スイスフラン	株式	41 銘柄	100.0%	—	3.1%
スウェーデンクローナ	株式	45 銘柄	100.0%	—	1.1%
ノルウェークローネ	株式	12 銘柄	100.0%	—	0.2%
デンマーククローネ	株式	16 銘柄	100.0%	—	0.9%
豪ドル	株式	51 銘柄	94.6%	—	2.3%
	投資証券	8 銘柄	—	5.4%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	5 銘柄	100.0%	—	0.1%
香港ドル	株式	29 銘柄	96.0%	—	0.8%
	投資証券	1 銘柄	—	4.0%	0.0%
シンガポールドル	株式	14 銘柄	87.6%	—	0.3%
	投資証券	4 銘柄	—	12.4%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	10 銘柄	100.0%	—	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

2 【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2022年12月30日現在です。

【世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

【純資産額計算書】

I 資産総額	36,044,369,057円
II 負債総額	30,745,967円
III 純資産総額（I－II）	36,013,623,090円
IV 発行済口数	36,746,568,967口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	0.9801円

（参考）

日本リートインデックスJ－REITマザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	54,950,100,152円
II 負債総額	68,915,856円
III 純資産総額（I－II）	54,881,184,296円
IV 発行済口数	21,834,568,062口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.5135円

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	50,789,240,576円
II 負債総額	359,625円
III 純資産総額（I－II）	50,788,880,951円
IV 発行済口数	19,332,501,124口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.6271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	47,793,919,160円
II 負債総額	42,266,333円
III 純資産総額（I－II）	47,751,652,827円
IV 発行済口数	35,603,798,484口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.3412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	143,226,505,629円
II 負債総額	337,665,757円
III 純資産総額（I - II）	142,888,839,872円
IV 発行済口数	58,004,941,012口
V 1口当たり純資産額（III/IV）	2.4634円

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	43,199,993,629円
II 負債総額	21,488,581円
III 純資産総額（I - II）	43,178,505,048円
IV 発行済口数	22,843,967,956口
V 1口当たり純資産額（III/IV）	1.8901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	246,539,755,410円
II 負債総額	191,622,230円
III 純資産総額（I - II）	246,348,133,180円
IV 発行済口数	60,575,728,795口
V 1口当たり純資産額（III/IV）	4.0668円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

① 譲渡制限はありません。

② 受益権の譲渡

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

③ 受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

2022年12月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

●過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2022年12月末現在）

・株主総会

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

当社は、毎年3月31日の最終の株主名簿に記載または記録された議決権を有する株主をもって、その事業年度に関する定時株主総会において、その権利を行使することができる株主とみなし、毎年3月31日（事業年度の終了）から3ヶ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。また、取締役会の決議によって重要な業務執行（会社法第399条の13第5項各号に掲げる事項を除く。）の決定の全部又は一部を取締役に委任することができます。

当社の取締役会は10名以内の取締役（監査等委員である取締役を除く。）及び5名以内の監査等委員である取締役で構成され、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、代表取締役若干名を選定します。

・監査等委員会

当社の監査等委員会は、5名以内の監査等委員である取締役で構成され、監査等委員である取締役の任期は選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。監査等委員会は、その決議をもって、監査等委員の中から、常勤の監査等委員を選定します。

(3) 運用の意思決定プロセス（2022年12月末現在）

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

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2022年12月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	866	229,546
株式投資信託	807	193,694
単位型	318	9,773
追加型	489	183,920
公社債投資信託	59	35,852
単位型	46	1,158
追加型	13	34,693

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63期事業年度（2021年4月1日から2022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64期中間会計期間（2022年4月1日から2022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

2022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 貞 廣 篤 典
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2021年4月1日から2022年3月31日までの第63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2022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) 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、そ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

2022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期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022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2022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（2022年4月1日から2022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 62 期 (2021 年 3 月 31 日)		第 63 期 (2022 年 3 月 31 日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		24,698		42,427
有価証券		17		170
前払費用		785		932
未収入金		225		96
未収委託者報酬		24,738		25,193
未収収益	※3	891	※3	1,048
関係会社短期貸付金		2,403		5,005
立替金		930		1,056
その他	※2	361	※2	998
流動資産合計		55,053		76,928
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	245	※1	244
器具備品	※1	190	※1	153
有形固定資産合計		436		397
無形固定資産				
ソフトウェア		241		335
無形固定資産合計		241		335
投資その他の資産				
投資有価証券		22,903		23,969
関係会社株式		25,987		22,366
長期差入保証金		678		652
繰延税金資産		1,845		3,678
投資その他の資産合計		51,414		50,667
固定資産合計		52,092		51,399
資産合計		107,145		128,328

(単位：百万円)

	第 62 期 (2021 年 3 月 31 日)	第 63 期 (2022 年 3 月 31 日)
負債の部		
流動負債		
預り金	844	651
未払金	9,834	9,693
未払収益分配金	8	7
未払償還金	71	71
未払手数料	8,956	8,783
その他未払金	798	831
未払費用	※3 4,660	※3 5,572
未払法人税等	1,090	2,354
未払消費税等	※4 775	※4 3,669
賞与引当金	3,034	3,958
役員賞与引当金	55	5
訴訟損失引当金	—	7,847
その他	643	1,330
流動負債合計	20,938	35,083
固定負債		
退職給付引当金	1,456	1,395
賞与引当金	156	423
その他	544	390
固定負債合計	2,157	2,209
負債合計	23,095	37,292
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	61,956	68,901
利益剰余金合計	61,956	68,901
自己株式	△2,067	△2,067
株主資本合計	82,472	89,417
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,461	2,350
繰延ヘッジ損益	115	△731
評価・換算差額等合計	1,577	1,618
純資産合計	84,049	91,035
負債純資産合計	107,145	128,328

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第 62 期 (自 2020 年 4 月 1 日 至 2021 年 3 月 31 日)	第 63 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)
営業収益		
委託者報酬	78,975	94,938
その他営業収益	3,973	4,743
営業収益合計	82,948	99,682
営業費用		
支払手数料	34,050	42,026
広告宣伝費	953	987
公告費	1	1
調査費	17,813	23,000
調査費	966	1,042
委託調査費	16,825	21,932
図書費	22	25
委託計算費	545	598
営業雑経費	1,053	1,014
通信費	174	143
印刷費	331	308
協会費	51	52
諸会費	11	13
その他	483	494
営業費用計	54,419	67,628
一般管理費		
給料	10,383	11,759
役員報酬	243	156
役員賞与引当金繰入額	55	5
給料・手当	6,766	7,229
賞与	159	143
賞与引当金繰入額	3,158	4,225
交際費	14	22
寄付金	30	29
旅費交通費	57	66
租税公課	485	429
不動産賃借料	939	937
退職給付費用	388	394
退職金	10	169
固定資産減価償却費	138	172
福利費	1,084	1,171
諸経費	4,286	3,888
一般管理費計	17,817	19,042
営業利益	10,711	13,010

(単位：百万円)

	第 62 期 (自 2020 年 4 月 1 日 至 2021 年 3 月 31 日)		第 63 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)	
営業外収益				
受取利息		75		71
受取配当金	※ 1	2,555	※ 1	5,257
有価証券償還益		14		—
時効成立分配金・償還金		1		1
為替差益		—		1,548
その他		62		58
営業外収益合計		2,710		6,936
営業外費用				
支払利息		122		177
デリバティブ費用		804		49
時効成立後支払分配金・償還金		25		9
為替差損		59		—
その他		42		39
営業外費用合計		1,054		275
経常利益		12,367		19,672
特別利益				
投資有価証券売却益		774		253
子会社有償減資払戻益		—		1,445
その他		0		—
特別利益合計		774		1,699
特別損失				
投資有価証券売却損		237		132
投資有価証券評価損		5		—
固定資産処分損		0		0
役員退職一時金		125		—
訴訟損失引当金繰入額		—		7,847
特別損失合計		369		7,980
税引前当期純利益		12,773		13,391
法人税、住民税及び事業税		3,722		3,435
法人税等還付税額		—	※ 2	△329
法人税等調整額		△373		△1,851
法人税等合計		3,348		1,255
当期純利益		9,424		12,136

(3) 【株主資本等変動計算書】

第62期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	55,395	55,395	△905	77,073
当期変動額							
剰余金の配当				△2,862	△2,862		△2,862
当期純利益				9,424	9,424		9,424
自己株式の取得						△1,161	△1,161
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	—	—	—	6,561	6,561	△1,161	5,399
当期末残高	17,363	5,220	5,220	61,956	61,956	△2,067	82,472

	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	△60	389	329	77,402
当期変動額				
剰余金の配当				△2,862
当期純利益				9,424
自己株式の取得				△1,161
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	1,521	△273	1,247	1,247
当期変動額合計	1,521	△273	1,247	6,647
当期末残高	1,461	115	1,577	84,049

	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

[注記事項]
(重要な会計方針)

項目	第 63 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 ① 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 ② その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 市場価格のない株式等 総平均法による原価法 (2) デリバティブ 時価法
2 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016 年 4 月 1 日以後に取得した建物 附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3 年～15 年 器具備品 3 年～20 年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)につい ては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。
3 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度 の負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の 負担額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金 資産の見込額に基づき、計上しております。 ① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰 属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ② 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間 以内の一定の年数(10 年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生 の翌事業年度から費用処理しております。
4 収益の計上基準	(4) 訴訟損失引当金 訴訟による損失に備えるため、損失見込額を計上しております。 当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行业務の 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。 (1) 投資信託委託業務 当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供 し、商品の運用資産残高(以下「AUM」)に応じて手数料を受領しております。サ ービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドの AUM に固定料率を 乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。 (2) 投資顧問業務 当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファ ンドの AUM に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られ る投資顧問報酬は、一般的に各ファンドの AUM に投資顧問契約で定められた固定 料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。 (3) 成功報酬 当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または 投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が 無いことが判明した時点で収益を認識しております。
5 ヘッジ会計の方法	(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。

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>(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。 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)

<p>第 63 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日)</p>
<p>(収益認識に関する会計基準の適用) 「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第 29 号 2020 年 3 月 31 日。以下、「収益認識会計基準」という。)等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。 収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第 84 項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当事業年度の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当事業年度の期首の利益剰余金に加減し、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。収益認識会計基準等の適用による、当財務諸表に与える影響はありません。</p> <p>(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」(企業会計基準第 30 号 2019 年 7 月 4 日。以下「時価算定会計基準」という。)等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第 19 項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第 10 号 2019 年 7 月 4 日)第 44-2 項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等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。なお、当財務諸表に与える影響はありません。 また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第 19 号 2019 年 7 月 4 日)第 7-4 項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては、記載していません。</p>

(未適用の会計基準等)

- ・ 「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 2021 年 6 月 17 日)
- (1) 概要
投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。
 - (2) 適用予定日
2023 年 3 月期の期首より適用予定であります。
 - (3) 当該会計基準等の適用による影響
当該適用指針の適用が財務諸表に及ぼす影響は、現時点で評価中であります。

(重要な会計上の見積り)

第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。

(貸借対照表関係)

第62期 (2021年3月31日)	第63期 (2022年3月31日)
<p>※1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,349百万円</p> <p>器具備品 764百万円</p>	<p>※1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,390百万円</p> <p>器具備品 823百万円</p>
<p>※2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>	<p>※2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。</p>
<p>※3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>未収収益 257百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払費用 1,247百万円</p>	<p>※3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産)</p> <p>未収収益 233百万円</p> <p>(流動負債)</p> <p>未払費用 2,314百万円</p>
<p>※4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p>	<p>※4 消費税等の取扱い</p> <p>仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p>
	<p>※5 保証債務</p> <p>ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーフワイ・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・ピーティーフワイ・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。</p>

(損益計算書関係)

第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
<p>※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。</p> <p>受取配当金 2,498百万円</p>	<p>※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。</p> <p>受取配当金 5,194百万円</p>
	<p>※2 法人税等還付税額</p> <p>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。</p>

(株主資本等変動計算書関係)

第62期(自2020年4月1日至2021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)	1,454,500	1,405,500	—	2,860,000

(変動事由の概要)

2020年3月25日の取締役会決議による自己株式の取得 594,300株

2020年7月17日の取締役会決議による自己株式の取得 811,200株

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	1,184,700	—	752,400	432,300	—
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,346,000	—	330,000	1,016,000	—
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	2,394,000	—	622,000	1,772,000	—
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	2,939,000	—	332,000	2,607,000	—
合計		7,863,700	—	2,036,400	5,827,300	—

(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 2011年度ストックオプション(1)432,300株、2016年度ストックオプション(1)1,016,000株、2016年度ストックオプション(2)1,088,000株及び2017年度ストックオプション(1)874,000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、2016年度ストックオプション(2)684,000株及び2017年度ストックオプション(1)1,733,000株は、権利行使期間の初日が到来していません。

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
2020年6月12日 取締役会	普通株式	2,862	14.64	2020年3月31日	2020年7月1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
2021年5月25日 取締役会	普通株式	利益剰余金	5,191	26.74	2021年3月31日	2021年6月29日

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

(リース取引関係)

第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		第63期 (自 2021年4月1日 至 2022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	911百万円
1年超	5,236百万円	1年超	4,324百万円
合計	6,148百万円	合計	5,236百万円

(金融商品関係)

第 62 期(自 2020 年 4 月 1 日 至 2021 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 金融商品の時価等に関する事項

2021年3月31日（当事業年度の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(※1)	時価(※1)	差額
(1) 現金・預金	24,698	24,698	—
(2) 未収委託者報酬	24,738	24,738	—
(3) 未収収益	891	891	—
(4) 関係会社短期貸付金	2,403	2,403	—
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	22,905	22,905	—
(6) 未払金	(9,834)	(9,834)	—
(7) 未払費用	(4,660)	(4,660)	—
(8) デリバティブ取引(※2) ヘッジ会計が適用されていないもの	(188)	(188)	—
ヘッジ会計が適用されているもの	(453)	(453)	—
デリバティブ取引計	(642)	(642)	—

(※1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(※2) 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ます。

(注) 1 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益並びに(4) 関係会社短期貸付金

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

(6) 未払金及び(7) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(8) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係) 注記を参照ください。なお、上記金額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 非上場株式等（貸借対照表計上額 16 百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

3 子会社株式（貸借対照表計上額 23,094 百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額 2,892 百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上記の表には含めておりません。

4 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	24,698	—	—	—
未収委託者報酬	24,738	—	—	—
未収収益	891	—	—	—
有価証券及び投資有価証券 投資信託	17	812	10,348	20
合計	50,346	812	10,348	20

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

(有価証券関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021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	23,094
関連会社株式	2,892

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、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	16,914	14,476	2,438
	小計	16,914	14,476	2,438
貸借対照表計上額 が取得原価を超えないもの	投資信託	5,990	6,322	△332
	小計	5,990	6,322	△332
合計		22,905	20,799	2,105

(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。当事業年度において、有価証券について5百万円(その他有価証券の投資信託)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、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	5,735	774	237
合計	5,735	774	237

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

(デリバティブ取引関係)

第 62 期(2021 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	2,670	—	△75	△75
	買建	—	—	—	—
合計		2,670	—	△75	△75

(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	1,713	—	△112	△112
	米ドル				
合計		1,713	—	△112	△112

(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	4,620	—	△273			
	米ドル					862	—	△57
	香港ドル					1,684	—	△117
	人民元					180	—	△5
	ユーロ							
合計			7,347	—	△453			

(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 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。

(持分法損益等)

第 62 期 (自 2020 年 4 月 1 日 至 2021 年 3 月 31 日)	第 63 期 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 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 3,010	(1) 関連会社に対する投資の金額 5,312
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 12,258	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 15,942
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,751	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 1,964

(退職給付関係)

第 62 期(自 2020 年 4 月 1 日 至 2021 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	1,363
勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の発生額	6
退職給付の支払額	△86
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>1,429</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	1,429
未積立退職給付債務	1,429
未認識数理計算上の差異	27
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,456</u>
退職給付引当金	1,456
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,456</u>

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	142
利息費用	2
数理計算上の差異の費用処理額	2
<u>確定給付制度に係る退職給付費用</u>	<u>147</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

0.2%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、240 百万円でありました。

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。

(ストックオプション等関係)

第62期(自 2020年4月1日 至 2021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	1,184,700	1,346,000
付与	0	0
失効	752,300	330,000
権利確定	0	0
権利未確定残	432,300	1,016,000
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	2,394,000	2,939,000
付与	0	0
失効	622,000	332,000
権利確定	0	0
権利未確定残	1,772,000	2,607,000
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 1,738百万円
- 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 63 期(自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 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

	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。

(税効果会計関係)

第 62 期 (2021 年 3 月 31 日)		第 63 期 (2022 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
	その他		繰延ヘッジ損益
	繰延税金資産小計		訴訟損失引当金
	評価性引当金		その他
	繰延税金資産合計		繰延税金資産小計
			評価性引当金(注)
	繰延税金負債		繰延税金資産合計
	繰延ヘッジ利益		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
	繰延税金負債合計		その他
	繰延税金資産の純額		繰延税金負債合計
			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
	その他		評価性引当金の減少
	税効果会計適用後の法人税等の負担率		その他
			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 62 期(自 2020 年 4 月 1 日 至 2021 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	342,369 (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 貸建) (注 1)	—	関係会社 短期 貸付金	1,825 (USD 16,500 千)
							貸付金利息 (米国ドル 貸建) (注 1)	63 (USD 596 千)	未収収益	7 (USD 71 千)
							資金の貸付 (円貸建) (注 1)	—	関係会社 短期 貸付金	577
							貸付金利息 (円貸建) (注 1)	12	未収収益	3
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD 千) (注 2)	アセット マネジメン ト 業	直接 100.00	—	配当の受取	1,783 (USD 17,000 千)	—	—
子会社	Nikko Asset Management Luxembourg S. A.	ルクセ ンブル グ	2,828 (EUR 千)	アセット マネジメン ト 業	直接 100.00	—	増資の引受 (注 3)	217 (EUR 1,750 千)	—	—

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 融資枠 5,000 百万円 (若しくは 5,000 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 AM Americas Holding Co., Inc. の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。
- 3 Nikko Asset Management Luxembourg S. A. の行った 70,000 株の新株発行増資を、1 株につき 25 ユーロで当社が引き受けたものであります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2020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	30,151 百万円
負債合計	5,919 百万円
純資産合計	24,231 百万円

営業収益	19,946 百万円
税引前当期純利益	7,020 百万円
当期純利益	5,194 百万円

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

(セグメント情報等)

セグメント情報

第62期(自 2020年4月1日 至 2021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。

関連情報

第62期(自 2020年4月1日 至 2021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。

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 62 期(自 2020 年 4 月 1 日 至 2021 年 3 月 31 日)

該当事項はありません。

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。

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 62 期(自 2020 年 4 月 1 日 至 2021 年 3 月 31 日)

該当事項はありません。

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。

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 62 期(自 2020 年 4 月 1 日 至 2021 年 3 月 31 日)

該当事項はありません。

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。

(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。

(1株当たり情報)

項目	第62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1株当たり純資産額	432円90銭	468円88銭
1株当たり当期純利益金額	48円45銭	62円50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62期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第63期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益 (百万円)	9,424	12,136
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)	9,424	12,136
普通株式の期中平均株式数 (千株)	194,509	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	2011年度ストックオプション(1) 432,300株、2016年度ストックオプション(1) 1,016,000株、2016年度ストックオプション(2) 1,772,000株、2017年度ストックオプション(1) 2,607,000株	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

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62期 (2021年3月31日)	第63期 (2022年3月31日)
純資産の部の合計額 (百万円)	84,049	91,035
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)	84,049	91,035
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数 (千株)	194,152	194,152

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表等
 (1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第 64 期中間会計期間
 (2022 年 9 月 30 日)

資産の部		
流動資産		
現金・預金		33,164
有価証券		481
未収委託者報酬		16,607
未収収益		1,063
関係会社短期貸付金		3,335
その他	※ 2	3,967
流動資産合計		58,620
固定資産		
有形固定資産	※ 1	404
無形固定資産		353
投資その他の資産		
投資有価証券		23,904
関係会社株式		22,366
長期差入保証金		416
繰延税金資産		4,029
投資その他の資産合計		50,718
固定資産合計		51,476
資産合計		110,097

(単位：百万円)

第 64 期中間会計期間
(2022 年 9 月 30 日)

負債の部		
流動負債		
未払金		7,815
未払費用		3,556
未払法人税等		3,271
未払消費税等	※ 3	345
賞与引当金		1,924
役員賞与引当金		110
その他		1,258
流動負債合計		18,282
固定負債		
退職給付引当金		1,445
賞与引当金		321
役員賞与引当金		16
その他		119
固定負債合計		1,903
負債合計		20,186
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		68,572
利益剰余金合計		68,572
自己株式		△2,067
株主資本合計		89,088
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		2,064
繰延ヘッジ損益		△1,242
評価・換算差額等合計		822
純資産合計		89,911
負債純資産合計		110,097

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

		第 64 期中間会計期間 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 年 9 月 30 日)
営業収益		
委託者報酬		38,118
その他営業収益		1,728
営業収益合計		39,846
営業費用及び一般管理費	※ 1	34,563
営業利益		5,283
営業外収益	※ 2	1,046
営業外費用	※ 3	516
経常利益		5,813
特別利益	※ 4	4,602
特別損失	※ 5	137
税引前中間純利益		10,277
法人税等	※ 6	3,185
中間純利益		7,091

(3) 中間株主資本等変動計算書

第 64 期中間会計期間 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 年 9 月 30 日)

(単位: 百万円)

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本 準備金	資本 剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	68,901	68,901	△2,067	89,417
当中間期変動額							
剰余金の配当				△7,420	△7,420		△7,420
中間純利益				7,091	7,091		7,091
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	—	—	—	△328	△328	—	△328
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	68,572	68,572	△2,067	89,088

	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
当中間期変動額				
剰余金の配当				△7,420
中間純利益				7,091
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)	△285	△510	△795	△795
当中間期変動額合計	△285	△510	△795	△1,124
当中間期末残高	2,064	△1,242	822	89,911

注記事項
(重要な会計方針)

項目	第 64 期中間会計期間 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 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>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(2) デリバティブ 時価法</p> <p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016 年 4 月 1 日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、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れ、日次で収益を認識しております。</p>

	<p>(2) 投資顧問業務 当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドの AUM に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドの AUM に投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。</p> <p>(3) 成功報酬 当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。</p>
5 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引細則等に基づき、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>
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>(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>

(会計方針の変更)

<p>第 64 期中間会計期間 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 年 9 月 30 日)</p>
<p>(時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用) 「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第 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。)を当中間会計期間の期首から適用し、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。なお、当中間財務諸表に与える影響は軽微であります。</p>

(表示方法の変更)

<p>第 64 期中間会計期間 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 年 9 月 30 日)</p>
<p>(損益計算書) 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、前中間会計期間において、「営業外費用」に含めていましたが、金額の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中間会計期間よりヘッジ対象の損益区分と同一区分である特別利益あるいは特別損失として表示することとしております。</p>

(中間貸借対照表関係)

第 64 期中間会計期間 (2022 年 9 月 30 日)	
※ 1	有形固定資産の減価償却累計額 2,264 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 470 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 64 期中間会計期間 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 年 9 月 30 日)	
※ 1	減価償却実施額 有形固定資産 50 百万円 無形固定資産 37 百万円
※ 2	営業外収益のうち主要なもの 受取利息 40 百万円 受取配当金 131 百万円 デリバティブ収益 685 百万円
※ 3	営業外費用のうち主要なもの 支払利息 156 百万円 為替差損 351 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 120 百万円 訴訟損失引当金戻入額 4,481 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 137 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 64 期中間会計期間 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 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 (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	—	667,000	869,000	—
合計		2,440,000	—	1,354,000	1,086,000	—

(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)217,000 株及び 2017 年度ストックオプション(1)869,000 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
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 64 期中間会計期間 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 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	910 百万円
1 年超	3,870 百万円
合計	4,780 百万円

(金融商品関係)

第 64 期中間会計期間(2022 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、時価及びこれらの差額並びに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
有価証券				
その他有価証券				
投資信託	4,796	19,572	—	24,369
資産計	4,796	19,572	—	24,369
デリバティブ取引(※1、2)				
株式関連	666	—	—	666
通貨関連	—	△626	—	△626
デリバティブ取引計	666	△626	—	39

(※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 666 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 626 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、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	17,183
関連会社株式	5,183

(有価証券関係)

第64期中間会計期間(2022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がない株式等であり、(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	17,633	13,768	3,865
	小計	17,633	13,768	3,865
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	6,735	7,625	△889
	小計	6,735	7,625	△889
合計		24,369	21,393	2,976

(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、市場価格が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 64 期中間会計期間(2022 年 9 月 30 日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	7,428	-	666	666
合計		7,428	-	666	666

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

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 シンガポール ドル	3,222	-	△98	△98
合計		3,222	-	△98	△98

(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		6,241	-	△357
	豪ドル		193	-	△0
	ユーロ		319	-	△8
	香港ドル		976	-	△68
	人民元		6,254	-	△94
合計			13,984	-	△528

(持分法損益等)

第 64 期中間会計期間 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 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	5,327 百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	17,684 百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,341 百万円

(収益認識関係)

第 64 期中間会計期間(2022 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 64 期中間会計期間(自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 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 64 期中間会計期間(自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 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、記載していません。

[関連情報]

第 64 期中間会計期間(自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 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、記載していません。
- 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、記載していません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第 64 期中間会計期間(自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 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 64 期中間会計期間(自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 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 64 期中間会計期間(自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 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 64 期中間会計期間 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 年 9 月 30 日)
1株当たり純資産額	463 円 09 銭
1株当たり中間純利益金額	36 円 52 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 64 期中間会計期間 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2022 年 9 月 30 日)
中間純利益 (百万円)	7,091
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)	7,091
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)217,000 株、 2017 年度ストックオプション(1)869,000 株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第 64 期中間会計期間 (2022 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)	89,911
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)	89,911
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>

運用の基本方針

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

基本方針

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

運用方法

(1)投資対象

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

(2)投資態度

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

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

証券投資信託 日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

証券投資信託 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

証券投資信託 日本債券インデックスマザーファンド

証券投資信託 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

証券投資信託 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

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

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

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

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

運用制限

- (1) 投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- (2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引の指図ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れの指図は行ないません。
- (3) 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- (4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- (5) 外国為替の売買の予約取引の指図は、約款第24条の範囲で行ないません。
- (6) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

収益分配方針

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

①分配対象額の範囲

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

②分配対象額についての分配方針

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

③留保益の運用方針

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

（信託の種類、委託者および受託者）

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

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

（信託の目的、金額および追加信託の限度額）

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

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

③ 委託者は、受託者と合意の上、前項の限度額を変更することができます。

（信託期間）

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

（受益権の取得申込の勧誘の種類）

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

（当初の受益者）

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

（受益権の分割および再分割）

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

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

（追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法）

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

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。））、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

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

（追加日時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わないものとします。

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

（受益権の設定に係る受託者の通知）

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

（受益権の申込単位および価額）

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

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

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

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

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

(受益権の譲渡に係る記載または記録)

第12条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

- ② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等(当該他の振替機関等の上位機関を含みます。)に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ③ 委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(受益権の譲渡の対抗要件)

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

(無記名式の受益証券の再交付)

第14条 (削除)

(記名式の受益証券の再交付)

第15条 (削除)

(毀損した場合等の再交付)

第16条 (削 除)

(受益証券の再交付の費用)

第17条 (削 除)

(投資の対象とする資産の種類)

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

1. 有価証券
2. 金銭債権
3. 約束手形

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

1. 為替手形

(運用の指図範囲)

第19条 委託者は、信託金を、主として日興アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者として締結された次の証券投資信託(その受益権を他の証券投資信託の信託財産に取得させることを目的とした証券投資信託であり、以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

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

なお、第9号および第10号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

② 前項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することの指図ができます。

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

(受託者の自己または利害関係人等との取引)

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

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

についても同様とします。

(運用の基本方針)

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

(同一銘柄の投資信託証券への投資制限)

第22条 (削除)

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

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

(外国為替予約の指図)

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

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

(信託業務の委託等)

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

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
 2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
 3. 信託財産の保管等を委託する場合においては、当該財産の分別管理を行なう体制が整備されていること
 4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること
- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務(裁量性のないものに限ります。)を、受託者および委託者が適当と認める者(受託者の利害関係人を含みます。)に委託することができるものとします。
1. 信託財産の保存に係る業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
 4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

(有価証券の保管)

第26条 (削除)

(混蔵寄託)

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

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

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

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することが

あります。

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

（一部解約の請求および有価証券の売却等の指図）

第29条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第30条 委託者は、前条の規定による一部解約の代金および売却代金、有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等ならびにその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第31条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

- ② 前項の資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、一部解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
2. 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
3. 借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内

- ③ 一部解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。

- ④ 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。

- ⑤ 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

（損益の帰属）

第32条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

（受託者による資金の立替え）

第33条 信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は、資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

（信託の計算期間）

第34条 この信託の計算期間は、毎月16日から翌月15日までとすることを原則とします。

- ② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、第1計算期間は2005年9月29日から2005年10月17日までとし、最終計算期間の終了日は第3条に定める信託期間の終了日とします。

（信託財産に関する報告）

第35条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

- ② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

（信託事務等の諸費用）

第36条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託者の立替えた立替金の利息（第2項各号に掲げる諸費用を含め、以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から

支弁します。

- ② 前項に定める諸費用のほか、以下の諸費用（消費税等相当額を含みます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができます。
1. 受益証券の発行および管理事務に係る費用（券面の作成、印刷、発行および交付に係る費用ならびに印紙税を含みます。）
 2. 有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書（これらの訂正に係る書類を含みます。）の作成、印刷および提出に係る費用
 3. 目論見書および仮目論見書（これらの訂正事項分を含みます。）の作成、印刷および交付に係る費用（これらを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）
 4. 信託約款の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）
 5. 運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）
 6. この信託の受益者に対して行なう公告に係る費用ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用
 7. 格付の取得に要する費用
 8. この信託の監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用
 9. この信託の主要投資対象の1つである「日本リートインデックスJ-REITマザーファンド」の運用の基本方針に規定する「東証REIT指数（配当込み）」その他これに類する標章の使用料
 10. この信託の主要投資対象の1つである「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」の運用の基本方針に規定する「S&P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」その他これに類する標章の使用料
- ③ 委託者は、前項に定める諸費用の支払いを信託財産のために行ない、支払金額の支弁を信託財産から受けることができ、また、現に信託財産のために支払った金額の支弁を受けることについて、あらかじめ受領する金額に上限を付することができます。この場合、委託者は、信託財産の規模等を考慮して、かかる上限額を定期的に見直すことができます。
- ④ 前項に基づいて実際に支払った金額の支弁を受ける代わりに、委託者は、かかる諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、実際の費用額にかかわらず、合理的な見積率により計算した金額を諸費用とみなして、その支弁を信託財産から受けることもできます。この場合、委託者は、かかる見積率に上限を付することとし、その上限の範囲内で、かかる見積率を何時にても見直すことができるものとし、
- ⑤ 前項の場合において、第2項に定める諸費用としてみなす額は、信託財産の純資産総額に見積率（前項に規定する見積率の上限は、年万分の10とします。）を乗じて得た額とし、第34条に規定する計算期間を通じて毎日計上され、委託者が定めた時期に信託財産中から支弁するものとし、

（信託報酬等の額）

第37条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第34条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の95の率を乗じて得た額とします。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。
- ③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁の時に信託財産中から支弁します。

（収益分配）

第38条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。ただし、第1、第2および第3計算期末には、収益の分配は行ないません。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第39条 受託者は、収益分配金については、原則として毎計算期間終了日（第1計算期から第3計算期までを除きます。）の翌営業日までに、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）については第40条第4項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第40条第5項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第40条 収益分配金は、第1、第2および第3計算期を除く毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金に係る計算期間の末日以前において一部解約が行なわれた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者（第41条に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に支払います。なお、平成19年1月4日以降においても、第42条に規定する時効前の収益分配金に係る収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引き換えに受益者に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日（第1計算期から第3計算期までを除きます。）の翌営業日に収益分配金が委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関に支払われます。この場合、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の取得の申込に応じたものとしします。当該取得により増加した受益権は、第9条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。ただし、第43条第4項により信託の一部解約が行なわれた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、第1項の規定に準じて受益者に支払います。

③ 委託者は、第1項の規定にかかわらず、委託者の自らの募集に係る受益権に帰属する収益分配金（受益者が自己の有する受益権の全部もしくは一部の口数について、委託者に対し、この信託の収益分配金の再投資に係る受益権の取得の申込をしないことをあらかじめ申し出た場合において、委託者が、当該申し出を受け付けた受益権に帰属する収益分配金を除きます。）をこの信託の受益権の取得申込金として、各受益者ごとに当該収益分配金の再投資に係る受益権の取得の申込に応じたものとしします。当該取得により増加した受益権は、第9条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。ただし、第43条第4項により信託の一部解約が行なわれた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、第1項の規定に準じて受益者に支払います。

④ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者（第41条に規定する委託者の指定する口座管理機関を含みます。）、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

⑤ 一部解約金は、第43条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として5営業日目から当該受益者に支払います。

⑥ 前各項に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関の営業所等において行なうものとしします。ただし、委託者の自らの募集に係る受益権に帰属する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行なうものとしします。

- ⑦ 収益分配金、償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

(委託者の自らの募集に係る受益権の口座管理機関)

第41条 委託者は、委託者の自らの募集に係る受益権について、口座管理機関を指定し、振替口座簿への記載または記録等に関する業務を委任することができます。

(収益分配金および償還金の時効)

第42条 受益者が、収益分配金については第40条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金については第40条第4項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(一部解約)

第43条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

- ② 平成19年1月4日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日以前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。
- ③ 前2項の規定にかかわらず、一部解約の実行の請求日がニューヨーク証券取引所の休業日またはニューヨークの銀行休業日に該当する場合は、受益権の一部解約の実行を受け付けないものとします。
- ④ 委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第1項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。
- ⑤ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額から当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。
- ⑥ 委託者は、投資対象とする投資信託証券（マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。）からの換金ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受付を中止することおよび既に受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取消すことができます。
- ⑦ 前項により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が第3項に規定する一部解約の請求を受け付けられない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の請求を受け付けることができる日とします。）を一部解約の実行の請求日として、第5項の規定に準じて算定した価額とします。
- ⑧ 委託者は、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が10億口を下ることとなった場合には、第44条の規定に従ってこの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

(質権口記載または記録の受益権の取り扱い)

第43条の2 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受け付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

(信託契約の解約)

第44条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出るものとします。

- ② 委託者は、前項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合は、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べる

べき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託契約の解約を行ないません。
- ⑤ 委託者は、この信託契約の解約を行なわないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
- ⑥ 前3項の規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合は、適用しないものとします。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第45条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第49条の規定に従うものとします。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第46条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第49条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第47条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

- ② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第48条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第49条の規定に従い新受託者を選任します。

- ② 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(信託約款の変更)

第49条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意の上、この信託約款を変更することができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出るものとします。

- ② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更を行ないません。
- ⑤ 委託者は、前項の規定により信託約款の変更を行なわないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。

(反対者の買取請求権)

第50条 第44条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行なう場合において、第44条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

(公告)

第51条 委託者が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

(運用報告書の交付省略)

第51条の2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項で定める運用報告書の交付に代えて、当該運用報告書を次のアドレスに掲載するものとします。

www.nikkoam.com/

- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第52条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

附 則

第1条 この約款において「自動けいぞく投資契約」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関が締結する「自動けいぞく投資契約」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合、「自動けいぞく投資契約」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第40条第7項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額を言い、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

第3条 平成18年12月29日現在の信託約款第9条、第10条および第12条から第17条までの規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 2005年9月29日

東京都港区赤坂九丁目7番1号
委託者 日興アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区大手町二丁目2番2号
受託者 野村信託銀行株式会社

