

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 20)

愛称 「DC Aナビ 20」

追加型投信／内外／資産複合

◆この目論見書により行なう「年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 20)」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により有価証券届出書を 2025 年 1 月 28 日に関東財務局長に提出しており、2025 年 1 月 29 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	: 2025 年 1 月 28 日
発行者名	: 日興アセットマネジメント株式会社
代表者の役職氏名	: 代表取締役社長 ステファニー・ドゥルーズ
本店の所在の場所	: 東京都港区赤坂九丁目7番1号
有価証券届出書（訂正届出書を含みます。） の写しを縦覧に供する場所	: 該当事項はありません。

設定・運用は

日興アセットマネジメント

投資信託は、金融機関の預金や保険契約とは商品性が異なります。

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

－ 目 次 －

	頁
第一部【証券情報】	1
第二部【ファンド情報】	3
第1【ファンドの状況】	3
第2【管理及び運営】	64
第3【ファンドの経理状況】	68
第4【内国投資信託受益証券事務の概要】	281
第三部【委託会社等の情報】	282
約款	340

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

- 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 20) (以下「ファンド」といいます。)
- ・愛称として「DC Aナビ 20」という名称を用いることがあります。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

- 5兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

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

(5)【申込手数料】

- 販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社の照会先にお問い合わせください。
- ・販売会社における申込手数料率は1.1%（税抜1%）が上限となっております。

(6)【申込単位】

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

(7)【申込期間】

- 2025年1月29日から2025年7月28日までとします。
- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8)【申込取扱場所】

- 販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(9)【払込期日】

- ・取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する期日までに販売会社に支払うものとします。

- ・申込期間における各取得申込受付日の発行価額の総額（設定総額）は、販売会社によって、追加設定が行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

◇追加型投信

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

◇内外

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

◇資産複合

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

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

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

◇年1回

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

◇グローバル (含む日本)

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

◇ファミリーファンド

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

◇為替ヘッジあり (部分ヘッジ)

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

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

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

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

③ ファンドの特色

1. 4つの異なる資産に国際分散投資します。

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

2. インデックスファンドで構成しています。

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

<国内株式>

「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

<海外株式>

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

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

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

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

<国内債券>

「日本債券インデックスマザーファンド」

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

<海外債券>

「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

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

「海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド」

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

著作権などについて

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

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

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

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

3. 株式に20%、債券などに80%投資します。

資産の標準実質組入比率は、株式20%、債券など80%とします。

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

各マザーファンドおよび短期金融資産への投資比率は以下を基本とします。

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

※基本投資比率は必要に応じて変更することがあります。

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

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

ファンドの仕組み

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



主な投資制限

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

分配方針

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

④ 信託金限度額

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

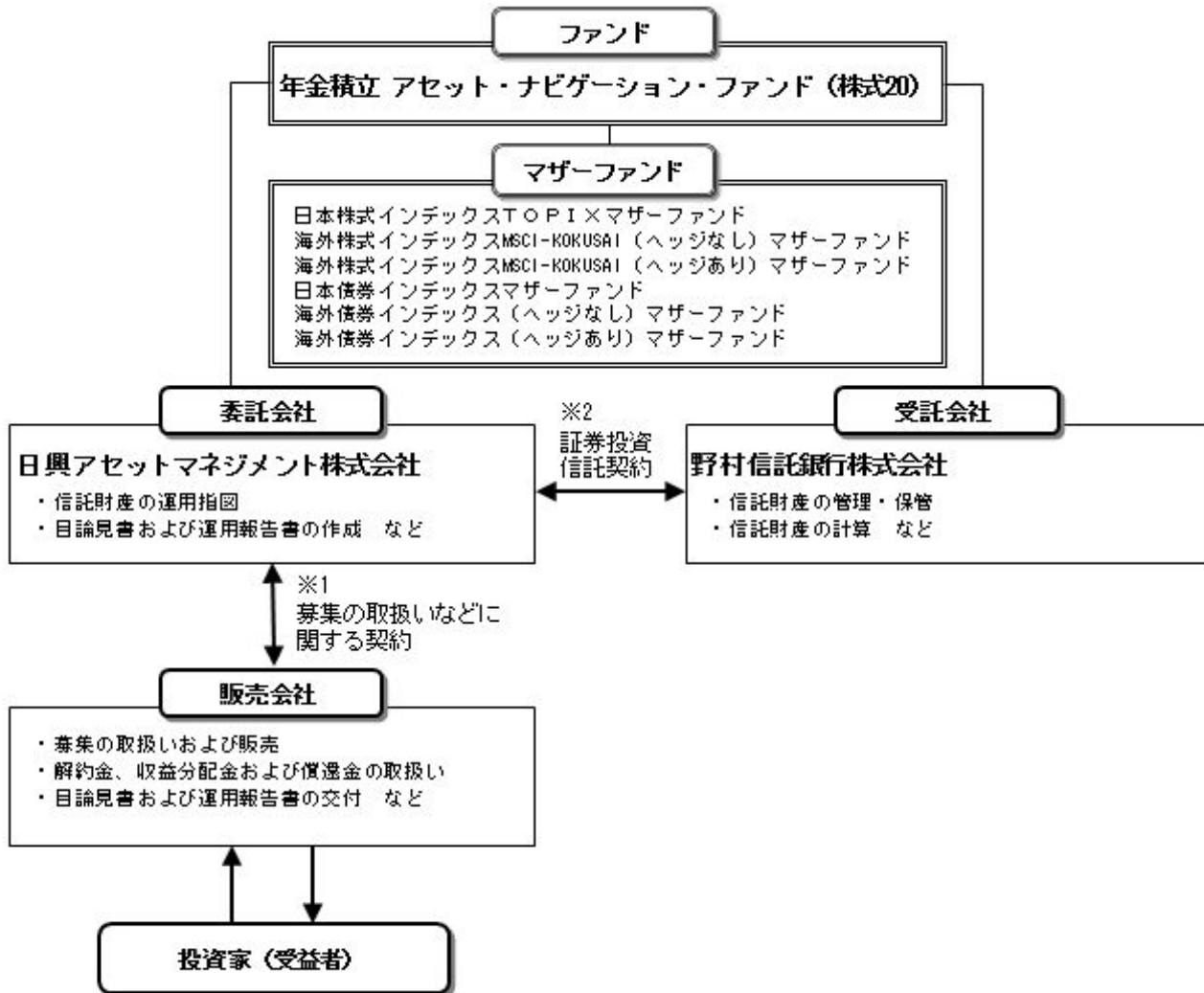
(2) 【ファンドの沿革】

2001年10月17日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

① ファンドの仕組み



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

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

② 委託会社の概況（2024年10月末現在）

1) 資本金

17,363 百万円

2) 沿革

1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

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

3) 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- ・主として、以下に掲げる各マザーファンドの受益証券に投資を行ない、信託財産の中長期的な成長をめざします。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

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

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」

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

株式の標準実質組入比率……………20%

公社債および短期金融資産の標準実質組入比率……………80%

- ・組入比率の調整にあたっては、原則としてマザーファンド受益証券への投資比率を調整することで行ないますが、市況動向などによっては内外の有価証券などへの直接投資を行なうことがあります。
- ・また、資金動向などによっては組入比率を引き下げることがあります。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

<年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）>

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」

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

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

証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」

- ① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1) 有価証券

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

3) 金銭債権

4) 約束手形

5) 為替手形

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

1) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」受益証券

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

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

4) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券

- 5) 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」受益証券
 - 6) 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」受益証券
 - 7) 株券または新株引受権証書
 - 8) 国債証券
 - 9) 地方債証券
 - 10) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 11) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 12) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 13) コマーシャル・ペーパー
 - 14) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - 15) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)～14)の証券または証書の性質を有するもの
 - 16) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。）
 - 17) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で18)に定めるもの以外のもの
 - 18) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 19) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 20) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
 - 21) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 22) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 23) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
 - 24) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 25) 外国の者に対する権利で24)の有価証券の性質を有するもの
- ③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
- ④ 次の取引ができます。
- 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
 - 10) 資金の借入
- <日本株式インデックストップIXマザーファンド>
わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
- ① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限りません。）
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- ② 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる

権利を除きます。)に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券(短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)を除きます。)には投資しません。

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

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

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

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

券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)

- 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)~7)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 - 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)で12)に定めるもの以外のもの
 - 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 - 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 - 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
- ③ 次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
- ④ 次の取引ができます。
- 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
- <海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド>
日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
- ① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。)
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- ② 主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券(短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。))を除きます。)
- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券

- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 - 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)～7)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 11) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）で12)に定めるもの以外のもの
 - 12) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 13) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 14) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
 - 15) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
- ③ 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
- ④ 次の取引ができます。
- 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 為替先渡取引
 - 6) 有価証券の貸付
 - 7) 公社債の空売
 - 8) 公社債の借入
 - 9) 外国為替予約取引
- <日本債券インデックスマザーファンド>
わが国の公社債を主要投資対象とします。
- ① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。）
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- ② 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
- 1) 国債証券
 - 2) 地方債証券
 - 3) 特別の法律により法人の発行する債券

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

限ります。)

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

④ 次の取引ができます。

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

<海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド>

内外の公社債を主要投資対象とします。

① 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

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

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

- 1) 預金

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

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

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数）*配当込みの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主としてわが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）配当込みの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1999年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

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

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

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

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

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

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

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

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

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

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

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

<海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

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

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

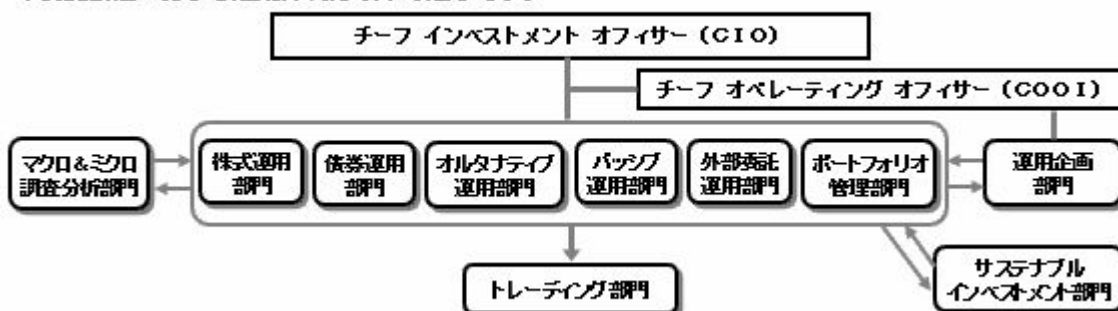
<海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド>

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

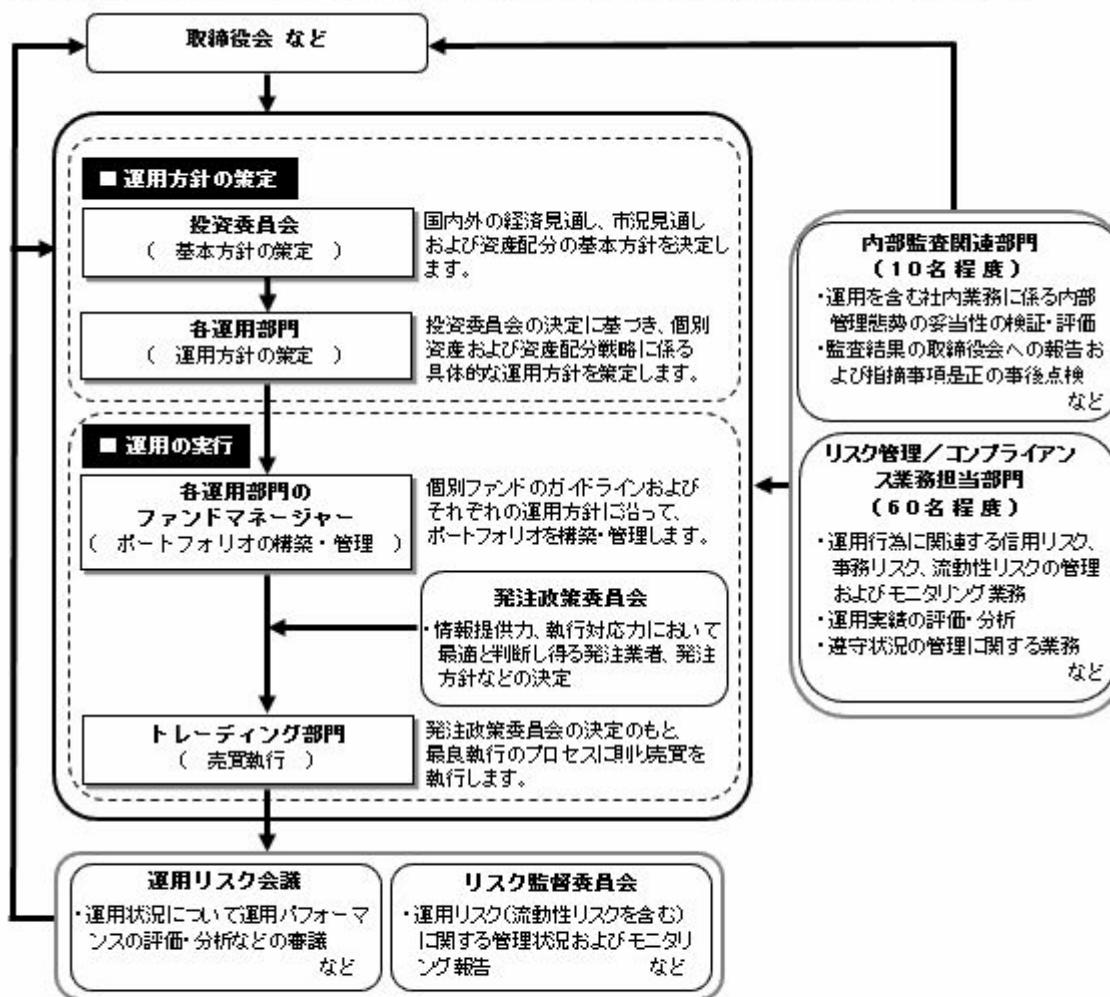
*FTSE 世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLC は、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利は FTSE Fixed Income LLC に帰属します。

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



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



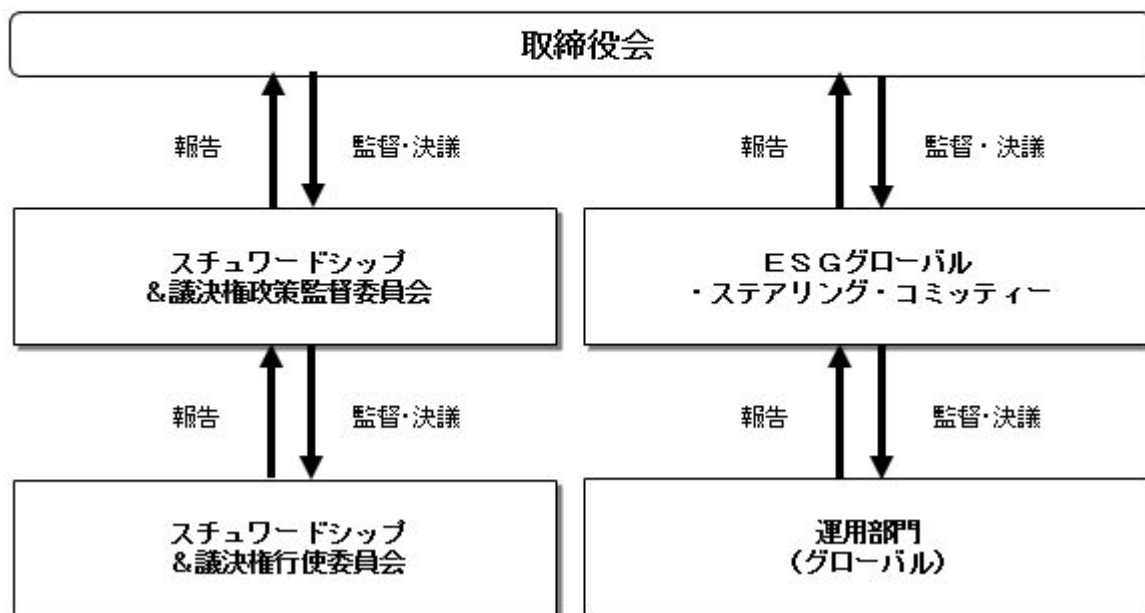
委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティー

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

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



※上記体制は2024年10月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

① 収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

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

(5) 【投資制限】

① 約款に定める投資制限

＜年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 20）＞

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

産の純資産総額の範囲内とします。

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

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

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

ることができます。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

<日本債券インデックスマザーファンド>

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

<海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

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

- 5) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド>

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

りではありません。

- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
 - 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
 - 11) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
 - 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
 - 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
- ② 法令による投資制限
- 同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）
- 同一法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行なう投資信託全体で、当該株式の議決権の過半数を保有することとなる取引は行ないません。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

① 価格変動リスク

- ・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。

② 流動性リスク

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

③ 信用リスク

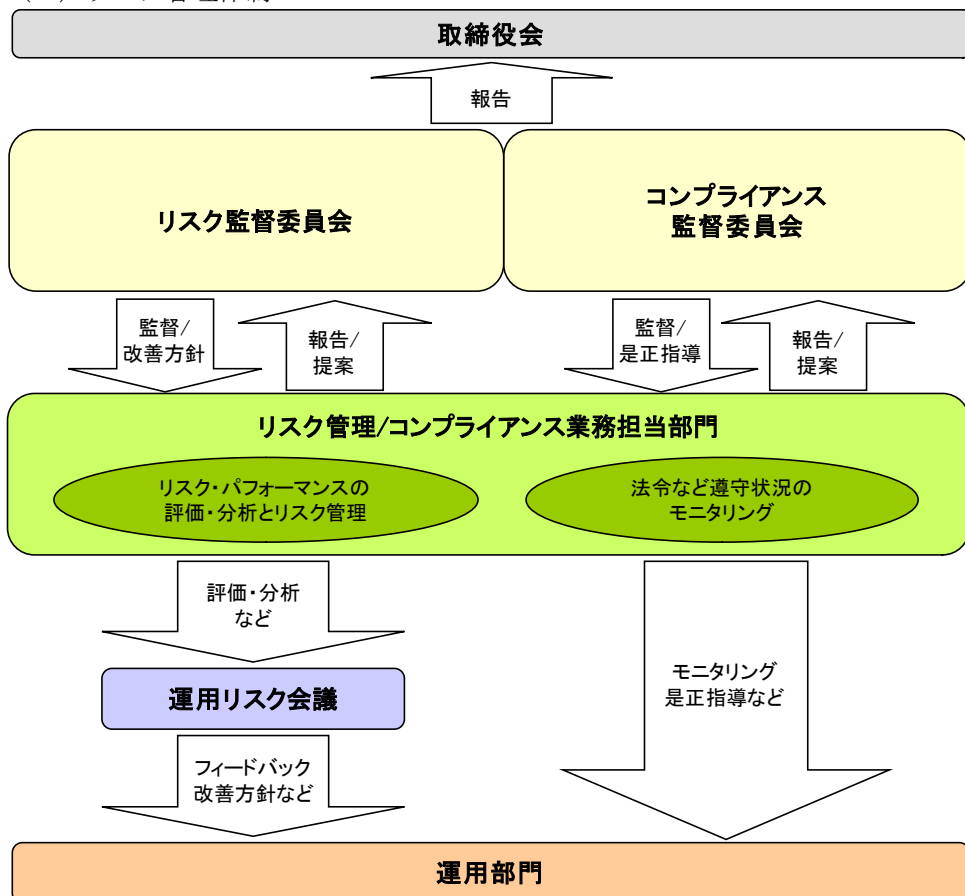
- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れが生じた場合や廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。

- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト（債務不履行）が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
 - ・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴ない価格が下落するリスクもあります。
 - ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。
- ④ 為替変動リスク
- ・外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。
 - ・「海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド」および「海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」は原則として為替ヘッジを行ないませんが、為替ヘッジを行なうにあたっては、円の金利が為替ヘッジを行なう通貨の金利より低い場合、この金利差に相当するヘッジコストが発生します。為替および金利の動向によっては、為替ヘッジに伴うヘッジコストが予想以上に発生する場合があります。

<その他の留意事項>

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

(2) リスク管理体制



■全社的リスク管理

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

■運用状況の評価・分析および運用リスク管理

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

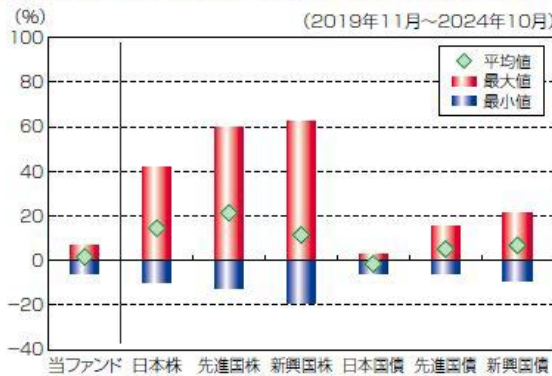
■法令など遵守状況のモニタリング

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

※上記体制は2024年10月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	1.6%	14.5%	21.3%	11.4%	-1.5%	5.2%	6.7%
最大値	6.9%	42.1%	59.8%	62.7%	2.9%	15.3%	21.5%
最小値	-5.6%	-9.5%	-12.4%	-19.4%	-5.5%	-6.1%	-8.8%

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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2019年11月から2024年10月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

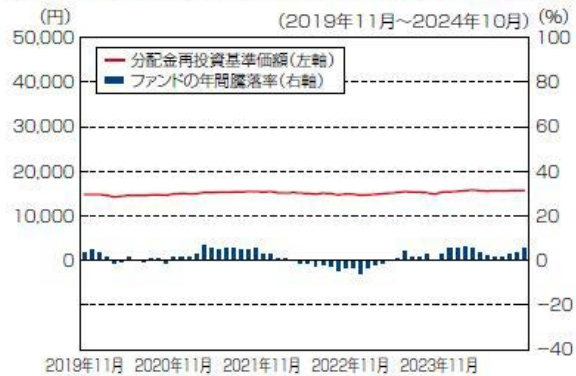
<各資産クラスの指数>

日本株 ……TOPIX(東証株価指数)配当込み
 先進国株 ……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)
 新興国株 ……MSCIエマージングマーケットインデックス(配当込み、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2019年11月末の基準価額を起点として指数化しています。

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

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

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

TOPIX（東証株価指数）配当込み

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

MSCI-KOKUSAI インデックス（配当込み、円ベース）

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

MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）

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

NOMURA-BPI 国債

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

FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

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

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

- ・販売会社における申込手数料率は1.1%（税抜1%）が上限となっております。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。

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

(2) 【換金（解約）手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.15%の率を乗じて得た額（1口当たり）が差し引かれます。

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

(3) 【信託報酬等】

① 信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.5885%（税抜0.535%）の率を乗じて得た額とします。

② 信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.535%	0.150%	0.350%	0.035%

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

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

③ 支払時期

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

(4) 【その他の手数料等】

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

- ① 組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料および先物・オプション取引などに要する費用。
- ② 信託財産の財務諸表の監査に要する費用（日々、計上されます。）。
- ③ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用、解約に伴う支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

<投資対象とするマザーファンドに係る費用>

- ・組入有価証券の売買時の売買委託手数料

- ・信託事務の処理に要する諸費用
- ・信託財産に関する租税 など

※監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

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

《確定拠出年金の場合》

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

《確定拠出年金でない場合》

① 個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

② 法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③ 個別元本

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

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

④ 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

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

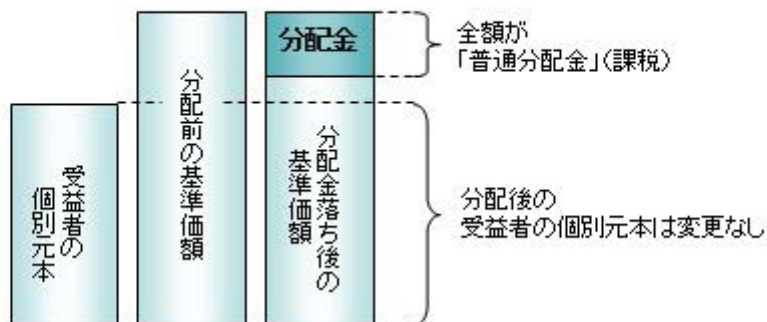
ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金

の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

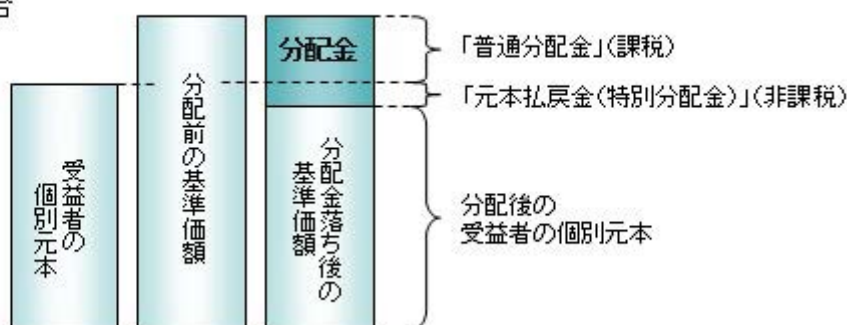
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



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

※上記は 2025 年 1 月 28 日現在のもので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

(参考情報) ファンドの総経費率

対象期間: 2023年10月27日~2024年10月28日

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
0.59%	0.58%	0.01%

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

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

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

5 【運用状況】

【年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）】

以下の運用状況は2024年10月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	3,242,846,767	95.03
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	169,431,733	4.97
合計（純資産総額）		3,412,278,500	100.00

(2) 【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	1,679,711,246	1.3157	2,209,996,272	1.3185	2,214,699,277	64.90
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	182,734,454	2.7841	508,765,142	2.8237	515,987,277	15.12
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	56,348,839	3.0537	172,072,449	3.0526	172,010,465	5.04
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	129,649,551	1.3093	169,762,299	1.3053	169,231,558	4.96
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	12,378,193	6.9568	86,112,613	6.9588	86,137,369	2.52
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	28,881,220	2.9400	84,911,656	2.9355	84,780,821	2.48

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.03
合計	95.03

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14 計算期間末 (2015年10月26日)	2,323	2,325	1.3723	1.3733
第15 計算期間末 (2016年10月26日)	2,400	2,402	1.3831	1.3841
第16 計算期間末 (2017年10月26日)	2,576	2,578	1.4396	1.4406
第17 計算期間末 (2018年10月26日)	2,617	2,619	1.4164	1.4174
第18 計算期間末 (2019年10月28日)	2,891	2,893	1.4687	1.4697
第19 計算期間末 (2020年10月26日)	3,015	3,017	1.4694	1.4704
第20 計算期間末 (2021年10月26日)	3,165	3,167	1.5409	1.5419
第21 計算期間末 (2022年10月26日)	3,098	3,100	1.4750	1.4760
第22 計算期間末 (2023年10月26日)	3,190	3,190	1.4867	1.4867
第23 計算期間末 (2024年10月28日)	3,393	3,393	1.5614	1.5614
2023年10月末日	3,187	—	1.4852	—
11月末日	3,290	—	1.5275	—
12月末日	3,303	—	1.5349	—
2024年1月末日	3,334	—	1.5480	—
2月末日	3,362	—	1.5650	—
3月末日	3,395	—	1.5781	—
4月末日	3,370	—	1.5630	—
5月末日	3,376	—	1.5507	—
6月末日	3,410	—	1.5632	—
7月末日	3,392	—	1.5554	—
8月末日	3,412	—	1.5628	—
9月末日	3,416	—	1.5631	—
10月末日	3,412	—	1.5665	—

② 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金(円)
第14期	2014年10月28日～2015年10月26日	0.0010
第15期	2015年10月27日～2016年10月26日	0.0010
第16期	2016年10月27日～2017年10月26日	0.0010
第17期	2017年10月27日～2018年10月26日	0.0010
第18期	2018年10月27日～2019年10月28日	0.0010
第19期	2019年10月29日～2020年10月26日	0.0010

第20期	2020年10月27日～2021年10月26日	0.0010
第21期	2021年10月27日～2022年10月26日	0.0010
第22期	2022年10月27日～2023年10月26日	0.0000
第23期	2023年10月27日～2024年10月28日	0.0000

③【収益率の推移】

期	期間	収益率 (%)
第14期	2014年10月28日～2015年10月26日	6.08
第15期	2015年10月27日～2016年10月26日	0.86
第16期	2016年10月27日～2017年10月26日	4.16
第17期	2017年10月27日～2018年10月26日	△1.54
第18期	2018年10月27日～2019年10月28日	3.76
第19期	2019年10月29日～2020年10月26日	0.12
第20期	2020年10月27日～2021年10月26日	4.93
第21期	2021年10月27日～2022年10月26日	△4.21
第22期	2022年10月27日～2023年10月26日	0.79
第23期	2023年10月27日～2024年10月28日	5.02

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

(4)【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数 (口)	解約口数 (口)
第14期	2014年10月28日～2015年10月26日	249,489,847	225,223,159
第15期	2015年10月27日～2016年10月26日	219,948,062	177,581,645
第16期	2016年10月27日～2017年10月26日	289,166,294	235,119,540
第17期	2017年10月27日～2018年10月26日	296,266,553	237,811,695
第18期	2018年10月27日～2019年10月28日	315,074,712	194,178,364
第19期	2019年10月29日～2020年10月26日	378,453,487	295,668,704
第20期	2020年10月27日～2021年10月26日	306,629,427	304,267,500
第21期	2021年10月27日～2022年10月26日	308,980,135	262,381,026
第22期	2022年10月27日～2023年10月26日	242,774,249	197,512,138
第23期	2023年10月27日～2024年10月28日	275,222,314	247,710,550

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2024年10月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	61,138,024,180	98.48
コール・ローン等、その他資産 (負債控除後)	—	944,980,323	1.52
合計 (純資産総額)		62,083,004,503	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	943,075,000	1.52

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	841,100	2,707.00	2,276,857,700	2,682.50	2,256,250,750	3.63
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,022,000	1,565.73	1,600,181,860	1,628.50	1,664,327,000	2.68
日本	株式	日立製作所	電気機器	411,500	4,030.27	1,658,457,950	3,924.00	1,614,726,000	2.60
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	554,100	2,698.00	1,494,961,800	2,723.50	1,509,091,350	2.43
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	126,900	9,234.20	1,171,820,520	9,533.00	1,209,737,700	1.95
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,800	66,350.00	1,048,330,000	69,780.00	1,102,524,000	1.78
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	325,100	3,160.00	1,027,316,000	3,273.00	1,064,052,300	1.71
日本	株式	三菱商事	卸売業	321,400	2,805.00	901,527,000	2,835.50	911,329,700	1.47
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	112,500	7,539.00	848,137,500	7,653.00	860,962,500	1.39
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	152,200	5,521.00	840,296,200	5,568.00	847,449,600	1.37
日本	株式	信越化学工業	化学	142,100	5,593.00	794,765,300	5,755.00	817,785,500	1.32
日本	株式	任天堂	その他製品	99,900	8,160.00	815,184,000	8,145.00	813,685,500	1.31
日本	株式	三井物産	卸売業	250,800	3,152.00	790,521,600	3,162.00	793,029,600	1.28
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	33,500	23,860.00	799,310,000	23,400.00	783,900,000	1.26
日本	株式	第一三共	医薬品	149,800	4,895.67	733,371,940	4,981.00	746,153,800	1.20
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	78,300	9,009.00	705,404,700	9,498.00	743,693,400	1.20
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4,720,700	146.80	692,998,760	147.70	697,247,390	1.12

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	210,300	3,115.00	655,084,500	3,212.00	675,483,600	1.09
日本	株式	HOYA	精密機器	31,200	20,100.00	627,120,000	20,725.00	646,620,000	1.04
日本	株式	三菱重工業	機械	279,500	2,082.00	581,919,000	2,193.00	612,943,500	0.99
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	141,200	4,133.00	583,579,600	4,264.00	602,076,800	0.97
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	374,900	1,582.00	593,091,800	1,557.50	583,906,750	0.94
日本	株式	KDDI	情報・通信業	116,700	4,764.00	555,958,800	4,778.00	557,592,600	0.90
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,539,200	188.20	477,877,440	192.80	489,557,760	0.79
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	9,400	50,430.00	474,042,000	49,520.00	465,488,000	0.75
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	49,900	8,212.52	409,804,758	9,148.00	456,485,200	0.74
日本	株式	富士通	電気機器	147,100	2,971.00	437,034,100	2,963.00	435,857,300	0.70
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	184,900	2,275.55	420,750,422	2,199.00	406,595,100	0.65
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	94,700	4,133.00	391,395,100	4,281.00	405,410,700	0.65
日本	株式	キヤノン	電気機器	78,900	5,046.00	398,129,400	5,004.00	394,815,600	0.64

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.26
		建設業	2.08
		食料品	3.18
		繊維製品	0.39
		パルプ・紙	0.14
		化学	5.51
		医薬品	4.78
		石油・石炭製品	0.54
		ゴム製品	0.57
		ガラス・土石製品	0.66
		鉄鋼	0.82
		非鉄金属	0.78
		金属製品	0.50
		機械	5.55
		電気機器	17.33
		輸送用機器	7.24
		精密機器	2.51
		その他製品	2.47
		電気・ガス業	1.38
		陸運業	2.28
		海運業	0.67
		空運業	0.35
倉庫・運輸関連業	0.15		
情報・通信業	7.42		

	卸売業	6.93
	小売業	4.36
	銀行業	7.67
	証券、商品先物取引業	0.80
	保険業	3.11
	その他金融業	1.19
	不動産業	1.84
	サービス業	4.93
合 計		98.48

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2024年1月2月	買建	35	日本円	933,434,000	943,075,000	1.52

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

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2024年10月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	326,390,973,269	72.10
	カナダ	14,674,702,032	3.24
	ドイツ	10,383,316,526	2.29
	イタリア	2,482,938,504	0.55
	フランス	11,746,676,142	2.59
	オランダ	7,380,187,993	1.63
	スペイン	3,120,049,953	0.69
	ベルギー	923,717,323	0.20
	オーストリア	209,554,514	0.05
	ルクセンブルク	174,185,898	0.04
	フィンランド	1,136,636,228	0.25
	アイルランド	8,874,757,180	1.96
	ポルトガル	155,024,363	0.03
	イギリス	15,954,692,937	3.52
	スイス	12,570,455,295	2.78
	スウェーデン	3,684,386,044	0.81
	ノルウェー	664,509,628	0.15
	デンマーク	3,843,783,882	0.85
	ケイマン	604,785,624	0.13
	オーストラリア	7,817,085,957	1.73
	バミューダ	445,811,419	0.10
	ニュージーランド	270,290,637	0.06
	香港	1,859,660,842	0.41
	シンガポール	1,266,713,400	0.28
	イスラエル	941,430,260	0.21
	ジャージー	679,064,528	0.15
アラブ首長国連邦	0	0.00	
マン島	38,332,367	0.01	
小計		438,293,722,745	96.82
新株予約権証券	カナダ	0	0.00
投資証券	アメリカ	7,706,995,832	1.70
	カナダ	14,586,499	0.00
	フランス	153,744,765	0.03
	ベルギー	28,534,539	0.01

	イギリス	139,045,168	0.03
	オーストラリア	547,363,751	0.12
	香港	75,368,301	0.02
	シンガポール	95,096,707	0.02
	小計	8,760,735,562	1.94
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	5,628,014,294	1.24
合計（純資産総額）		452,682,472,601	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	4,720,281,720	1.04
	買建	ドイツ	766,616,203	0.17

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	4,724,321,420	1.04
	売建	—	26,663,606	△0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	1,086,420	21,746.20	23,625,512,688	21,407.42	23,257,459,449	5.14
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	643,644	35,553.83	22,884,010,901	35,352.56	22,754,465,703	5.03
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウ ェア・サ ービス	311,884	65,780.96	20,516,030,800	66,453.90	20,725,911,017	4.58
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	413,920	28,858.20	11,944,986,641	29,611.03	12,256,600,518	2.71
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディ ア・娯楽	96,790	88,074.13	8,524,695,043	90,924.15	8,800,548,672	1.94
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディ ア・娯楽	259,790	25,392.08	6,596,609,191	26,804.03	6,963,420,097	1.54
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディ ア・娯楽	223,110	25,656.34	5,724,186,820	27,062.14	6,037,836,197	1.33
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・ 半導体製 造装置	195,160	26,579.71	5,187,298,155	27,138.96	5,296,441,307	1.17
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・ 自動車部 品	126,915	41,358.35	5,248,995,194	39,569.98	5,022,024,266	1.11
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・ バイオテ	35,659	137,154.42	4,890,789,748	130,106.96	4,639,484,129	1.02

			クノロジ ー・ライ フサイエ ンス						
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	126,780	34,155.70	4,330,260,711	34,478.35	4,371,165,517	0.97
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サー ビス	58,535	69,754.09	4,083,056,032	69,900.05	4,091,599,684	0.90
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	198,509	18,358.44	3,644,316,281	17,928.25	3,558,919,297	0.79
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケ ア機器・ サービス	40,650	86,738.99	3,525,940,285	86,493.17	3,515,947,539	0.78
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サー ビス	69,752	43,284.99	3,019,215,125	44,580.18	3,109,556,883	0.69
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サー ビス	36,610	77,950.79	2,853,778,437	78,923.33	2,889,383,170	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用 品・パー ソナル用 品	104,529	25,845.32	2,701,585,538	25,528.82	2,668,502,277	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	43,925	61,288.53	2,692,098,785	60,306.77	2,648,974,995	0.59
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需 品流通・ 小売り	19,584	136,927.04	2,681,579,167	135,063.38	2,645,081,383	0.58
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	106,491	24,717.60	2,632,202,283	24,676.12	2,627,784,738	0.58
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	142,520	17,529.10	2,498,248,045	17,243.02	2,457,475,923	0.54
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需 品流通・ 小売り	195,256	12,676.83	2,475,228,368	12,504.75	2,441,629,340	0.54
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・ バイオテ クノロジ ー・ライ フサイエ ンス	77,866	28,861.27	2,247,311,961	30,958.45	2,410,611,446	0.53
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディ ア・娯楽	19,065	115,949.03	2,210,568,356	115,804.61	2,207,814,958	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	311,349	6,435.97	2,003,835,813	6,500.50	2,023,926,790	0.45
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウ ェア・サ ービス	72,973	26,659.61	1,945,431,924	26,819.39	1,957,091,959	0.43
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウ ェア・サ ービス	42,956	44,626.27	1,916,966,244	45,538.89	1,956,168,817	0.43
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・ 半導体製 造装置	17,697	110,725.39	1,959,507,280	105,706.82	1,870,693,594	0.41
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲 料・タバ コ	180,712	10,281.58	1,858,006,476	10,127.94	1,830,241,884	0.40
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・ バイオテ クノロジ	112,083	15,975.48	1,790,580,532	16,106.08	1,805,217,899	0.40

			ー・ライ フサイエ ンス						
--	--	--	--------------------	--	--	--	--	--	--

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	4.06
		素材	3.51
		資本財	6.99
		商業・専門サービス	1.58
		運輸	1.55
		自動車・自動車部品	1.68
		耐久消費財・アパレル	1.21
		消費者サービス	1.93
		メディア・娯楽	6.56
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.78
		生活必需品流通・小売り	1.73
		食品・飲料・タバコ	2.99
		家庭用品・パーソナル用品	1.49
		ヘルスケア機器・サービス	3.92
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.40
		銀行	5.60
		金融サービス	6.92
		保険	3.06
		ソフトウェア・サービス	9.85
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.55
電気通信サービス	1.16		
公益事業	2.68		
半導体・半導体製造装置	9.31		
不動産管理・開発	0.29		
新株予約権証券	—	—	—
投資証券	—	—	1.94
合計			98.76

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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 EMINI2412	買建	105	米ドル	30,712,750	4,718,706,910	30,723,000	4,720,281,720	1.04
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取	DJSTX5 2412	買建	105	ユーロ	4,677,290	779,844,561	4,597,950	766,616,203	0.17

	引所								
--	----	--	--	--	--	--	--	--	--

(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	26,700,000.00	4,069,393,070	4,084,553,630	0.90
	ユーロ	買建	3,850,000.00	635,354,410	639,767,790	0.14
	加ドル	売建	119,000.00	13,132,483	13,132,756	△0.00
	英ポンド	売建	68,000.00	13,525,941	13,530,850	△0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド

以下の運用状況は2024年10月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	19,391,271,477	71.84
	カナダ	879,789,210	3.26
	ドイツ	615,132,128	2.28
	イタリア	147,660,240	0.55
	フランス	702,041,836	2.60
	オランダ	437,524,445	1.62
	スペイン	183,547,938	0.68
	ベルギー	46,369,827	0.17
	オーストリア	11,397,896	0.04
	ルクセンブルク	12,523,807	0.05
	フィンランド	63,268,885	0.23
	アイルランド	526,820,983	1.95
	ポルトガル	10,838,009	0.04
	イギリス	952,610,986	3.53
	スイス	743,044,889	2.75
	スウェーデン	214,289,751	0.79
	ノルウェー	41,555,290	0.15
	デンマーク	230,033,947	0.85
	ケイマン	35,661,191	0.13
	オーストラリア	465,364,817	1.72
	バミューダ	25,876,915	0.10
	ニュージーランド	14,429,564	0.05
	香港	105,628,700	0.39
	シンガポール	74,250,301	0.28
イスラエル	51,962,950	0.19	
ジャージー	45,658,880	0.17	
マン島	2,554,976	0.01	
	小計	26,031,109,838	96.45
新株予約権証券	カナダ	0	0.00
投資証券	アメリカ	470,365,456	1.74
	フランス	4,433,644	0.02
	イギリス	7,519,025	0.03
	オーストラリア	30,950,586	0.11
	香港	4,833,527	0.02

	シンガポール	8,872,088	0.03
	小計	526,974,326	1.95
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	432,416,411	1.60
合計（純資産総額）		26,990,500,575	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	404,595,576	1.50
	買建	ドイツ	65,709,960	0.24

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建	—	26,944,827,943	△99.83

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	64,600	21,746.20	1,404,804,882	21,407.42	1,382,919,939	5.12
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロ ジー・ハ ードウェ アおよび 機器	38,260	35,553.83	1,360,289,628	35,352.56	1,352,589,099	5.01
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウ ェア・サ ービス	18,550	65,780.96	1,220,236,920	66,453.90	1,232,720,016	4.57
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	24,620	28,858.20	710,488,914	29,611.03	729,023,736	2.70
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディ ア・エン ターテイン メント	5,760	88,074.13	507,306,989	90,924.15	523,723,116	1.94
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディ ア・エン ターテイン メント	15,420	25,392.08	391,545,916	26,804.03	413,318,210	1.53
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディ ア・エン ターテイン メント	13,330	25,656.34	341,999,060	27,062.14	360,738,454	1.34
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・ 半導体製 造装置	11,610	26,579.71	308,590,549	27,138.96	315,083,437	1.17
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・ 自動車部 品	7,560	41,358.35	312,669,138	39,569.98	299,149,064	1.11
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・ バイオテ クノロジ ー・ライ フサイエ ンス	2,120	137,154.42	290,767,388	130,106.96	275,826,758	1.02
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	7,500	34,155.70	256,167,813	34,478.35	258,587,643	0.96
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL	金融サー ビス	3,470	69,754.09	242,046,715	69,900.05	242,553,189	0.90

		B	ビス						
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	11,730	18,358.44	215,344,543	17,928.25	210,298,391	0.78
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	2,410	86,738.99	209,040,986	86,493.17	208,448,550	0.77
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	4,140	43,284.99	179,199,888	44,580.18	184,561,955	0.68
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	2,190	77,950.79	170,712,231	78,923.33	172,842,096	0.64
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	2,610	61,288.53	159,963,070	60,306.77	157,400,677	0.58
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	6,150	25,845.32	158,948,723	25,528.82	157,002,258	0.58
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	1,160	136,927.04	158,835,368	135,063.38	156,673,530	0.58
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6,280	24,717.60	155,226,548	24,676.12	154,966,036	0.57
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8,510	17,529.10	149,172,684	17,243.02	146,738,143	0.54
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	11,510	12,676.83	145,910,387	12,504.75	143,929,783	0.53
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,630	28,861.27	133,627,699	30,958.46	143,337,670	0.53
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	1,130	115,949.03	131,022,409	115,804.61	130,859,213	0.48
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	18,410	6,435.97	118,486,385	6,500.50	119,674,360	0.44
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	4,360	26,659.61	116,235,912	26,819.39	116,932,577	0.43
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	2,560	44,626.27	114,243,263	45,538.89	116,579,574	0.43
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	1,060	110,725.39	117,368,916	105,706.81	112,049,229	0.42
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	10,630	10,281.58	109,293,289	10,127.94	107,660,096	0.40
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6,650	15,975.48	106,236,990	16,106.08	107,105,440	0.40

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
----	-------	----	---------

株式	国外	エネルギー	4.05
		素材	3.53
		資本財	6.95
		商業・専門サービス	1.56
		運輸	1.53
		自動車・自動車部品	1.68
		耐久消費財・アパレル	1.22
		消費者サービス	1.93
		メディア・娯楽	6.54
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.77
		生活必需品流通・小売り	1.73
		食品・飲料・タバコ	2.95
		家庭用品・パーソナル用品	1.50
		ヘルスケア機器・サービス	3.90
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.36
		銀行	5.64
		金融サービス	6.90
		保険	3.01
		ソフトウェア・サービス	9.83
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.51
		電気通信サービス	1.14
公益事業	2.64		
半導体・半導体製造装置	9.29		
不動産管理・開発	0.28		
新株予約権証券	—	—	
投資証券	—	—	
合計		98.40	

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 EMINI2412	買建	9	米ドル	2,630,700	404,180,748	2,633,400	404,595,576	1.50
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJSTX5 2412	買建	9	ユーロ	400,590	66,790,370	394,110	65,709,960	0.24

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
-------	----	----	----	----------	---------	-----------------

為替予約取引	米ドル	売建	136,300,000.00	20,762,237,587	20,800,116,009	△77.06
	加ドル	売建	7,833,000.00	859,687,203	859,186,761	△3.18
	ユーロ	売建	14,272,000.00	2,350,867,596	2,366,535,204	△8.77
	英ポンド	売建	5,115,000.00	1,008,837,388	1,009,379,600	△3.74
	スイスフラン	売建	3,771,000.00	664,579,747	667,514,185	△2.47
	スウェーデンクローナ	売建	14,963,000.00	214,698,473	213,831,771	△0.79
	ノルウェークローネ	売建	3,004,000.00	41,541,739	41,717,438	△0.15
	デンマーククローネ	売建	10,304,000.00	227,667,129	229,195,583	△0.85
	豪ドル	売建	5,119,000.00	514,341,005	512,057,869	△1.90
	ニュージーランドドル	売建	93,000.00	8,453,631	8,448,191	△0.03
	香港ドル	売建	6,487,000.00	127,088,522	127,283,052	△0.47
	シンガポールドル	売建	719,000.00	82,889,791	83,018,837	△0.31
	イスラエルシェケル	売建	646,000.00	26,010,721	26,543,443	△0.10

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

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2024年10月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	48,766,430,910	87.84
地方債証券	日本	2,496,772,056	4.50
特殊債券	日本	1,991,295,000	3.59
社債券	日本	2,120,940,304	3.82
コール・ローン等、その他資産 (負債控除後)	—	141,220,977	0.25
合計 (純資産総額)		55,516,659,247	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	99.95	699,678,000	99.98	699,881,000	0.300	2025/12/20	1.26
日本	国債証券	第344回利付国債 (10年)	700,000,000	99.36	695,527,000	99.41	695,870,000	0.100	2026/9/20	1.25
日本	国債証券	第347回利付国債 (10年)	680,000,000	99.08	673,784,800	99.15	674,240,400	0.100	2027/6/20	1.21
日本	国債証券	第345回利付国債 (10年)	660,000,000	99.26	655,162,200	99.32	655,531,800	0.100	2026/12/20	1.18
日本	国債証券	第343回利付国債 (10年)	645,000,000	99.47	641,581,500	99.51	641,858,850	0.100	2026/6/20	1.16
日本	国債証券	第342回利付国債 (10年)	630,000,000	99.61	627,561,900	99.64	627,788,700	0.100	2026/3/20	1.13
日本	国債証券	第349回利付国債 (10年)	590,000,000	98.85	583,238,600	98.93	583,704,700	0.100	2027/12/20	1.05
日本	国債証券	第360回利付国債 (10年)	580,000,000	97.09	563,168,400	97.21	563,835,400	0.100	2030/9/20	1.02
日本	国債証券	第357回利付国債 (10年)	560,000,000	97.55	546,302,400	97.65	546,868,000	0.100	2029/12/20	0.99
日本	国債証券	第350回利付国債 (10年)	540,000,000	98.71	533,066,400	98.80	533,525,400	0.100	2028/3/20	0.96
日本	国債証券	第372回利付国債 (10年)	500,000,000	99.62	498,135,000	99.91	499,585,000	0.800	2033/9/20	0.90
日本	国債証券	第348回利付国債 (10年)	500,000,000	98.97	494,860,000	99.04	495,225,000	0.100	2027/9/20	0.89
日本	国債証券	第363回利付国債 (10年)	500,000,000	96.46	482,335,000	96.62	483,125,000	0.100	2031/6/20	0.87
日本	国債証券	第364回利付国債 (10年)	500,000,000	96.21	481,060,000	96.40	482,035,000	0.100	2031/9/20	0.87
日本	国債証券	第369回利付国債 (10年)	490,000,000	97.93	479,861,900	98.15	480,974,200	0.500	2032/12/20	0.87
日本	国債証券	第371回利付国債 (10年)	480,000,000	96.57	463,540,800	96.80	464,683,200	0.400	2033/6/20	0.84

日本	国債証券	第366回利付国債 (10年)	480,000,000	96.41	462,811,200	96.62	463,804,800	0.200	2032/3/20	0.84
日本	国債証券	第346回利付国債 (10年)	460,000,000	99.18	456,246,400	99.24	456,527,000	0.100	2027/3/20	0.82
日本	国債証券	第361回利付国債 (10年)	460,000,000	96.89	445,712,400	97.04	446,388,600	0.100	2030/12/20	0.80
日本	国債証券	第368回利付国債 (10年)	450,000,000	95.86	431,392,500	96.08	432,378,000	0.200	2032/9/20	0.78
日本	国債証券	第373回利付国債 (10年)	440,000,000	97.58	429,391,600	97.88	430,672,000	0.600	2033/12/20	0.78
日本	国債証券	第351回利付国債 (10年)	435,000,000	98.56	428,775,150	98.66	429,171,000	0.100	2028/6/20	0.77
日本	国債証券	第352回利付国債 (10年)	420,000,000	98.39	413,267,400	98.51	413,754,600	0.100	2028/9/20	0.75
日本	国債証券	第370回利付国債 (10年)	420,000,000	97.67	410,251,800	97.91	411,230,400	0.500	2033/3/20	0.74
日本	国債証券	第359回利付国債 (10年)	420,000,000	97.27	408,538,200	97.38	409,000,200	0.100	2030/6/20	0.74
日本	国債証券	第374回利付国債 (10年)	410,000,000	99.04	406,096,800	99.34	407,330,900	0.800	2034/3/20	0.73
日本	国債証券	第367回利付国債 (10年)	420,000,000	96.12	403,741,800	96.34	404,636,400	0.200	2032/6/20	0.73
日本	国債証券	第365回利付国債 (10年)	410,000,000	95.95	393,399,100	96.15	394,219,100	0.100	2031/12/20	0.71
日本	国債証券	第353回利付国債 (10年)	400,000,000	98.23	392,948,000	98.33	393,356,000	0.100	2028/12/20	0.71
日本	国債証券	第362回利付国債 (10年)	400,000,000	96.68	386,740,000	96.83	387,348,000	0.100	2031/3/20	0.70

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	87.84
地方債証券	4.50
特殊債券	3.59
社債券	3.82
合 計	99.75

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2024年10月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	77,863,437,658	46.29
	カナダ	3,179,425,065	1.89
	メキシコ	1,205,369,200	0.72
	ドイツ	9,931,663,714	5.90
	イタリア	11,503,154,614	6.84
	フランス	12,674,014,955	7.53
	オランダ	2,215,822,869	1.32
	スペイン	7,541,430,153	4.48
	ベルギー	2,639,745,737	1.57
	オーストリア	1,938,125,701	1.15
	フィンランド	826,529,085	0.49
	アイルランド	804,689,986	0.48
	イギリス	8,837,608,869	5.25
	スウェーデン	263,156,422	0.16
	ノルウェー	253,838,832	0.15
	デンマーク	441,687,472	0.26
	ポーランド	871,928,782	0.52
	オーストラリア	2,124,334,114	1.26
	ニュージーランド	443,866,601	0.26
	シンガポール	692,926,303	0.41
マレーシア	834,270,634	0.50	
中国	18,927,485,026	11.25	
イスラエル	508,999,789	0.30	
	小計	166,523,511,581	98.99
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	1,696,542,870	1.01
合計（純資産総額）		168,220,054,451	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	—	87,543,400	△0.05

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,450,000	15,583.64	1,316,817,896	15,552.14	1,314,156,467	4.625	2027/6/15	0.78
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,750,000	15,243.36	1,028,926,926	15,230.16	1,028,036,083	3.625	2026/5/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,940,000	13,774.17	955,928,049	13,728.56	952,762,318	1.750	2029/11/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	15,313.88	935,678,229	15,258.06	932,267,785	4.125	2032/11/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,950,000	15,392.19	915,835,480	15,349.58	913,300,520	4.125	2028/7/31	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,540,000	15,683.57	868,869,844	15,629.25	865,860,974	4.500	2033/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,020,000	13,166.22	792,606,799	13,120.01	789,824,661	1.625	2031/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	15,474.11	773,705,689	15,426.40	771,320,428	4.250	2029/2/28	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,870,000	13,159.31	772,451,620	13,113.40	769,756,842	1.875	2032/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	15,057.31	752,865,960	15,027.91	751,395,625	3.250	2027/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,910,000	12,741.90	753,046,464	12,695.10	750,280,658	0.875	2030/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,900,000	15,282.37	748,836,183	15,225.95	746,071,769	4.000	2030/7/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	15,532.03	747,090,934	15,482.82	744,723,891	4.375	2034/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,830,000	12,770.11	744,497,485	12,725.70	741,908,851	1.375	2031/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,980,000	14,824.44	738,257,463	14,774.63	735,776,921	3.250	2029/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	15,524.83	729,667,027	15,493.31	728,185,983	4.500	2027/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	14,787.85	715,731,940	14,780.64	715,383,183	1.625	2026/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	13,911.01	709,461,569	13,860.29	706,875,024	2.750	2032/8/15	0.42
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	2,192.31	701,539,999	2,192.67	701,654,849	3.020	2025/10/22	0.42
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	2,183.00	698,560,141	2,183.37	698,678,618	2.180	2026/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	14,294.51	687,566,025	14,248.29	685,343,088	2.375	2029/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,930,000	13,885.50	684,555,491	13,845.29	682,573,257	1.500	2028/11/30	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	14,076.95	675,693,971	14,026.54	673,274,325	2.875	2032/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,490,000	14,955.88	671,519,285	14,949.87	671,249,556	2.250	2026/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,590,000	14,493.46	665,249,832	14,448.45	663,184,279	2.625	2029/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,630,000	14,314.31	662,752,838	14,269.60	660,682,800	2.375	2029/3/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,090,000	12,623.07	642,514,658	12,578.66	640,253,816	0.625	2030/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	15,182.30	637,656,824	15,180.33	637,574,227	3.000	2025/9/30	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	15,460.62	618,424,968	15,452.51	618,100,480	4.875	2025/11/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,450,000	13,902.00	618,639,349	13,874.39	617,410,744	0.375	2027/7/31	0.37

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.99
合計	98.99

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	570,000.00	87,428,200	87,543,400	△0.05

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

以下の運用状況は2024年10月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	11,041,166,487	46.77
	カナダ	439,848,830	1.86
	メキシコ	164,258,550	0.70
	ドイツ	1,384,722,543	5.87
	イタリア	1,601,828,232	6.79
	フランス	1,780,860,575	7.54
	オランダ	307,533,796	1.30
	スペイン	1,049,907,372	4.45
	ベルギー	377,577,725	1.60
	オーストリア	258,095,335	1.09
	フィンランド	97,817,549	0.41
	アイルランド	127,186,796	0.54
	イギリス	1,249,875,176	5.29
	スウェーデン	58,493,411	0.25
	ノルウェー	44,032,681	0.19
	デンマーク	75,760,067	0.32
	ポーランド	113,554,312	0.48
	オーストラリア	281,829,550	1.19
	ニュージーランド	40,799,734	0.17
	シンガポール	98,522,961	0.42
マレーシア	289,860,701	1.23	
中国	2,669,049,002	11.31	
イスラエル	48,620,430	0.21	
	小計	23,601,201,815	99.98
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	—	4,555,640	0.02
合計（純資産総額）		23,605,757,455	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	—	24,626,691,843	△104.32

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	14,744.03	471,809,019	14,726.02	471,232,808	2.000	2026/11/15	2.00
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,100,000	14,787.85	310,544,850	14,780.64	310,393,530	1.625	2026/5/15	1.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,200,000	14,071.85	309,580,851	14,048.74	309,072,487	0.500	2027/4/30	1.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,100,000	13,481.29	283,107,205	13,432.68	282,086,359	1.500	2030/2/15	1.19
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	15,044.42	240,710,860	15,040.09	240,641,538	2.250	2025/11/15	1.02
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,740,000	13,843.19	240,871,584	13,811.99	240,328,629	0.625	2027/11/30	1.02
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	14,867.66	237,882,656	14,862.25	237,796,126	1.625	2026/2/15	1.01
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	14,294.51	228,712,190	14,248.29	227,972,752	2.375	2029/5/15	0.97
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	15,082.51	226,237,743	15,077.72	226,165,839	2.625	2025/12/31	0.96
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	14,730.23	220,953,525	14,728.42	220,926,331	0.375	2025/11/30	0.94
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	14,740.43	221,106,551	14,715.22	220,728,366	2.375	2027/5/15	0.94
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	14,723.02	220,845,439	14,679.21	220,188,167	2.875	2028/8/15	0.93
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	12,736.51	216,520,674	12,690.29	215,735,020	0.625	2030/5/15	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	15,532.03	186,384,435	15,482.82	185,793,903	4.375	2034/5/15	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	14,459.55	173,514,624	14,449.35	173,392,204	0.625	2026/7/31	0.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	15,344.79	168,792,745	15,288.07	168,168,782	4.125	2031/7/31	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	13,732.77	164,793,280	13,697.35	164,368,312	1.000	2028/7/31	0.70
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	14,753.63	162,289,978	14,732.03	162,052,358	2.250	2027/2/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	14,633.59	160,969,550	14,604.18	160,646,076	2.250	2027/8/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,150,000	13,897.50	159,821,321	13,861.20	159,403,812	1.250	2028/6/30	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	13,829.99	152,129,965	13,799.08	151,789,929	0.500	2027/10/31	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	16,467.67	148,209,057	16,404.66	147,641,987	5.375	2031/2/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	14,626.40	146,264,050	14,623.39	146,233,937	0.500	2026/2/28	0.62
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	950,000	15,490.18	147,156,748	15,377.10	146,082,523	1.500	2031/5/25	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	950,000	15,300.97	145,359,281	15,246.35	144,840,400	4.000	2030/2/28	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,270,000	11,306.62	143,594,186	11,332.44	143,921,992	2.875	2052/5/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	14,365.34	143,653,400	14,344.92	143,449,212	1.125	2027/2/28	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	14,030.45	140,304,509	13,987.83	139,878,312	1.875	2029/2/28	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	13,959.02	139,590,237	13,926.02	139,260,218	1.250	2028/4/30	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	14,982.29	134,840,671	14,930.67	134,376,064	3.875	2033/8/15	0.57

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.98
合計	99.98

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	74,954,000.00	11,433,908,926	11,450,592,233	△48.51
	加ドル	売建	4,250,000.00	467,350,558	467,028,657	△1.98

	メキシコペソ	売建	22,409,000.00	169,005,533	167,307,248	△0.71
	ユーロ	売建	43,993,000.00	7,259,039,890	7,307,075,202	△30.95
	英ポンド	売建	6,539,000.00	1,293,189,178	1,293,950,010	△5.48
	スウェーデンクローナ	売建	4,133,000.00	59,458,000	59,192,249	△0.25
	ノルウェークローネ	売建	3,271,000.00	45,346,175	45,532,966	△0.19
	デンマーククローネ	売建	3,613,000.00	79,803,399	80,344,766	△0.34
	ポーランドズロチ	売建	3,049,000.00	115,518,793	115,980,704	△0.49
	豪ドル	売建	2,847,000.00	285,845,818	284,503,619	△1.21
	ニュージーランドドル	売建	458,000.00	41,853,887	41,838,753	△0.18
	シンガポールドル	売建	894,000.00	103,088,168	103,256,760	△0.44
	マレーシアリングgit	売建	10,590,000.00	371,823,372	370,266,642	△1.57
	中国元	売建	129,554,000.00	2,784,521,484	2,788,338,031	△11.81
	イスラエルシェケル	売建	1,248,000.00	50,372,913	51,484,003	△0.22

(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

2024年10月31日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 15,665円

純資産総額…………… 34.12億円

※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、2014年10月末の基準価額を起点として指数化しています。
 ※分配金再投資基準価額は、当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2020年10月	2021年10月	2022年10月	2023年10月	2024年10月	設定来累計
10円	10円	10円	0円	0円	180円

主要な資産の状況

<資産構成比率>

組入資産	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	15.12%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	2.52%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	2.48%
日本債券インデックスマザーファンド	64.90%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	5.04%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	4.96%
現金その他	4.97%

※当ファンドの対純資産総額比です。

<組入上位銘柄>

組入資産	銘柄	業種・種類	比率
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.63%
	2 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.68%
	3 日立製作所	電気機器	2.60%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド	1 NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	5.14%
	2 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.03%
	3 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.58%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジあり)マザーファンド	1 NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	5.12%
	2 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.01%
	3 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.57%
日本債券インデックスマザーファンド	1 第341回利付国債(10年)	国債証券	1.26%
	2 第344回利付国債(10年)	国債証券	1.25%
	3 第347回利付国債(10年)	国債証券	1.21%
海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン4.625%)	国債証券	0.78%
	2 US TREASURY N/B(クーポン3.625%)	国債証券	0.61%
	3 US TREASURY N/B(クーポン1.750%)	国債証券	0.57%
海外債券インデックス(ヘッジあり)マザーファンド	1 US TREASURY N/B(クーポン2.000%)	国債証券	2.00%
	2 US TREASURY N/B(クーポン1.625%)	国債証券	1.31%
	3 US TREASURY N/B(クーポン0.500%)	国債証券	1.31%

※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。

※2024年は、2024年10月末までの騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

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

(2) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(3) 取扱時間

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

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

(4) 申込金額

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

(5) 申込単位

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

(6) 申込代金の支払い

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

(7) 受付の中止および取消

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

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

2【換金（解約）手続等】

<解約請求による換金>

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

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

(3) 解約制限

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

(4) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に0.15%の率を乗じて得た額）を控除した価額とします。

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

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(5) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。

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

※税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

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

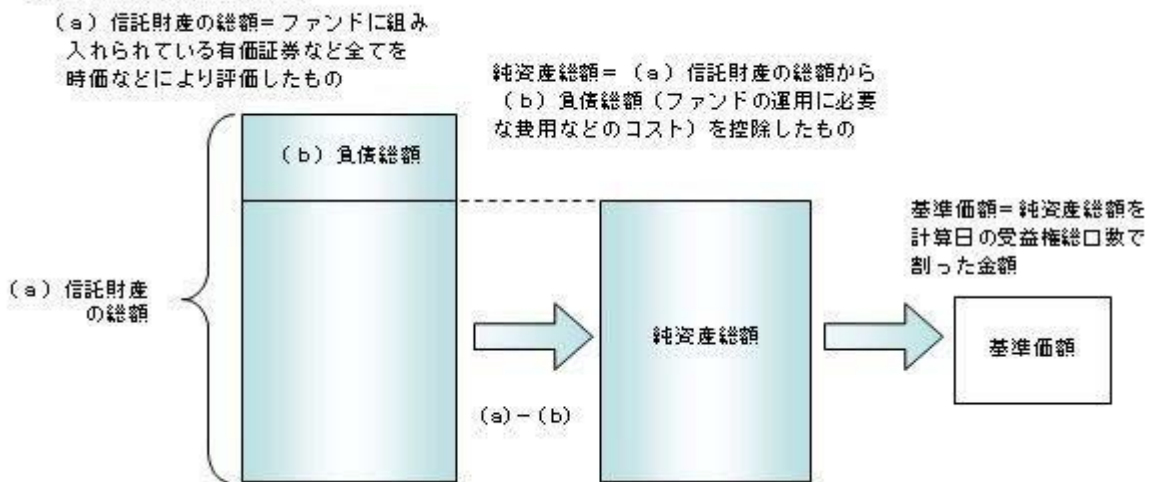
3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

① 基準価額の算出

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- ・基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口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。
- ・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

③ 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

<委託会社の照会先>

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年10月27日から翌年10月26日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) 【その他】

① 信託の終了(繰上償還)

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

② 償還金について

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

③ 信託約款の変更

- 1) 委託会社は、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。
- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べるすることができます。(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。

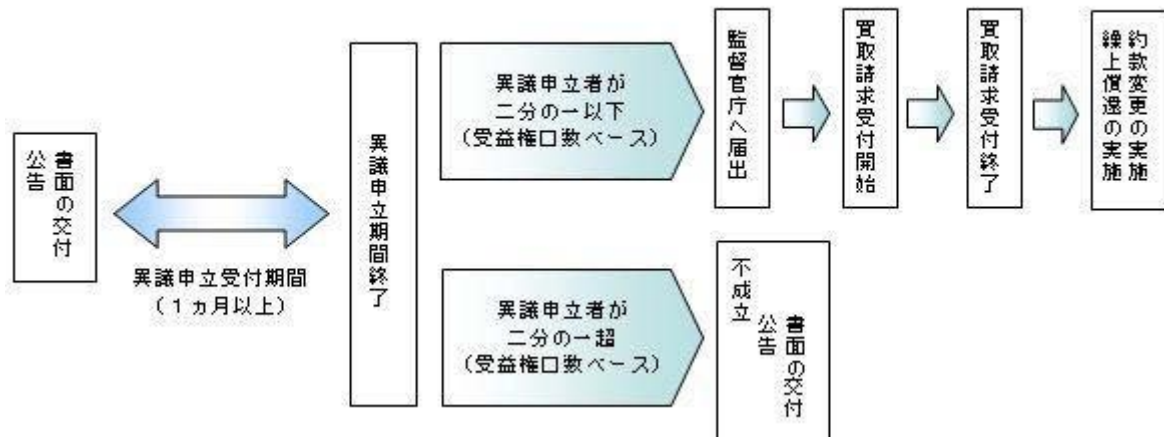
④ 異議の申立て

- 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、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。

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

＜繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ＞



⑤ 公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

⑥ 運用報告書の作成

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

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

⑦ 関係法人との契約について

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

4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第23期計算期間(2023年10月27日から2024年10月28日まで)の財務諸表について、PwC Japan 有限責任監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2025年1月15日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

PwC Japan 有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 榎原 康太
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）の2023年10月27日から2024年10月28日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）の2024年10月28日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

1 【財務諸表】

【年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第22期 2023年10月26日現在	第23期 2024年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	170,513,148	179,815,408
親投資信託受益証券	3,029,720,138	3,224,510,190
未収入金	-	4,782,602
未収利息	-	1,153
流動資産合計	3,200,233,286	3,409,109,353
資産合計	3,200,233,286	3,409,109,353
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,026	4,959,937
未払受託者報酬	628,306	660,383
未払委託者報酬	8,976,751	9,434,916
未払利息	60	-
その他未払費用	71,749	75,418
流動負債合計	9,685,892	15,130,654
負債合計	9,685,892	15,130,654
純資産の部		
元本等		
元本	2,146,125,673	2,173,637,437
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,044,421,721	1,220,341,262
（分配準備積立金）	364,043,672	362,405,162
元本等合計	3,190,547,394	3,393,978,699
純資産合計	3,190,547,394	3,393,978,699
負債純資産合計	3,200,233,286	3,409,109,353

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第22期		第23期	
	自	2022年10月27日 至 2023年10月26日	自	2023年10月27日 至 2024年10月28日
営業収益				
受取利息		-		153,120
有価証券売買等損益		43,441,686		179,819,739
営業収益合計		43,441,686		179,972,859
営業費用				
支払利息		60,959		3,865
受託者報酬		1,229,413		1,299,370
委託者報酬		17,564,912		18,564,109
その他費用		140,595		148,393
営業費用合計		18,995,879		20,015,737
営業利益又は営業損失(△)		24,445,807		159,957,122
経常利益又は経常損失(△)		24,445,807		159,957,122
当期純利益又は当期純損失(△)		24,445,807		159,957,122
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(△)		5,561,215		15,402,956
期首剰余金又は期首欠損金(△)		997,874,798		1,044,421,721
剰余金増加額又は欠損金減少額		121,285,971		152,499,437
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		121,285,971		152,499,437
剰余金減少額又は欠損金増加額		93,623,640		121,134,062
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		93,623,640		121,134,062
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金(△)		1,044,421,721		1,220,341,262

(3)【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	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。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年10月27日から翌年10月26日までとなっております。ただし、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、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものといたしますので、当計算期間は2023年10月27日から2024年10月28日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

		第22期 2023年10月26日現在	第23期 2024年10月28日現在
1.	期首元本額	2,100,863,562円	2,146,125,673円
	期中追加設定元本額	242,774,249円	275,222,314円
	期中一部解約元本額	197,512,138円	247,710,550円
2.	受益権の総数	2,146,125,673口	2,173,637,437口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第22期 自2022年10月27日 至2023年10月26日		第23期 自2023年10月27日 至2024年10月28日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A	計算期末における費用控除後の 配当等収益 20,931,071円	A	計算期末における費用控除後の 配当等収益 37,374,686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 873,304,048円	C	信託約款に定める収益調整金 928,812,616円
D	信託約款に定める分配準備積立 金 343,112,601円	D	信託約款に定める分配準備積立 金 325,030,476円
E	分配対象収益 (A+B+C+D) 1,237,347,720円	E	分配対象収益 (A+B+C+D) 1,291,217,778円
F	分配対象収益(1万口当たり) 5,765円	F	分配対象収益(1万口当たり) 5,940円
G	分配金額 0円	G	分配金額 0円
H	分配金額(1万口当たり) 0円	H	分配金額(1万口当たり) 0円

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	第22期 自2022年10月27日 至2023年10月26日	第23期 自2023年10月27日 至2024年10月28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	同左

	るリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	
--	---	--

II 金融商品の時価等に関する事項

	第22期 2023年10月26日現在	第23期 2024年10月28日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

第22期 (2023年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

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

第23期 (2024年10月28日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	143,125,719
合計	143,125,719

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第22期 2023年10月26日現在	第23期 2024年10月28日現在
1口当たり純資産額	1,4867円	1,5614円
(1万口当たり純資産額)	(14,867円)	(15,614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	12,378,193	86,112,613	
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI (ヘッジあり) マザーファンド	28,776,225	84,602,101	
	日本債券インデックスマザーファンド	1,677,841,144	2,207,535,593	
	海外債券インデックス (ヘッジなし) マザーファンド	56,348,839	172,072,449	
	海外債券インデックス (ヘッジあり) マザーファンド	129,062,711	168,994,713	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	181,462,903	505,192,721	
合計		2,085,870,015	3,224,510,190	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	199,216,513	167,237,454
株式	49,297,077,010	60,171,635,490
派生商品評価勘定	29,450	444,450
未収配当金	475,719,551	594,014,867
未収利息	-	1,072
前払金	22,607,100	20,423,200
流動資産合計	49,994,649,624	60,953,756,533
資産合計	49,994,649,624	60,953,756,533
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	31,323,050	10,609,150
未払解約金	5,851,369	677,316
未払利息	71	-
流動負債合計	37,174,490	11,286,466
負債合計	37,174,490	11,286,466
純資産の部		
元本等		
元本	21,954,159,010	21,889,889,956
剰余金		
剰余金又は欠損金(△)	28,003,316,124	39,052,580,111
元本等合計	49,957,475,134	60,942,470,067
純資産合計	49,957,475,134	60,942,470,067
負債純資産合計	49,994,649,624	60,953,756,533

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
1.	期首	2022年10月27日	2023年10月27日
	期首元本額	22,875,362,128円	21,954,159,010円
	期首からの追加設定元本額	1,794,794,202円	2,901,079,093円
	期首からの一部解約元本額	2,715,997,320円	2,965,348,147円
	元本の内訳 ※		
	DCインデックスバランス（株式20）	745,167,154円	722,868,655円
	DCインデックスバランス（株式40）	2,067,436,177円	2,043,518,570円
	DCインデックスバランス（株式60）	4,402,676,540円	4,579,248,616円
	DCインデックスバランス（株式80）	5,228,953,333円	5,884,659,978円
	インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,811,645,166円	1,943,042,190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	2,707,551,045円	2,251,785,274円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	493,098,615円	433,981,686円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	922,892円	2,449,262円
	Ni つみインデックススラップ世界10指数（均等型）	580,795円	1,383,466円
	Ni つみインデックススラップ世界10指数（安定成長型）	322,580円	587,392円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,753,076,468円	1,382,191,474円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	208,302,656円	181,462,903円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	604,003,733円	567,479,340円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	961,323,653円	926,963,772円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	969,098,203円	968,267,378円
計	21,954,159,010円	21,889,889,956円	
2.	受益権の総数	21,954,159,010口	21,889,889,956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	702,225,000円	717,847,000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 2022 年 10 月 27 日 至 2023 年 10 月 26 日	自 2023 年 10 月 27 日 至 2024 年 10 月 28 日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	2023 年 10 月 26 日現在	2024 年 10 月 28 日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2023 年 10 月 26 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	6,510,114,601
合計	6,510,114,601

(2024 年 10 月 28 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	9,089,075,960
合計	9,089,075,960

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2023年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	698,327,100	—	667,050,000	△31,277,100
合計		698,327,100	—	667,050,000	△31,277,100

(2024年10月28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	808,748,200	—	798,600,000	△10,148,200
合計		808,748,200	—	798,600,000	△10,148,200

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年10月26日現在		2024年10月28日現在	
1口当たり純資産額	2,275円	1口当たり純資産額	2,784円
(1万口当たり純資産額)	(22,755円)	(1万口当たり純資産額)	(27,840円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	900	4,170.00	3,753,000	
ニッセイ	22,600	905.30	20,459,780	
マルハニチロ	3,300	2,969.00	9,797,700	
雪国まいたけ	1,900	1,040.00	1,976,000	
カネコ種苗	800	1,390.00	1,112,000	
サカタのタネ	2,500	3,510.00	8,775,000	
ホクト	1,800	1,808.00	3,254,400	
ホクリヨウ	300	1,023.00	306,900	
住石ホールディングス	3,200	965.00	3,088,000	
日鉄鉱業	900	4,360.00	3,924,000	
I N P E X	68,300	1,961.50	133,970,450	
石油資源開発	12,900	1,111.00	14,331,900	
K&Oエナジーグループ	1,000	3,160.00	3,160,000	
ショーボンドホールディングス	3,000	5,327.00	15,981,000	
ミライト・ワン	6,800	2,125.00	14,450,000	
タマホーム	1,400	3,775.00	5,285,000	
日本アクア	400	793.00	317,200	
キャンディル	400	524.00	209,600	
ダイセキ環境ソリューション	300	1,253.00	375,900	
第一カッター興業	600	1,465.00	879,000	
安藤・間	13,000	1,106.00	14,378,000	
東急建設	7,000	687.00	4,809,000	
コムシスホールディングス	7,200	3,080.00	22,176,000	
ビーアールホールディングス	3,300	349.00	1,151,700	
高松コンストラクショングループ	1,700	2,908.00	4,943,600	
東建コーポレーション	600	10,620.00	6,372,000	
ヤマウラ	1,200	1,193.00	1,431,600	
オリエンタル白石	8,200	379.00	3,107,800	
大成建設	14,500	6,368.00	92,336,000	
大林組	56,400	1,875.00	105,750,000	
清水建設	44,700	977.00	43,671,900	
長谷工コーポレーション	14,500	1,840.50	26,687,250	
松井建設	1,400	850.00	1,190,000	

鹿島建設	35,000	2,604.50	91,157,500
不動テトラ	1,100	2,082.00	2,290,200
鉄建建設	1,100	2,387.00	2,625,700
西松建設	3,000	4,955.00	14,865,000
三井住友建設	11,700	389.00	4,551,300
大豊建設	500	3,405.00	1,702,500
奥村組	2,600	4,220.00	10,972,000
東鉄工業	2,000	3,235.00	6,470,000
イチケン	100	2,435.00	243,500
浅沼組	5,900	655.00	3,864,500
戸田建設	21,300	897.90	19,125,270
熊谷組	2,600	3,525.00	9,165,000
北野建設	100	3,950.00	395,000
植木組	200	1,481.00	296,200
矢作建設工業	2,100	1,499.00	3,147,900
ピーエス・コンストラクション	2,000	987.00	1,974,000
日本ハウスホールディングス	3,300	338.00	1,115,400
新日本建設	2,200	1,532.00	3,370,400
東亜道路工業	3,000	1,258.00	3,774,000
日本道路	1,900	1,542.00	2,929,800
東亜建設工業	4,800	978.00	4,694,400
日本国土開発	4,500	509.00	2,290,500
若築建設	500	3,520.00	1,760,000
東洋建設	4,000	1,298.00	5,192,000
五洋建設	22,300	625.70	13,953,110
世紀東急工業	2,000	1,465.00	2,930,000
福田組	600	5,810.00	3,486,000
住友林業	13,600	6,033.00	82,048,800
巴コーポレーション	600	833.00	499,800
大和ハウス工業	43,600	4,550.00	198,380,000
ライト工業	2,900	2,206.00	6,397,400
積水ハウス	47,800	3,728.00	178,198,400
日特建設	1,500	1,009.00	1,513,500
北陸電気工事	1,100	1,180.00	1,298,000
ユアテック	3,500	1,457.00	5,099,500
日本リーテック	1,300	1,022.00	1,328,600

四電工	2,100	1,245.00	2,614,500
中電工	2,500	3,160.00	7,900,000
関電工	9,900	2,054.00	20,334,600
きんでん	11,000	3,116.00	34,276,000
東京エネシス	1,500	1,121.00	1,681,500
トーエネック	2,500	893.00	2,232,500
住友電設	1,500	4,545.00	6,817,500
日本電設工業	3,000	1,828.00	5,484,000
エクシオグループ	15,500	1,538.50	23,846,750
新日本空調	1,000	3,340.00	3,340,000
九電工	3,400	6,030.00	20,502,000
三機工業	3,300	2,381.00	7,857,300
日揮ホールディングス	15,600	1,290.00	20,124,000
中外炉工業	500	2,602.00	1,301,000
ヤマト	400	905.00	362,000
太平電業	1,000	5,050.00	5,050,000
高砂熱学工業	4,200	4,720.00	19,824,000
三晃金属工業	100	3,900.00	390,000
朝日工業社	1,500	1,280.00	1,920,000
明星工業	3,100	1,270.00	3,937,000
大気社	1,800	4,725.00	8,505,000
ダイダン	2,100	2,885.00	6,058,500
日比谷総合設備	1,100	3,465.00	3,811,500
飛島ホールディングス	1,600	1,535.00	2,456,000
テスホールディングス	3,300	275.00	907,500
インフロニア・ホールディングス	18,200	1,138.00	20,711,600
東洋エンジニアリング	2,400	736.00	1,766,400
レイズネクスト	2,300	1,539.00	3,539,700
ニッポン	4,700	2,173.00	10,213,100
日清製粉グループ本社	14,700	1,763.50	25,923,450
日東富士製粉	300	6,780.00	2,034,000
昭和産業	1,500	2,852.00	4,278,000
中部飼料	2,200	1,392.00	3,062,400
フィード・ワン	2,300	821.00	1,888,300
東洋精糖	200	1,350.00	270,000
日本甜菜製糖	900	2,579.00	2,321,100

DM三井製糖ホールディングス	1,600	3,180.00	5,088,000
塩水港精糖	1,400	272.00	380,800
ウェルネオシュガー	800	2,190.00	1,752,000
森永製菓	6,600	2,808.00	18,532,800
中村屋	400	3,235.00	1,294,000
江崎グリコ	4,500	4,401.00	19,804,500
名糖産業	600	1,829.00	1,097,400
井村屋グループ	900	2,437.00	2,193,300
不二家	1,100	2,644.00	2,908,400
山崎製パン	10,600	2,635.00	27,931,000
モロゾフ	500	4,630.00	2,315,000
亀田製菓	900	4,250.00	3,825,000
寿スピリッツ	7,400	1,984.00	14,681,600
カルビー	7,200	3,379.00	24,328,800
森永乳業	5,600	3,477.00	19,471,200
六甲バター	1,200	1,450.00	1,740,000
ヤクルト本社	22,600	3,314.00	74,896,400
明治ホールディングス	19,400	3,512.00	68,132,800
雪印メグミルク	3,800	2,600.00	9,880,000
プリマハム	2,100	2,233.00	4,689,300
日本ハム	6,800	5,160.00	35,088,000
林兼産業	500	459.00	229,500
丸大食品	1,600	1,645.00	2,632,000
S F o o d s	1,800	2,813.00	5,063,400
柿安本店	600	2,627.00	1,576,200
伊藤ハム米久ホールディングス	2,400	3,820.00	9,168,000
サッポロホールディングス	5,200	7,328.00	38,105,600
アサヒグループホールディングス	118,900	1,839.50	218,716,550
キリンホールディングス	66,000	2,307.50	152,295,000
シマダヤ	500	1,420.00	710,000
宝ホールディングス	10,600	1,197.00	12,688,200
オエノンホールディングス	5,100	412.00	2,101,200
養命酒製造	500	2,517.00	1,258,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,200	1,917.00	21,470,400
ライフドリンク カンパニー	1,200	1,764.00	2,116,800

サントリー食品インターナショナル	11,200	5,173.00	57,937,600	
ダイドーグループホールディングス	1,800	3,040.00	5,472,000	
伊藤園	5,300	3,306.00	17,521,800	
キーコーヒー	1,800	1,986.00	3,574,800	
ユニカフェ	300	936.00	280,800	
日清オイリオグループ	2,200	5,160.00	11,352,000	
不二製油グループ本社	3,700	3,192.00	11,810,400	
J-オイルミルズ	1,800	2,048.00	3,686,400	
キッコーマン	52,500	1,795.00	94,237,500	
味の素	37,200	5,790.00	215,388,000	
ブルドックソース	800	1,777.00	1,421,600	
キューピー	8,500	3,470.00	29,495,000	
ハウス食品グループ本社	5,300	2,952.00	15,645,600	
カゴメ	6,800	3,128.00	21,270,400	
アリアケジャパン	1,600	5,160.00	8,256,000	
エバラ食品工業	400	2,920.00	1,168,000	
やまみ	100	3,910.00	391,000	
ニチレイ	7,300	4,108.00	29,988,400	
東洋水産	8,000	8,827.00	70,616,000	
イトアンドホールディングス	800	2,182.00	1,745,600	
大冷	200	1,901.00	380,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	700	1,380.00	966,000	
日清食品ホールディングス	16,700	4,100.00	68,470,000	
フジッコ	1,600	1,687.00	2,699,200	
ロック・フィールド	1,900	1,465.00	2,783,500	
日本たばこ産業	96,300	4,133.00	398,007,900	
ケンコーマヨネーズ	1,100	2,135.00	2,348,500	
わらべや日洋ホールディングス	1,100	2,016.00	2,217,600	
なとり	1,000	2,109.00	2,109,000	
イフジ産業	200	1,380.00	276,000	
ファーマフーズ	2,100	878.00	1,843,800	
ユーグレナ	9,800	407.00	3,988,600	
紀文食品	1,400	1,104.00	1,545,600	
ピククルスホールディングス	900	1,091.00	981,900	
理研ビタミン	1,400	2,642.00	3,698,800	
片倉工業	1,500	1,997.00	2,995,500	

グンゼ	1,200	5,340.00	6,408,000
東洋紡	7,000	965.00	6,755,000
ユニチカ	5,200	289.00	1,502,800
富士紡ホールディングス	700	4,585.00	3,209,500
倉敷紡績	1,100	4,635.00	5,098,500
シキボウ	1,200	1,012.00	1,214,400
日本毛織	4,200	1,255.00	5,271,000
ダイドーリミテッド	600	886.00	531,600
帝国繊維	1,800	2,667.00	4,800,600
帝人	15,400	1,365.00	21,021,000
東レ	107,900	831.90	89,762,010
住江織物	100	2,030.00	203,000
セーレン	3,100	2,547.00	7,895,700
小松マテーレ	2,400	758.00	1,819,200
ワコールホールディングス	3,000	4,620.00	13,860,000
ホギメディカル	1,900	4,510.00	8,569,000
クラウドシアホールディングス	400	341.00	136,400
T S I ホールディングス	4,900	894.00	4,380,600
マツオカコーポレーション	200	1,735.00	347,000
ワールド	2,300	1,952.00	4,489,600
三陽商会	800	2,656.00	2,124,800
オンワードホールディングス	9,500	520.00	4,940,000
ルックホールディングス	500	2,539.00	1,269,500
ゴールドウイン	2,900	7,932.00	23,002,800
デサント	2,800	4,340.00	12,152,000
特種東海製紙	900	3,740.00	3,366,000
王子ホールディングス	67,300	564.70	38,004,310
日本製紙	9,000	901.00	8,109,000
三菱製紙	700	489.00	342,300
北越コーポレーション	7,800	1,518.00	11,840,400
中越パルプ工業	200	1,233.00	246,600
大王製紙	7,000	865.00	6,055,000
レンゴー	14,600	935.80	13,662,680
トーモク	900	2,338.00	2,104,200
ザ・パックス	1,200	3,695.00	4,434,000
北の達人コーポレーション	6,800	155.00	1,054,000

クラレ	23,400	2,048.00	47,923,200	
旭化成	108,900	1,043.00	113,582,700	
レゾナック・ホールディングス	14,400	3,634.00	52,329,600	
住友化学	119,400	401.40	47,927,160	
住友精化	800	5,000.00	4,000,000	
日産化学	7,500	5,223.00	39,172,500	
ラサ工業	600	2,720.00	1,632,000	
クレハ	3,400	2,802.00	9,526,800	
多木化学	600	3,635.00	2,181,000	
テイカ	1,300	1,613.00	2,096,900	
石原産業	2,700	1,447.00	3,906,900	
日本曹達	3,800	2,504.00	9,515,200	
東ソー	21,500	1,887.50	40,581,250	
トクヤマ	5,200	2,730.50	14,198,600	
セントラル硝子	1,700	3,445.00	5,856,500	
東亜合成	7,700	1,567.50	12,069,750	
大阪ソーダ	5,500	1,646.00	9,053,000	
関東電化工業	3,100	960.00	2,976,000	
デンカ	5,900	2,137.50	12,611,250	
信越化学工業	144,500	5,593.00	808,188,500	代用有価証券 24,000株
日本カーバイド工業	900	1,641.00	1,476,900	
堺化学工業	1,200	2,608.00	3,129,600	
第一稀元素化学工業	1,800	783.00	1,409,400	
エア・ウォーター	15,200	1,917.00	29,138,400	
日本酸素ホールディングス	15,700	5,188.00	81,451,600	
日本化学工業	600	2,651.00	1,590,600	
東邦アセチレン	900	334.00	300,600	
日本パーカライジング	7,100	1,266.00	8,988,600	
高压ガス工業	2,400	894.00	2,145,600	
四国化成ホールディングス	1,800	1,894.00	3,409,200	
戸田工業	500	1,683.00	841,500	
ステラ ケミファ	900	4,430.00	3,987,000	
保土谷化学工業	500	4,240.00	2,120,000	
日本触媒	9,300	1,700.00	15,810,000	
大日精化工業	1,100	2,921.00	3,213,100	

カネカ	4,000	3,719.00	14,876,000
三菱瓦斯化学	11,700	2,646.00	30,958,200
三井化学	13,300	3,496.00	46,496,800
東京応化工業	7,700	3,477.00	26,772,900
大阪有機化学工業	1,400	2,896.00	4,054,400
三菱ケミカルグループ	117,700	822.30	96,784,710
KHネオケム	2,900	2,037.00	5,907,300
ダイセル	19,900	1,324.00	26,347,600
住友ベークライト	4,500	4,011.00	18,049,500
積水化学工業	32,000	2,146.50	68,688,000
日本ゼオン	11,100	1,338.00	14,851,800
アイカ工業	4,100	3,272.00	13,415,200
UBE	7,700	2,500.00	19,250,000
積水樹脂	2,400	2,246.00	5,390,400
旭有機材	1,100	4,065.00	4,471,500
ニチバン	900	1,910.00	1,719,000
リケンテクノス	3,000	1,046.00	3,138,000
大倉工業	800	2,673.00	2,138,400
積水化成成品工業	2,300	390.00	897,000
群栄化学工業	400	2,702.00	1,080,800
タイガースポリマー	400	713.00	285,200
ダイキョーニシカワ	3,600	629.00	2,264,400
森六ホールディングス	800	2,295.00	1,836,000
恵和	1,000	1,016.00	1,016,000
日本化薬	12,200	1,190.00	14,518,000
カーリット	1,800	1,240.00	2,232,000
日本精化	1,100	2,312.00	2,543,200
扶桑化学工業	1,700	3,700.00	6,290,000
トリケミカル研究所	2,000	3,060.00	6,120,000
ADEKA	5,600	2,724.50	15,257,200
日油	14,500	2,476.00	35,902,000
ハリマ化成グループ	1,200	846.00	1,015,200
花王	39,200	6,732.00	263,894,400
第一工業製薬	700	3,060.00	2,142,000
石原ケミカル	700	2,307.00	1,614,900
三洋化成工業	1,000	4,090.00	4,090,000

大日本塗料	1,800	1,022.00	1,839,600
日本ペイントホールディングス	71,200	1,018.50	72,517,200
関西ペイント	14,000	2,444.00	34,216,000
中国塗料	3,300	2,173.00	7,170,900
日本特殊塗料	400	1,131.00	452,400
藤倉化成	2,200	464.00	1,020,800
太陽ホールディングス	2,800	3,920.00	10,976,000
D I C	5,700	3,252.00	18,536,400
サカタインクス	3,600	1,530.00	5,508,000
a r t i e n c e	2,900	3,675.00	10,657,500
富士フイルムホールディングス	89,800	3,648.00	327,590,400
資生堂	33,700	3,339.00	112,524,300
ライオン	20,500	1,644.00	33,702,000
高砂香料工業	1,200	5,020.00	6,024,000
マンダム	3,500	1,244.00	4,354,000
ミルボン	2,600	3,181.00	8,270,600
ファンケル	4,000	2,791.00	11,164,000
コーセー	3,300	8,319.00	27,452,700
コタ	1,600	1,639.00	2,622,400
ポーラ・オルビスホールディングス	8,200	1,490.00	12,218,000
ノエビアホールディングス	1,400	5,070.00	7,098,000
新日本製薬	900	1,722.00	1,549,800
I - n e	600	2,004.00	1,202,400
アクシージア	1,300	558.00	725,400
エステー	1,300	1,460.00	1,898,000
アグロ カネショウ	700	1,326.00	928,200
コニシ	4,700	1,300.00	6,110,000
長谷川香料	3,100	3,255.00	10,090,500
小林製薬	4,200	5,648.00	23,721,600
荒川化学工業	1,400	1,281.00	1,793,400
メック	1,300	3,640.00	4,732,000
日本高純度化学	400	3,100.00	1,240,000
タカラバイオ	4,400	988.00	4,347,200
J C U	1,800	3,330.00	5,994,000
O A Tアグリオ	700	1,854.00	1,297,800
デクセリアルズ	12,000	2,358.50	28,302,000

アース製薬	1,500	5,190.00	7,785,000
北興化学工業	1,500	1,253.00	1,879,500
大成ラミック	500	2,599.00	1,299,500
クミアイ化学工業	6,500	796.00	5,174,000
日本農薬	3,000	621.00	1,863,000
アキレス	1,000	1,491.00	1,491,000
有沢製作所	2,800	1,387.00	3,883,600
日東電工	51,000	2,434.50	124,159,500
レック	2,100	1,284.00	2,696,400
三光合成	2,100	605.00	1,270,500
ZACROS	1,300	4,250.00	5,525,000
前澤化成工業	1,100	1,777.00	1,954,700
未来工業	600	3,485.00	2,091,000
JSP	1,100	1,911.00	2,102,100
エフピコ	3,100	2,653.50	8,225,850
天馬	1,100	2,901.00	3,191,100
信越ポリマー	3,500	1,516.00	5,306,000
東リ	1,200	389.00	466,800
ニフコ	4,800	3,455.00	16,584,000
バルカー	1,400	3,255.00	4,557,000
ユニ・チャーム	33,600	4,898.00	164,572,800
協和キリン	19,500	2,564.50	50,007,750
武田薬品工業	142,800	4,133.00	590,192,400
アステラス製薬	141,500	1,735.50	245,573,250
住友ファーマ	11,800	612.00	7,221,600
塩野義製薬	58,900	2,114.00	124,514,600
日本新薬	4,200	4,063.00	17,064,600
中外製薬	50,500	7,855.00	396,677,500
科研製薬	2,800	3,904.00	10,931,200
エーザイ	19,600	5,184.00	101,606,400
ロート製薬	15,600	3,337.00	52,057,200
小野薬品工業	33,000	1,949.00	64,317,000
久光製薬	3,600	4,338.00	15,616,800
持田製薬	1,800	3,410.00	6,138,000
参天製薬	28,500	1,794.00	51,129,000
扶桑薬品工業	600	2,415.00	1,449,000

ツムラ	5,100	4,950.00	25,245,000
キッセイ薬品工業	2,700	3,705.00	10,003,500
生化学工業	2,700	848.00	2,289,600
栄研化学	2,800	2,455.00	6,874,000
鳥居薬品	900	3,875.00	3,487,500
JCRファーマ	5,400	656.00	3,542,400
東和薬品	2,500	3,075.00	7,687,500
富士製薬工業	1,200	1,312.00	1,574,400
ゼリア新薬工業	2,200	2,308.00	5,077,600
ネクセラファーマ	7,500	1,186.00	8,895,000
第一三共	140,600	4,888.00	687,252,800
杏林製薬	3,500	1,489.00	5,211,500
大幸薬品	3,700	384.00	1,420,800
ダイト	1,200	2,212.00	2,654,400
大塚ホールディングス	40,300	9,150.00	368,745,000
ペプチドリーム	7,800	2,781.00	21,691,800
セルソース	1,100	1,174.00	1,291,400
あすか製薬ホールディングス	1,600	2,125.00	3,400,000
サワイグループホールディングス	11,100	2,022.00	22,444,200
日本コークス工業	16,200	96.00	1,555,200
ニチレキグループ	2,100	2,369.00	4,974,900
ユシロ化学工業	800	1,543.00	1,234,400
ビーピー・カストロール	300	862.00	258,600
富士石油	4,700	331.00	1,555,700
MORESCO	200	1,201.00	240,200
出光興産	83,700	1,012.00	84,704,400
ENEOSホールディングス	255,300	759.40	193,874,820
コスモエネルギーホールディングス	4,800	7,443.00	35,726,400
横浜ゴム	8,200	3,113.00	25,526,600
TOYO TIRE	9,300	2,167.50	20,157,750
ブリヂストン	47,300	5,504.00	260,339,200
住友ゴム工業	15,900	1,574.00	25,026,600
藤倉コンポジット	1,500	1,186.00	1,779,000
オカモト	700	5,260.00	3,682,000
フコク	900	1,739.00	1,565,100
ニッタ	1,600	3,665.00	5,864,000

住友理工	2,500	1,470.00	3,675,000
三ツ星ベルト	1,900	3,860.00	7,334,000
バンドー化学	2,400	1,777.00	4,264,800
日東紡績	2,000	6,900.00	13,800,000
A G C	15,700	4,579.00	71,890,300
日本板硝子	7,600	364.00	2,766,400
石塚硝子	100	2,390.00	239,000
日本山村硝子	200	1,514.00	302,800
日本電気硝子	6,000	3,344.00	20,064,000
オハラ	700	1,322.00	925,400
住友大阪セメント	2,700	3,735.00	10,084,500
太平洋セメント	9,200	3,402.00	31,298,400
日本ヒューム	1,500	1,232.00	1,848,000
日本コンクリート工業	3,100	329.00	1,019,900
三谷セキサン	700	6,140.00	4,298,000
アジアパイルホールディングス	2,400	794.00	1,905,600
東海カーボン	14,800	857.50	12,691,000
日本カーボン	900	4,390.00	3,951,000
東洋炭素	1,100	5,220.00	5,742,000
ノリタケ	1,800	3,860.00	6,948,000
T O T O	10,600	4,924.00	52,194,400
日本碍子	18,800	1,860.00	34,968,000
日本特殊陶業	13,300	4,327.00	57,549,100
M A R U W A	600	39,300.00	23,580,000
品川リフラクトリーズ	2,000	1,746.00	3,492,000
黒崎播磨	1,300	2,241.00	2,913,300
ヨータイ	900	1,661.00	1,494,900
フジミインコーポレーテッド	4,400	2,303.00	10,133,200
エーアンドエーマテリアル	200	1,141.00	228,200
ニチアス	4,100	5,450.00	22,345,000
ニチハ	2,000	3,400.00	6,800,000
日本製鉄	78,700	3,028.00	238,303,600
神戸製鋼所	33,400	1,639.50	54,759,300
中山製鋼所	3,800	746.00	2,834,800
合同製鐵	900	3,935.00	3,541,500
J F E ホールディングス	46,200	1,846.00	85,285,200

東京製鐵	4,700	1,608.00	7,557,600
共英製鋼	1,900	1,706.00	3,241,400
大和工業	3,100	6,901.00	21,393,100
東京鐵鋼	700	4,760.00	3,332,000
大阪製鐵	800	3,280.00	2,624,000
淀川製鋼所	1,700	5,400.00	9,180,000
中部鋼鈹	1,100	2,430.00	2,673,000
丸一鋼管	5,100	3,254.00	16,595,400
モリ工業	400	5,060.00	2,024,000
大同特殊鋼	10,400	1,326.50	13,795,600
日本高周波鋼業	600	391.00	234,600
日本冶金工業	1,200	4,310.00	5,172,000
山陽特殊製鋼	1,600	1,812.00	2,899,200
愛知製鋼	1,000	4,160.00	4,160,000
大平洋金属	1,400	1,378.00	1,929,200
新日本電工	9,900	290.00	2,871,000
栗本鐵工所	800	3,810.00	3,048,000
三菱製鋼	1,300	1,315.00	1,709,500
日本精線	1,400	1,260.00	1,764,000
エンビプロ・ホールディングス	2,000	516.00	1,032,000
新家工業	100	4,595.00	459,500
大紀アルミニウム工業所	2,100	1,092.00	2,293,200
日本輕金属ホールディングス	4,900	1,586.00	7,771,400
三井金属鈹業	4,800	4,857.00	23,313,600
三菱マテリアル	11,900	2,480.00	29,512,000
住友金属鈹山	19,200	4,257.00	81,734,400
DOWAホールディングス	4,100	5,198.00	21,311,800
古河機械金属	2,200	1,650.00	3,630,000
エス・サイエンス	11,200	22.00	246,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,900	2,245.00	6,510,500
東邦チタニウム	3,500	1,059.00	3,706,500
UACJ	2,300	5,030.00	11,569,000
CKサンエツ	400	3,580.00	1,432,000
古河電氣工業	5,500	3,501.00	19,255,500
住友電氣工業	62,100	2,311.00	143,513,100
フジクラ	19,600	5,094.00	99,842,400

SWCC	1,900	5,130.00	9,747,000
カナレ電気	200	1,411.00	282,200
平河ヒューテック	1,100	1,593.00	1,752,300
リョービ	1,800	1,879.00	3,382,200
アーレスティ	600	556.00	333,600
AREホールディングス	6,300	1,783.00	11,232,900
稲葉製作所	900	1,785.00	1,606,500
宮地エンジニアリンググループ	1,600	1,990.00	3,184,000
トーカロ	4,800	1,764.00	8,467,200
SUMCO	31,600	1,500.00	47,400,000
川田テクノロジーズ	1,200	2,387.00	2,864,400
RS Technologies	1,300	3,960.00	5,148,000
信和	400	733.00	293,200
東洋製罐グループホールディングス	9,500	2,266.00	21,527,000
ホッカンホールディングス	800	1,752.00	1,401,600
コロナ	1,100	942.00	1,036,200
横河ブリッジホールディングス	2,600	2,636.00	6,853,600
三和ホールディングス	16,500	3,658.00	60,357,000
文化シャッター	4,400	1,792.00	7,884,800
三協立山	2,100	763.00	1,602,300
アルインコ	1,300	963.00	1,251,900
東洋シャッター	400	782.00	312,800
LIXIL	25,900	1,610.50	41,711,950
ノーリツ	2,300	1,757.00	4,041,100
長府製作所	1,900	1,935.00	3,676,500
リンナイ	7,900	3,386.00	26,749,400
日東精工	2,500	573.00	1,432,500
三洋工業	100	3,125.00	312,500
岡部	3,000	776.00	2,328,000
ジーテクト	2,100	1,562.00	3,280,200
東プレ	2,900	1,747.00	5,066,300
高周波熱錬	2,500	984.00	2,460,000
東京製綱	1,100	1,116.00	1,227,600
サンコール	2,200	403.00	886,600
パイオラックス	2,000	2,391.00	4,782,000
エイチワン	1,700	937.00	1,592,900

日本発條	14,700	1,861.00	27,356,700
中央発條	1,300	1,258.00	1,635,400
立川ブラインド工業	800	1,294.00	1,035,200
日本ドライケミカル	100	3,245.00	324,500
日本製鋼所	4,500	5,141.00	23,134,500
三浦工業	6,800	3,598.00	24,466,400
タクマ	5,500	1,565.00	8,607,500
ツガミ	3,400	1,423.00	4,838,200
オークマ	2,800	3,129.00	8,761,200
芝浦機械	1,500	3,695.00	5,542,500
アマダ	24,600	1,501.00	36,924,600
アイダエンジニアリング	3,600	781.00	2,811,600
F U J I	7,600	2,257.00	17,153,200
牧野フライス製作所	1,800	5,800.00	10,440,000
オーエスジー	7,100	1,818.00	12,907,800
旭ダイヤモンド工業	3,700	845.00	3,126,500
DMG森精機	10,300	2,888.00	29,746,400
ソディック	4,300	755.00	3,246,500
ディスコ	7,800	39,670.00	309,426,000
日東工器	700	2,515.00	1,760,500
日進工具	1,500	738.00	1,107,000
富士ダイス	1,200	789.00	946,800
リケンNPR	1,800	2,330.00	4,194,000
島精機製作所	2,600	1,121.00	2,914,600
オプトラン	2,700	1,909.00	5,154,300
イワキポンプ	1,100	2,862.00	3,148,200
フリーー	1,500	1,083.00	1,624,500
ヤマシンフィルタ	3,900	463.00	1,805,700
日阪製作所	1,800	989.00	1,780,200
やまびこ	2,700	2,457.00	6,633,900
野村マイクロ・サイエンス	2,200	2,130.00	4,686,000
平田機工	800	4,910.00	3,928,000
P E G A S U S	1,900	452.00	858,800
マルマエ	700	1,505.00	1,053,500
タツモ	1,200	3,635.00	4,362,000
ナブテスコ	10,100	2,456.00	24,805,600

三井海洋開発	2,000	3,255.00	6,510,000
レオン自動機	1,900	1,396.00	2,652,400
SMC	4,900	63,830.00	312,767,000
ホソカワミクロン	1,100	3,925.00	4,317,500
ユニオンツール	700	6,820.00	4,774,000
瑞光	1,200	1,353.00	1,623,600
オイレス工業	2,200	1,955.00	4,301,000
日精エー・エス・ビー機械	600	4,515.00	2,709,000
サトーホールディングス	2,200	2,116.00	4,655,200
技研製作所	1,500	1,742.00	2,613,000
日本エアータック	900	1,188.00	1,069,200
日精樹脂工業	1,300	939.00	1,220,700
オカダアイヨン	200	2,034.00	406,800
ワイエイシイホールディングス	700	2,170.00	1,519,000
小松製作所	76,100	4,005.00	304,780,500
住友重機械工業	9,600	3,436.00	32,985,600
日立建機	6,500	3,359.00	21,833,500
日工	2,400	693.00	1,663,200
巴工業	600	3,820.00	2,292,000
井関農機	1,500	992.00	1,488,000
TOWA	5,400	1,943.00	10,492,200
北川鉄工所	700	1,248.00	873,600
ローツェ	8,400	2,158.00	18,127,200
タカキタ	300	402.00	120,600
クボタ	84,800	1,970.50	167,098,400
荏原実業	800	4,070.00	3,256,000
三菱化工機	600	3,500.00	2,100,000
月島ホールディングス	2,200	1,355.00	2,981,000
帝国電機製作所	1,100	2,773.00	3,050,300
新東工業	3,300	993.00	3,276,900
澁谷工業	1,500	3,625.00	5,437,500
アイチ コーポレーション	2,200	1,183.00	2,602,600
小森コーポレーション	4,000	1,098.00	4,392,000
鶴見製作所	1,200	4,195.00	5,034,000
酒井重工業	600	2,326.00	1,395,600
荏原製作所	33,400	2,268.00	75,751,200

石井鐵工所	100	8,330.00	833,000
西島製作所	1,400	2,762.00	3,866,800
北越工業	1,600	1,837.00	2,939,200
ダイキン工業	19,400	18,330.00	355,602,000
オルガノ	2,000	6,940.00	13,880,000
トーヨーカネツ	600	4,375.00	2,625,000
栗田工業	9,100	5,646.00	51,378,600
椿本チエイン	6,600	1,907.00	12,586,200
木村化工機	1,400	732.00	1,024,800
アネスト岩田	2,500	1,389.00	3,472,500
ダイフク	27,400	2,870.50	78,651,700
サムコ	400	3,215.00	1,286,000
加藤製作所	300	1,223.00	366,900
タダノ	9,300	971.20	9,032,160
フジテック	3,800	4,858.00	18,460,400
CKD	4,500	2,604.00	11,718,000
平和	4,800	2,090.00	10,032,000
理想科学工業	1,300	3,520.00	4,576,000
SANKYO	15,600	2,043.00	31,870,800
日本金銭機械	2,000	903.00	1,806,000
マースグループホールディングス	800	3,160.00	2,528,000
フクシマガリレイ	1,100	5,500.00	6,050,000
オーイズミ	400	343.00	137,200
ダイコク電機	800	3,450.00	2,760,000
竹内製作所	3,000	4,790.00	14,370,000
アマノ	4,600	4,368.00	20,092,800
JUKI	2,600	402.00	1,045,200
ジャノメ	1,600	907.00	1,451,200
マックス	2,300	3,495.00	8,038,500
グローリー	3,900	2,490.00	9,711,000
新晃工業	1,600	4,360.00	6,976,000
大和冷機工業	2,500	1,427.00	3,567,500
セガサミーホールディングス	14,500	2,897.50	42,013,750
T P R	2,100	2,279.00	4,785,900
ツバキ・ナカシマ	4,000	690.00	2,760,000
ホンザキ	10,500	5,067.00	53,203,500

大豊工業	1,600	630.00	1,008,000
日本精工	30,000	698.60	20,958,000
NTN	35,100	253.50	8,897,850
ジェイテクト	14,400	1,038.00	14,947,200
不二越	1,200	3,170.00	3,804,000
日本トムソン	4,400	478.00	2,103,200
THK	9,300	2,533.50	23,561,550
ユーシン精機	1,500	660.00	990,000
前澤給装工業	1,200	1,265.00	1,518,000
イーグル工業	1,800	2,030.00	3,654,000
前澤工業	300	1,182.00	354,600
P I L L A R	1,500	4,260.00	6,390,000
キッツ	5,400	1,048.00	5,659,200
マキタ	18,500	4,603.00	85,155,500
三井E&S	8,000	1,111.00	8,888,000
カナデビア	14,300	1,056.00	15,100,800
三菱重工業	284,100	2,082.00	591,496,200
I H I	12,100	7,680.00	92,928,000
スター精密	2,700	1,935.00	5,224,500
日清紡ホールディングス	12,200	966.00	11,785,200
イビデン	8,500	4,904.00	41,684,000
コニカミノルタ	36,300	637.80	23,152,140
ブラザー工業	21,700	2,984.00	64,752,800
ミネベアミツミ	28,300	2,735.00	77,400,500
日立製作所	390,500	4,024.00	1,571,372,000
三菱電機	178,000	2,340.50	416,609,000
富士電機	9,900	7,823.00	77,447,700
安川電機	17,600	4,367.00	76,859,200
シンフォニアテクノロジー	1,800	4,975.00	8,955,000
明電舎	3,000	4,020.00	12,060,000
山洋電気	700	9,030.00	6,321,000
デンヨー	1,200	2,489.00	2,986,800
PHCホールディングス	3,100	1,004.00	3,112,400
KOKUSAI ELECTRIC	8,500	2,869.00	24,386,500
ソシオネクスト	11,900	2,854.00	33,962,600
東芝テック	2,100	3,360.00	7,056,000

芝浦メカトロニクス	900	10,650.00	9,585,000
マブチモーター	7,200	2,185.00	15,732,000
ニデック	71,700	3,203.00	229,655,100
トレックス・セミコンダクター	800	1,502.00	1,201,600
東光高岳	1,000	1,788.00	1,788,000
ダブル・スコープ	4,700	348.00	1,635,600
ダイヘン	1,600	6,210.00	9,936,000
ヤーマン	3,200	828.00	2,649,600
JVCケンウッド	12,800	1,184.00	15,155,200
ミマキエンジニアリング	1,600	1,332.00	2,131,200
I-PEX	900	1,533.00	1,379,700
大崎電気工業	3,500	784.00	2,744,000
オムロン	12,400	6,119.00	75,875,600
日東工業	2,200	2,927.00	6,439,400
I D E C	2,400	2,459.00	5,901,600
正興電機製作所	300	1,264.00	379,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6,400	2,735.50	17,507,200
サクサ	100	2,385.00	238,500
メルコホールディングス	500	2,351.00	1,175,500
テクノメディカ	500	1,811.00	905,500
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	900	609.00	548,100
日本電気	21,300	13,375.00	284,887,500
富士通	149,500	2,971.00	444,164,500
沖電気工業	7,300	1,003.00	7,321,900
電気興業	600	1,970.00	1,182,000
サンケン電気	1,500	6,142.00	9,213,000
アイホン	900	2,891.00	2,601,900
ルネサスエレクトロニクス	123,800	2,099.50	259,918,100
セイコーエプソン	20,800	2,765.50	57,522,400
ワコム	11,400	675.00	7,695,000
アルバック	3,600	7,151.00	25,743,600
アクセル	800	1,383.00	1,106,400
E I Z O	2,400	2,196.00	5,270,400
日本信号	3,700	925.00	3,422,500
京三製作所	3,500	540.00	1,890,000
能美防災	2,200	2,931.00	6,448,200

ホーチキ	1,200	2,106.00	2,527,200
星和電機	500	517.00	258,500
エレコム	3,900	1,432.00	5,584,800
パナソニック ホールディングス	192,000	1,244.50	238,944,000
シャープ	27,400	946.70	25,939,580
アンリツ	11,400	1,111.00	12,665,400
富士通ゼネラル	4,600	1,862.00	8,565,200
ソニーグループ	563,300	2,698.00	1,519,783,400
TDK	128,600	1,858.50	239,003,100
帝国通信工業	700	2,604.00	1,822,800
タムラ製作所	6,500	561.00	3,646,500
アルプスアルパイン	14,500	1,574.00	22,823,000
日本電波工業	2,000	1,046.00	2,092,000
鈴木	900	1,872.00	1,684,800
メイコー	1,600	6,080.00	9,728,000
日本トリム	400	3,530.00	1,412,000
フォスター電機	1,200	1,740.00	2,088,000
SMK	400	2,269.00	907,600
ヨコオ	1,400	1,552.00	2,172,800
ホンデン	3,700	2,243.00	8,299,100
ヒロセ電機	2,400	18,040.00	43,296,000
日本航空電子工業	3,900	2,761.00	10,767,900
TOA	1,900	966.00	1,835,400
マクセル	3,600	1,847.00	6,649,200
古野電気	2,100	2,443.00	5,130,300
スミダコーポレーション	2,200	935.00	2,057,000
アイコム	600	2,860.00	1,716,000
リオン	700	2,207.00	1,544,900
横河電機	17,800	3,464.00	61,659,200
新電元工業	600	2,371.00	1,422,600
アズビル	44,200	1,177.50	52,045,500
東亜ディーケーケー	400	753.00	301,200
日本光電工業	13,400	2,255.50	30,223,700
チノー	700	2,189.00	1,532,300
日本電子材料	1,000	2,493.00	2,493,000
堀場製作所	3,100	9,251.00	28,678,100

アドバンテスト	46,100	8,181.00	377,144,100
エスベック	1,300	2,628.00	3,416,400
キーエンス	16,100	66,350.00	1,068,235,000
日置電機	900	8,210.00	7,389,000
シスメックス	41,600	2,847.50	118,456,000
日本マイクロニクス	2,700	3,740.00	10,098,000
メガチップス	1,300	5,490.00	7,137,000
OBARA GROUP	1,000	4,175.00	4,175,000
原田工業	500	540.00	270,000
コーセル	1,800	1,208.00	2,174,400
イリソ電子工業	1,500	2,595.00	3,892,500
オブテックスグループ	3,000	1,626.00	4,878,000
千代田インテグレ	600	3,405.00	2,043,000
レーザーテック	7,400	22,270.00	164,798,000
スタンレー電気	10,100	2,628.00	26,542,800
ウシオ電機	7,000	2,068.50	14,479,500
岡谷電機産業	1,000	229.00	229,000
日本セラミック	1,500	2,553.00	3,829,500
遠藤照明	300	1,286.00	385,800
古河電池	1,200	1,371.00	1,645,200
山一電機	1,500	2,483.00	3,724,500
図研	1,300	3,580.00	4,654,000
日本電子	4,000	5,421.00	21,684,000
カシオ計算機	11,400	1,123.50	12,807,900
ファナック	77,800	4,016.00	312,444,800
日本シイエムケイ	3,900	407.00	1,587,300
エンプラス	500	6,520.00	3,260,000
大真空	2,400	599.00	1,437,600
ローム	29,100	1,710.50	49,775,550
浜松ホトニクス	25,900	2,020.00	52,318,000
三井ハイテック	7,100	846.10	6,007,310
新光電気工業	5,700	5,437.00	30,990,900
京セラ	99,900	1,719.50	171,778,050
太陽誘電	7,900	2,771.00	21,890,900
村田製作所	143,700	2,777.00	399,054,900
双葉電子工業	3,100	497.00	1,540,700

ニチコン	4,200	973.00	4,086,600	
日本ケミコン	1,700	1,082.00	1,839,400	
KOA	2,500	1,068.00	2,670,000	
市光工業	2,900	449.00	1,302,100	
小糸製作所	16,700	2,010.50	33,575,350	
ミツバ	3,000	875.00	2,625,000	
S C R E E Nホールディングス	5,500	9,938.00	54,659,000	
キヤノン電子	1,500	2,363.00	3,544,500	
キヤノン	80,200	5,046.00	404,689,200	
リコー	40,300	1,652.50	66,595,750	
象印マホービン	4,800	1,575.00	7,560,000	
東京エレクトロン	34,000	23,860.00	811,240,000	代用有価証券 3,000株
イノテック	1,100	1,472.00	1,619,200	
トヨタ紡織	6,800	1,973.00	13,416,400	
芦森工業	100	2,474.00	247,400	
ユニプレス	2,900	1,111.00	3,221,900	
豊田自動織機	13,800	11,470.00	158,286,000	
モリタホールディングス	2,800	1,942.00	5,437,600	
三櫻工業	2,500	726.00	1,815,000	
デンソー	132,700	2,151.00	285,437,700	
東海理化電機製作所	4,500	2,015.00	9,067,500	
川崎重工業	13,100	5,587.00	73,189,700	
名村造船所	5,000	1,613.00	8,065,000	
日本車輛製造	500	2,118.00	1,059,000	
三菱ロジスネクスト	2,600	1,126.00	2,927,600	
日産自動車	211,500	409.80	86,672,700	
いすゞ自動車	45,100	1,986.00	89,568,600	
トヨタ自動車	855,300	2,707.00	2,315,297,100	代用有価証券 45,000株
日野自動車	24,100	458.50	11,049,850	
三菱自動車工業	62,700	427.50	26,804,250	
レシップホールディングス	500	510.00	255,000	
武蔵精密工業	3,900	1,963.00	7,655,700	
日産車体	1,600	1,021.00	1,633,600	
新明和工業	4,600	1,338.00	6,154,800	
極東開発工業	2,700	2,345.00	6,331,500	

トピー工業	1,300	1,938.00	2,519,400
ティラド	400	3,430.00	1,372,000
曙ブレーキ工業	9,500	121.00	1,149,500
タチエス	3,000	1,776.00	5,328,000
NOK	6,300	2,194.50	13,825,350
フタバ産業	4,300	713.00	3,065,900
カヤバ	1,500	4,825.00	7,237,500
大同メタル工業	3,200	502.00	1,606,400
プレス工業	6,400	556.00	3,558,400
ミクニ	800	320.00	256,000
太平洋工業	3,700	1,362.00	5,039,400
アイシン	34,000	1,683.00	57,222,000
マツダ	53,200	1,102.50	58,653,000
本田技研工業	381,200	1,582.00	603,058,400
スズキ	118,200	1,530.00	180,846,000
SUBARU	49,900	2,734.50	136,451,550
安永	400	511.00	204,400
ヤマハ発動機	67,900	1,324.00	89,899,600
エクセディ	2,600	3,795.00	9,867,000
豊田合成	4,600	2,602.50	11,971,500
愛三工業	2,700	1,420.00	3,834,000
ヨロズ	1,500	1,169.00	1,753,500
エフ・シー・シー	2,900	2,361.00	6,846,900
シマノ	7,000	23,335.00	163,345,000
テイ・エス テック	5,700	1,722.00	9,815,400
ジャムコ	900	1,245.00	1,120,500
テルモ	89,700	2,886.50	258,919,050
日機装	4,200	1,005.00	4,221,000
日本エム・ディ・エム	1,500	667.00	1,000,500
島津製作所	21,400	4,514.00	96,599,600
JMS	1,800	480.00	864,000
長野計器	1,200	2,467.00	2,960,400
ブイ・テクノロジー	800	2,448.00	1,958,400
東京計器	1,200	2,960.00	3,552,000
愛知時計電機	700	1,943.00	1,360,100
インターアクション	1,000	1,082.00	1,082,000

東京精密	3,300	8,030.00	26,499,000
マニー	6,400	1,777.50	11,376,000
ニコン	23,300	1,840.00	42,872,000
トプコン	7,700	1,547.50	11,915,750
オリンパス	92,100	2,678.00	246,643,800
理研計器	2,300	4,310.00	9,913,000
タムロン	2,200	4,335.00	9,537,000
HOYA	31,700	20,100.00	637,170,000
ノーリツ鋼機	1,500	3,830.00	5,745,000
A&Dホロンホールディングス	2,400	2,174.00	5,217,600
朝日インテック	19,600	2,449.00	48,000,400
シチズン時計	14,700	925.00	13,597,500
大研医器	600	497.00	298,200
メニコン	5,500	1,655.00	9,102,500
シンシア	500	470.00	235,000
松風	1,400	2,262.00	3,166,800
セイコーグループ	2,200	3,870.00	8,514,000
ニプロ	13,400	1,404.50	18,820,300
三井松島ホールディングス	1,300	4,370.00	5,681,000
パラマウントベッドホールディングス	3,400	2,489.00	8,462,600
トランザクション	1,100	2,514.00	2,765,400
粧美堂	300	493.00	147,900
ニホンフラッシュ	1,500	884.00	1,326,000
前田工織	2,900	1,734.00	5,028,600
アートネイチャー	1,400	834.00	1,167,600
フルヤ金属	1,500	3,930.00	5,895,000
バンダイナムコホールディングス	43,700	3,228.00	141,063,600
アイフイスジャパン	300	560.00	168,000
SHOEI	4,500	2,286.00	10,287,000
フランスベッドホールディングス	2,100	1,253.00	2,631,300
パイロットコーポレーション	2,500	4,764.00	11,910,000
萩原工業	1,100	1,561.00	1,717,100
フジシールインターナショナル	3,300	2,563.00	8,457,900
タカラトミー	7,300	3,907.00	28,521,100
広済堂ホールディングス	5,200	526.00	2,735,200
プロネクサス	1,700	1,278.00	2,172,600

TOPPANホールディングス	19,200	4,367.00	83,846,400	
大日本印刷	33,300	2,620.00	87,246,000	
共同印刷	400	3,390.00	1,356,000	
NISSHA	2,800	1,844.00	5,163,200	
TAKARA & COMPANY	1,000	2,632.00	2,632,000	
アシックス	59,400	2,655.00	157,707,000	
ツツミ	400	2,120.00	848,000	
ローランド	1,200	3,850.00	4,620,000	
小松ウオール工業	1,400	1,502.00	2,102,800	
ヤマハ	29,300	1,250.00	36,625,000	
河合楽器製作所	500	2,792.00	1,396,000	
クリナップ	1,800	707.00	1,272,600	
ピジョン	10,200	1,629.50	16,620,900	
キングジム	1,600	854.00	1,366,400	
リンテック	3,200	3,155.00	10,096,000	
イトーキ	3,200	1,446.00	4,627,200	
任天堂	101,600	8,160.00	829,056,000	代用有価証券 18,000株
三菱鉛筆	2,200	2,454.00	5,398,800	
タカラスタANDARD	3,300	1,634.00	5,392,200	
コクヨ	8,000	2,650.50	21,204,000	
ナカバヤシ	2,000	520.00	1,040,000	
グローブライト	1,400	1,868.00	2,615,200	
オカムラ	4,900	1,919.00	9,403,100	
美津濃	1,600	8,000.00	12,800,000	
グリムス	700	2,590.00	1,813,000	
東京電力ホールディングス	145,100	615.30	89,280,030	
中部電力	59,300	1,667.50	98,882,750	
関西電力	62,100	2,464.00	153,014,400	
中国電力	28,000	1,006.50	28,182,000	
北陸電力	16,400	898.00	14,727,200	
東北電力	42,400	1,423.50	60,356,400	
四国電力	15,000	1,224.00	18,360,000	
九州電力	37,100	1,620.00	60,102,000	
北海道電力	15,500	931.80	14,442,900	
沖縄電力	4,100	1,008.00	4,132,800	

電源開発	13,200	2,447.00	32,300,400
イーレックス	2,900	634.00	1,838,600
レノバ	4,300	850.00	3,655,000
東京瓦斯	31,300	3,201.00	100,191,300
大阪瓦斯	32,100	3,169.00	101,724,900
東邦瓦斯	7,000	3,721.00	26,047,000
北海道瓦斯	5,000	576.00	2,880,000
広島ガス	3,600	382.00	1,375,200
西部ガスホールディングス	1,700	1,744.00	2,964,800
静岡ガス	3,700	1,001.00	3,703,700
メタウォーター	1,900	1,791.00	3,402,900
SBSホールディングス	1,400	2,486.00	3,480,400
東武鉄道	17,600	2,449.00	43,102,400
相鉄ホールディングス	5,800	2,275.50	13,197,900
東急	45,100	1,855.50	83,683,050
京浜急行電鉄	19,900	1,179.50	23,472,050
小田急電鉄	26,600	1,587.50	42,227,500
京王電鉄	7,700	3,398.00	26,164,600
京成電鉄	10,400	3,879.00	40,341,600
富士急行	2,000	2,515.00	5,030,000
東日本旅客鉄道	88,700	3,006.00	266,632,200
西日本旅客鉄道	38,100	2,664.00	101,498,400
東海旅客鉄道	62,000	3,123.00	193,626,000
西武ホールディングス	19,400	3,258.00	63,205,200
鴻池運輸	2,700	2,473.00	6,677,100
西日本鉄道	4,300	2,170.50	9,333,150
ハマキョウレックス	5,600	1,259.00	7,050,400
サカイ引越センター	1,800	2,424.00	4,363,200
近鉄グループホールディングス	16,100	3,535.00	56,913,500
阪急阪神ホールディングス	21,400	4,076.00	87,226,400
南海電気鉄道	7,100	2,220.00	15,762,000
京阪ホールディングス	8,900	2,802.00	24,937,800
神戸電鉄	400	2,429.00	971,600
名古屋鉄道	16,500	1,676.50	27,662,250
山陽電気鉄道	1,200	2,028.00	2,433,600
アルプス物流	1,300	5,780.00	7,514,000

ヤマトホールディングス	19,500	1,605.00	31,297,500
山九	3,900	4,688.00	18,283,200
丸全昭和運輸	1,000	5,730.00	5,730,000
センコーグループホールディングス	8,400	1,387.00	11,650,800
トナミホールディングス	400	6,100.00	2,440,000
ニッコンホールディングス	9,900	1,923.00	19,037,700
福山通運	1,500	3,845.00	5,767,500
セイノーホールディングス	9,100	2,410.50	21,935,550
神奈川中央交通	400	3,325.00	1,330,000
AZ-COM丸和ホールディングス	4,100	1,010.00	4,141,000
九州旅客鉄道	11,400	3,964.00	45,189,600
SGホールディングス	26,900	1,508.00	40,565,200
NIPPON EXPRESSホールディングス	6,000	7,489.00	44,934,000
日本郵船	41,600	5,041.00	209,705,600
商船三井	34,900	4,989.00	174,116,100
川崎汽船	36,700	2,113.00	77,547,100
NSユニテッド海運	900	4,490.00	4,041,000
飯野海運	5,900	1,220.00	7,198,000
乾汽船	1,900	1,111.00	2,110,900
日本航空	39,400	2,406.50	94,816,100
ANAホールディングス	43,700	2,950.50	128,936,850
パスコ	100	2,131.00	213,100
トランコム	500	10,330.00	5,165,000
日新	1,200	4,245.00	5,094,000
三菱倉庫	3,800	5,161.00	19,611,800
三井倉庫ホールディングス	1,500	6,950.00	10,425,000
住友倉庫	4,300	2,648.00	11,386,400
澁澤倉庫	700	3,150.00	2,205,000
日本トランスシティ	3,200	919.00	2,940,800
中央倉庫	900	1,622.00	1,459,800
川西倉庫	300	1,067.00	320,100
安田倉庫	1,100	1,678.00	1,845,800
ファイズホールディングス	300	841.00	252,300
上組	7,400	3,192.00	23,620,800
キムラユニティー	300	1,461.00	438,300

キューソー流通システム	1,100	1,851.00	2,036,100
エーアイテイナー	1,000	1,772.00	1,772,000
内外トランスライン	600	2,814.00	1,688,400
日本コンセプト	600	1,784.00	1,070,400
NEC ネットエスアイ	6,300	2,675.00	16,852,500
クロスキャット	1,000	1,087.00	1,087,000
システナ	24,400	360.00	8,784,000
デジタルアーツ	1,000	5,080.00	5,080,000
日鉄ソリューションズ	5,500	3,460.00	19,030,000
キューブシステム	1,000	981.00	981,000
コア	700	1,934.00	1,353,800
手間いらず	300	3,275.00	982,500
ラクーンホールディングス	1,500	745.00	1,117,500
ソリトンシステムズ	1,000	1,267.00	1,267,000
ソフトクリエイトホールディングス	1,300	2,014.00	2,618,200
T I S	17,000	3,722.00	63,274,000
グリー	5,400	465.00	2,511,000
コーエーテクモホールディングス	10,000	1,540.00	15,400,000
三菱総合研究所	800	4,195.00	3,356,000
電算	100	1,405.00	140,500
A G S	300	811.00	243,300
ファインデックス	1,300	850.00	1,105,000
ブレインパッド	1,300	801.00	1,041,300
K L a b	4,600	175.00	805,000
ポールトゥウィンホールディングス	2,800	455.00	1,274,000
ネクソン	35,400	2,658.00	94,093,200
アイスタイル	5,300	435.00	2,305,500
エムアップホールディングス	2,000	1,276.00	2,552,000
エニグモ	2,400	310.00	744,000
テクノスジャパン	500	629.00	314,500
コロプラ	5,400	520.00	2,808,000
ブロードリーフ	6,500	578.00	3,757,000
クロス・マーケティンググループ	500	681.00	340,500
デジタルハーツホールディングス	1,200	804.00	964,800
メディアドゥ	700	1,280.00	896,000
じげん	4,700	571.00	2,683,700

フィックスターズ	1,600	1,436.00	2,297,600
CARTA HOLDINGS	900	1,421.00	1,278,900
オプティム	1,600	580.00	928,000
セレス	800	1,413.00	1,130,400
SHIFT	1,100	14,650.00	16,115,000
ティーガイア	1,700	2,668.00	4,535,600
セック	200	3,975.00	795,000
テクマトリックス	2,900	2,198.00	6,374,200
プロシップ	800	1,500.00	1,200,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,000	3,300.00	13,200,000
GMOペイメントゲートウェイ	3,700	8,647.00	31,993,900
システムリサーチ	1,100	1,359.00	1,494,900
インターネットイニシアティブ	7,700	2,838.00	21,852,600
さくらインターネット	2,000	4,355.00	8,710,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	2,735.00	1,367,500
SRAホールディングス	800	4,215.00	3,372,000
システムインテグレータ	400	323.00	129,200
朝日ネット	1,900	628.00	1,193,200
eBASE	2,300	633.00	1,455,900
アバントグループ	2,000	2,122.00	4,244,000
アドソル日進	800	1,813.00	1,450,400
フリービット	800	1,217.00	973,600
コムチュア	2,300	1,848.00	4,250,400
アステリア	1,600	503.00	804,800
アイル	900	3,175.00	2,857,500
マークライnz	900	2,736.00	2,462,400
メディカル・データ・ビジョン	2,100	527.00	1,106,700
gumi	3,000	300.00	900,000
テラスカイ	700	1,828.00	1,279,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	800	2,006.00	1,604,800
PCIホールディングス	300	946.00	283,800
ネオジャパン	600	1,894.00	1,136,400
PR TIMES	400	1,548.00	619,200
ラクス	7,600	2,035.00	15,466,000
ランドコンピュータ	400	745.00	298,000
ダブルスタンダード	600	1,602.00	961,200

アカツキ	800	2,025.00	1,620,000
ベネフィットジャパン	100	1,075.00	107,500
U b i c o mホールディングス	600	1,348.00	808,800
カナミックネットワーク	2,100	539.00	1,131,900
ノムラシステムコーポレーション	1,300	113.00	146,900
チェンジホールディングス	3,500	1,206.00	4,221,000
シンクロ・フード	700	467.00	326,900
オークネット	700	2,477.00	1,733,900
エイトレッド	100	1,594.00	159,400
マクロミル	3,100	796.00	2,467,600
ビーグリー	100	1,409.00	140,900
オロ	700	2,280.00	1,596,000
ユーザーローカル	700	1,783.00	1,248,100
マネーフォワード	4,000	5,066.00	20,264,000
S u n A s t e r i s k	1,200	514.00	616,800
プラスアルファ・コンサルティング	2,000	2,122.00	4,244,000
電算システムホールディングス	700	2,638.00	1,846,600
A p p i e r G r o u p	4,900	1,627.00	7,972,300
ビジョナル	1,900	7,830.00	14,877,000
ソルクシーズ	700	285.00	199,500
ハイマックス	600	1,386.00	831,600
野村総合研究所	34,900	4,854.00	169,404,600
C Eホールディングス	300	409.00	122,700
日本システム技術	1,500	1,809.00	2,713,500
インテージホールディングス	1,800	1,550.00	2,790,000
東邦システムサイエンス	700	1,442.00	1,009,400
ソースネクスト	7,200	199.00	1,432,800
シンプレクス・ホールディングス	2,500	2,311.00	5,777,500
HEROZ	800	1,323.00	1,058,400
ラクスル	3,900	1,220.00	4,758,000
メルカリ	7,800	2,090.00	16,302,000
I P S	500	2,360.00	1,180,000
システムサポート	600	1,807.00	1,084,200
イーソル	1,300	711.00	924,300
東海ソフト	100	1,224.00	122,400
ウイングアーク 1 s t	1,700	3,140.00	5,338,000

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	700	793.00	555,100	
サーバーワークス	400	2,346.00	938,400	
東名	200	2,128.00	425,600	
トビラシステムズ	200	773.00	154,600	
S a n s a n	5,300	2,172.00	11,511,600	
L i n k-Uグループ	300	472.00	141,600	
ギフトイ	1,400	912.00	1,276,800	
メドレー	1,800	3,875.00	6,975,000	
ベース	800	2,955.00	2,364,000	
JMDC	2,800	4,165.00	11,662,000	
フォーカスシステムズ	1,200	1,076.00	1,291,200	
クレスコ	2,600	1,245.00	3,237,000	
フジ・メディア・ホールディングス	15,400	1,672.50	25,756,500	
オービック	26,900	4,744.00	127,613,600	
ジャストシステム	2,300	3,410.00	7,843,000	
TDCソフト	3,000	1,171.00	3,513,000	
L I N Eヤフー	229,400	415.50	95,315,700	
トレンドマイクロ	8,500	8,067.00	68,569,500	
IDホールディングス	1,100	1,406.00	1,546,600	
日本オラクル	3,100	14,805.00	45,895,500	
アルファシステムズ	400	3,190.00	1,276,000	
フューチャー	4,000	1,891.00	7,564,000	
C A C H o l d i n g s	1,000	1,747.00	1,747,000	
オービックビジネスコンサルタント	2,300	7,122.00	16,380,600	
アイティフォー	2,000	1,384.00	2,768,000	
東計電算	500	4,665.00	2,332,500	
エクスネット	100	1,403.00	140,300	
大塚商会	18,200	3,372.00	61,370,400	
サイボウズ	2,200	2,040.00	4,488,000	
電通総研	1,600	5,300.00	8,480,000	
A C C E S S	1,700	1,254.00	2,131,800	
デジタルガレージ	2,600	3,020.00	7,852,000	
EMシステムズ	2,600	527.00	1,370,200	
ウェザーニューズ	500	5,860.00	2,930,000	
C I J	4,000	406.00	1,624,000	

ビジネスエンジニアリング	400	3,960.00	1,584,000	
WOWOW	1,200	1,011.00	1,213,200	
スカラ	1,700	462.00	785,400	
インテリジェント ウェイブ	300	850.00	255,000	
ANYCOLOR	2,200	2,153.00	4,736,600	
IMAGICA GROUP	1,900	515.00	978,500	
ネットワンシステムズ	6,300	3,431.00	21,615,300	
アルゴグラフィックス	1,500	5,070.00	7,605,000	
マーベラス	2,500	566.00	1,415,000	
エイベックス	2,700	1,526.00	4,120,200	
BIPROGY	4,900	4,722.00	23,137,800	
都築電気	800	2,558.00	2,046,400	
TBSホールディングス	8,100	3,735.00	30,253,500	
日本テレビホールディングス	14,200	2,302.00	32,688,400	
朝日放送グループホールディングス	1,500	618.00	927,000	
テレビ朝日ホールディングス	3,900	1,973.00	7,694,700	
スカパーJ SATホールディングス	12,400	861.00	10,676,400	
テレビ東京ホールディングス	1,200	3,360.00	4,032,000	
ビジョン	2,400	1,046.00	2,510,400	
U-NEXT HOLDINGS	1,800	4,805.00	8,649,000	
日本通信	15,600	142.00	2,215,200	
クロップス	200	974.00	194,800	
日本電信電話	4,798,800	146.80	704,463,840	代用有価証券 700,000株
KDDI	118,700	4,764.00	565,486,800	
ソフトバンク	2,579,900	188.20	485,537,180	
光通信	1,600	31,000.00	49,600,000	
エムティーアイ	1,200	1,129.00	1,354,800	
GMOインターネットグループ	5,300	2,569.00	13,615,700	
ファイバーゲート	800	1,010.00	808,000	
KADOKAWA	8,500	3,248.00	27,608,000	
学研ホールディングス	2,900	988.00	2,865,200	
ゼンリン	2,700	829.00	2,238,300	
アイネット	1,000	1,551.00	1,551,000	
松竹	800	10,515.00	8,412,000	
東宝	8,900	5,833.00	51,913,700	

東映	2,700	4,855.00	13,108,500
NTTデータグループ	42,100	2,399.00	100,997,900
ピー・シー・エー	900	2,072.00	1,864,800
ビジネスブレイン太田昭和	600	1,851.00	1,110,600
D T S	3,200	3,880.00	12,416,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,300	5,884.00	42,953,200
シーイーシー	2,000	1,796.00	3,592,000
カプコン	28,800	3,325.00	95,760,000
アイ・エス・ビー	700	1,449.00	1,014,300
S C S K	11,200	2,801.50	31,376,800
N S W	700	2,979.00	2,085,300
アイネス	1,300	1,563.00	2,031,900
T K C	2,900	3,910.00	11,339,000
富士ソフト	4,500	9,230.00	41,535,000
N S D	5,700	3,190.00	18,183,000
コナミグループ	6,100	13,900.00	84,790,000
福井コンピュータホールディングス	1,000	2,683.00	2,683,000
J B C Cホールディングス	1,100	3,845.00	4,229,500
ミロク情報サービス	1,500	1,848.00	2,772,000
ソフトバンクグループ	79,600	9,009.00	717,116,400
リョーサン菱洋ホールディングス	3,200	2,548.00	8,153,600
高千穂交易	700	4,040.00	2,828,000
オルバヘルスケアホールディングス	200	2,015.00	403,000
伊藤忠食品	400	7,030.00	2,812,000
エレマテック	1,500	1,697.00	2,545,500
あらた	2,600	3,430.00	8,918,000
トーメンデバイス	200	5,930.00	1,186,000
東京エレクトロン デバイス	1,700	3,440.00	5,848,000
円谷フィールズホールディングス	2,800	2,146.00	6,008,800
双日	18,900	3,259.00	61,595,100
アルフレッサ ホールディングス	17,000	2,186.50	37,170,500
横浜冷凍	4,300	920.00	3,956,000
神栄	200	1,627.00	325,400
ラサ商事	900	1,400.00	1,260,000
アルコニックス	2,200	1,356.00	2,983,200
神戸物産	13,100	3,802.00	49,806,200

あい ホールディングス	2,700	2,327.00	6,282,900
ダイワボウホールディングス	7,600	2,707.00	20,573,200
マクニカホールディングス	12,000	1,963.50	23,562,000
ラクト・ジャパン	700	2,683.00	1,878,100
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,600	1,277.00	3,320,200
八洲電機	1,400	1,711.00	2,395,400
メディアスホールディングス	1,200	862.00	1,034,400
レスター	1,400	2,620.00	3,668,000
ジオリーブグループ	300	1,075.00	322,500
大光	500	619.00	309,500
OCHIホールディングス	200	1,334.00	266,800
TOKAIホールディングス	9,200	927.00	8,528,400
三洋貿易	1,700	1,443.00	2,453,100
ビューティガレージ	600	1,477.00	886,200
ウイン・パートナーズ	1,100	1,205.00	1,325,500
シップヘルスケアホールディングス	6,100	2,317.00	14,133,700
明治電機工業	700	1,368.00	957,600
デリカフーズホールディングス	400	516.00	206,400
スターティアホールディングス	200	1,910.00	382,000
コメダホールディングス	4,200	2,840.00	11,928,000
アセンテック	900	654.00	588,600
フルサト・マルカホールディングス	1,400	2,188.00	3,063,200
ヤマエグループホールディングス	1,500	1,890.00	2,835,000
小野建	1,700	1,488.00	2,529,600
南陽	300	1,094.00	328,200
佐島電機	1,200	1,887.00	2,264,400
エコートレーディング	200	913.00	182,600
伯東	1,000	4,455.00	4,455,000
コンドーテック	1,300	1,259.00	1,636,700
ナガイレーベン	2,200	2,229.00	4,903,800
三菱食品	1,600	4,835.00	7,736,000
松田産業	1,300	3,140.00	4,082,000
第一興商	6,600	1,868.50	12,332,100
メディカルホールディングス	17,200	2,428.50	41,770,200
S P K	700	2,039.00	1,427,300
萩原電気ホールディングス	700	3,340.00	2,338,000

アズワン	5,300	2,837.00	15,036,100
スズデン	600	1,784.00	1,070,400
シモジマ	1,100	1,307.00	1,437,700
ドウシシャ	1,600	2,140.00	3,424,000
高速	1,000	2,554.00	2,554,000
たけびし	700	2,068.00	1,447,600
リックス	400	2,629.00	1,051,600
丸文	1,500	1,043.00	1,564,500
ハピネット	1,400	3,965.00	5,551,000
橋本総業ホールディングス	800	1,239.00	991,200
日本ライフライン	4,600	1,175.00	5,405,000
タカショー	1,800	494.00	889,200
I DOM	4,500	1,008.00	4,536,000
進和	1,000	2,650.00	2,650,000
エスケイジャパン	200	664.00	132,800
ダイترون	700	2,820.00	1,974,000
シークス	2,400	1,114.00	2,673,600
オーハシテクニカ	900	1,721.00	1,548,900
白銅	500	2,367.00	1,183,500
ダイコー通産	100	1,193.00	119,300
伊藤忠商事	114,400	7,539.00	862,461,600
丸紅	141,100	2,348.50	331,373,350
高島	400	1,206.00	482,400
長瀬産業	7,600	3,102.00	23,575,200
蝶理	1,100	3,855.00	4,240,500
豊田通商	44,700	2,666.50	119,192,550
三共生興	2,300	588.00	1,352,400
兼松	7,000	2,314.00	16,198,000
三井物産	255,000	3,152.00	803,760,000
日本紙パルプ商事	7,900	667.00	5,269,300
カメイ	1,800	1,911.00	3,439,800
OUGホールディングス	100	2,484.00	248,400
スターゼン	1,200	2,900.00	3,480,000
山善	5,200	1,308.00	6,801,600
椿本興業	1,000	1,862.00	1,862,000
住友商事	101,900	3,271.00	333,314,900

内田洋行	700	6,520.00	4,564,000
三菱商事	326,800	2,805.00	916,674,000
第一実業	1,600	2,316.00	3,705,600
キヤノンマーケティングジャパン	4,000	4,495.00	17,980,000
西華産業	700	3,840.00	2,688,000
佐藤商事	1,200	1,379.00	1,654,800
東京産業	1,600	683.00	1,092,800
ユアサ商事	1,300	4,645.00	6,038,500
神鋼商事	400	6,230.00	2,492,000
阪和興業	3,100	5,010.00	15,531,000
正栄食品工業	1,100	4,465.00	4,911,500
カナデン	1,300	1,492.00	1,939,600
RYODEN	1,400	2,470.00	3,458,000
岩谷産業	15,500	1,981.50	30,713,250
ナイス	200	1,586.00	317,200
ニチモウ	200	1,827.00	365,400
極東貿易	1,000	1,471.00	1,471,000
アステナホールディングス	3,200	514.00	1,644,800
三愛オブリ	4,000	1,854.00	7,416,000
稲畑産業	3,300	3,230.00	10,659,000
G S I クレオス	900	2,000.00	1,800,000
明和産業	2,000	641.00	1,282,000
ワキタ	2,800	1,574.00	4,407,200
東邦ホールディングス	4,600	4,558.00	20,966,800
サンゲツ	3,900	2,769.00	10,799,100
ミツウロコグループホールディングス	2,200	1,694.00	3,726,800
シナネンホールディングス	500	6,300.00	3,150,000
伊藤忠エネクス	4,200	1,546.00	6,493,200
サンリオ	13,800	4,075.00	56,235,000
サンワテクノス	900	1,923.00	1,730,700
新光商事	2,300	938.00	2,157,400
トーヨー	700	2,669.00	1,868,300
三信電気	700	2,012.00	1,408,400
東陽テクニカ	1,600	1,584.00	2,534,400
モスフードサービス	2,500	3,560.00	8,900,000
加賀電子	3,200	2,796.00	8,947,200

ソーダニッカ	1,800	1,156.00	2,080,800
立花エレテック	1,100	2,507.00	2,757,700
フォーバル	800	1,373.00	1,098,400
PAL TAC	2,300	4,230.00	9,729,000
三谷産業	2,900	319.00	925,100
西本W i s m e t t a cホールディングス	1,000	1,324.00	1,324,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	2,164.00	216,400
コア商事ホールディングス	1,500	604.00	906,000
K P Pグループホールディングス	4,400	658.00	2,895,200
ヤマタネ	700	3,230.00	2,261,000
泉州電業	1,200	4,685.00	5,622,000
トラスコ中山	3,600	2,287.00	8,233,200
オートバックスセブン	5,900	1,421.50	8,386,850
モリト	1,300	1,399.00	1,818,700
加藤産業	2,100	4,115.00	8,641,500
イエローハット	2,700	2,471.00	6,671,700
J Kホールディングス	1,300	1,045.00	1,358,500
日伝	1,100	3,125.00	3,437,500
杉本商事	1,600	1,384.00	2,214,400
因幡電機産業	4,400	3,720.00	16,368,000
東テク	1,700	2,552.00	4,338,400
ミスミグループ本社	25,700	2,653.50	68,194,950
蔵王産業	100	2,453.00	245,300
スズケン	6,100	4,930.00	30,073,000
ジェコス	1,000	873.00	873,000
サンエー	2,600	2,896.00	7,529,600
カワチ薬品	1,300	2,517.00	3,272,100
エービーシー・マート	7,400	3,008.00	22,259,200
ハードオフコーポレーション	700	1,908.00	1,335,600
アスクル	4,100	1,950.00	7,995,000
ゲオホールディングス	1,900	1,537.00	2,920,300
アダストリア	2,100	3,500.00	7,350,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	300	534.00	160,200
くら寿司	2,000	3,970.00	7,940,000
キャンドウ	600	3,190.00	1,914,000
パルグループホールディングス	3,400	3,025.00	10,285,000

エディオン	6,800	1,740.00	11,832,000
サーラコーポレーション	3,600	864.00	3,110,400
ハローズ	800	4,235.00	3,388,000
フジオフードグループ本社	1,900	1,373.00	2,608,700
あみやき亭	1,200	1,655.00	1,986,000
大黒天物産	500	10,240.00	5,120,000
ハニーズホールディングス	1,500	1,698.00	2,547,000
ファーマライズホールディングス	300	626.00	187,800
アルペン	1,400	2,030.00	2,842,000
ハブ	400	741.00	296,400
クオールホールディングス	2,300	1,389.00	3,194,700
ジーンズホールディングス	1,300	6,110.00	7,943,000
ビックカメラ	10,100	1,638.00	16,543,800
DCMホールディングス	8,700	1,426.00	12,406,200
MonotaRO	24,100	2,298.00	55,381,800
東京一番フーズ	400	498.00	199,200
J. フロント リテイリング	19,500	1,605.00	31,297,500
ドトール・日レスホールディングス	3,000	2,222.00	6,666,000
マツキヨココカラ&カンパニー	30,900	2,058.00	63,592,200
ブロンコビリー	1,000	3,670.00	3,670,000
ZOZO	10,900	4,953.00	53,987,700
トレジャー・ファクトリー	1,200	1,334.00	1,600,800
物語コーポレーション	3,000	3,560.00	10,680,000
三越伊勢丹ホールディングス	28,200	2,311.50	65,184,300
Hamee	900	1,025.00	922,500
ウエルシアホールディングス	8,800	1,937.00	17,045,600
クリエイトSDホールディングス	2,400	3,015.00	7,236,000
丸善CHIホールディングス	900	321.00	288,900
ティーライフ	200	1,161.00	232,200
シュッピン	1,600	1,056.00	1,689,600
オイシックス・ラ・大地	2,300	1,312.00	3,017,600
ネクステージ	3,900	1,422.00	5,545,800
ジョイフル本田	4,700	2,015.00	9,470,500
エターナルホスピタリティグループ	600	3,570.00	2,142,000
ホットランド	1,300	2,234.00	2,904,200
すかいらーくホールディングス	23,200	2,330.00	54,056,000

SFPホールディングス	800	1,925.00	1,540,000
綿半ホールディングス	1,300	1,687.00	2,193,100
ヨシックスホールディングス	400	3,300.00	1,320,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,800	813.00	3,902,400
B E E N O S	1,000	2,947.00	2,947,000
あさひ	1,600	1,505.00	2,408,000
日本調剤	1,200	1,396.00	1,675,200
コスモス薬品	2,900	7,292.00	21,146,800
トーエル	400	805.00	322,000
セブン&アイ・ホールディングス	172,300	2,279.00	392,671,700
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	11,400	1,204.00	13,725,600
ツルハホールディングス	3,600	8,541.00	30,747,600
サンマルクホールディングス	1,400	2,297.00	3,215,800
トリドールホールディングス	4,800	3,885.00	18,648,000
ウイルプラスホールディングス	200	1,020.00	204,000
JMホールディングス	1,300	2,944.00	3,827,200
アレンザホールディングス	1,300	1,072.00	1,393,600
串カツ田中ホールディングス	600	1,549.00	929,400
バロックジャパンリミテッド	1,300	760.00	988,000
クスリのアオキホールディングス	5,700	3,210.00	18,297,000
力の源ホールディングス	1,100	1,098.00	1,207,800
FOOD & LIFE COMPANIE	9,100	2,976.50	27,086,150
メディカルシステムネットワーク	2,300	427.00	982,100
一家ホールディングス	300	668.00	200,400
ノジマ	5,000	1,968.00	9,840,000
カッパ・クリエイト	2,700	1,602.00	4,325,400
良品計画	20,200	2,376.00	47,995,200
アドヴァングループ	1,500	924.00	1,386,000
アルビス	600	2,705.00	1,623,000
ハウス オブ ローゼ	100	1,485.00	148,500
G-7ホールディングス	1,900	1,579.00	3,000,100
イオン北海道	5,100	884.00	4,508,400
コジマ	3,300	1,046.00	3,451,800
コーナン商事	2,100	3,595.00	7,549,500
エコス	600	2,094.00	1,256,400

ワタミ	1,900	1,030.00	1,957,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	34,300	3,766.00	129,173,800
西松屋チェーン	3,400	2,230.00	7,582,000
ゼンショーホールディングス	8,600	7,549.00	64,921,400
幸楽苑	1,300	1,251.00	1,626,300
サイゼリヤ	2,500	5,510.00	13,775,000
V Tホールディングス	6,700	456.00	3,055,200
魚力	600	2,423.00	1,453,800
フジ・コーポレーション	800	1,855.00	1,484,000
ユナイテッドアローズ	2,000	2,195.00	4,390,000
ハイデイ日高	2,500	2,718.00	6,795,000
コロワイド	8,700	1,674.50	14,568,150
壱番屋	6,700	1,035.00	6,934,500
スギホールディングス	10,200	2,606.50	26,586,300
薬王堂ホールディングス	800	2,205.00	1,764,000
スクロール	2,500	949.00	2,372,500
ヨンドシーホールディングス	1,600	1,837.00	2,939,200
木曾路	2,600	2,289.00	5,951,400
S R Sホールディングス	2,800	1,159.00	3,245,200
千趣会	3,600	314.00	1,130,400
リテールパートナーズ	2,500	1,300.00	3,250,000
上新電機	1,700	2,556.00	4,345,200
日本瓦斯	8,800	2,122.50	18,678,000
ロイヤルホールディングス	3,000	2,441.00	7,323,000
いなげや	1,700	1,115.00	1,895,500
チヨダ	1,700	1,300.00	2,210,000
ライフコーポレーション	1,800	3,315.00	5,967,000
リンガーハット	2,200	2,255.00	4,961,000
Mr M a x HD	2,200	692.00	1,522,400
A O K Iホールディングス	3,700	1,172.00	4,336,400
オークワ	2,500	914.00	2,285,000
コメリ	2,600	3,285.00	8,541,000
青山商事	3,700	1,301.00	4,813,700
しまむら	4,000	7,772.00	31,088,000
はせがわ	700	304.00	212,800

高島屋	21,700	1,212.00	26,300,400
松屋	2,900	837.00	2,427,300
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,600	2,063.00	17,741,800
近鉄百貨店	700	2,110.00	1,477,000
丸井グループ	11,200	2,370.00	26,544,000
アクシアル リテイリング	4,700	888.00	4,173,600
イオン	57,600	3,768.00	217,036,800
イズミ	3,000	3,181.00	9,543,000
平和堂	2,900	2,194.00	6,362,600
フジ	2,600	2,023.00	5,259,800
ヤオコー	2,000	9,164.00	18,328,000
ゼビオホールディングス	2,300	1,151.00	2,647,300
ケーズホールディングス	11,400	1,449.50	16,524,300
日産東京販売ホールディングス	900	430.00	387,000
シルバーライフ	700	744.00	520,800
Genky Drug Stores	1,500	3,180.00	4,770,000
ナルミヤ・インターナショナル	200	1,226.00	245,200
ブックオフグループホールディングス	1,200	1,492.00	1,790,400
ギフトホールディングス	900	3,180.00	2,862,000
アインホールディングス	2,400	4,950.00	11,880,000
Genki Global Dining	1,000	4,175.00	4,175,000
ヤマダホールディングス	52,300	432.30	22,609,290
アーケランズ	5,100	1,665.00	8,491,500
ニトリホールディングス	6,200	19,510.00	120,962,000
グルメ杵屋	1,400	1,025.00	1,435,000
ケーユーホールディングス	1,000	1,054.00	1,054,000
吉野家ホールディングス	6,300	3,076.00	19,378,800
松屋フーズホールディングス	800	6,770.00	5,416,000
サガミホールディングス	2,600	1,760.00	4,576,000
王将フードサービス	3,900	2,970.00	11,583,000
ミニストップ	1,300	1,707.00	2,219,100
アークス	3,100	2,482.00	7,694,200
バローホールディングス	3,300	2,080.00	6,864,000
ベルク	900	6,410.00	5,769,000
大庄	1,100	1,022.00	1,124,200
ファーストリテイリング	9,600	50,430.00	484,128,000

サンドラッグ	5,800	3,826.00	22,190,800	
サックスパー ホールディングス	1,500	898.00	1,347,000	
やまや	100	2,871.00	287,100	
ベルーナ	4,100	708.00	2,902,800	
いよぎんホールディングス	18,800	1,416.00	26,620,800	
しずおかフィナンシャルグループ	34,900	1,221.50	42,630,350	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	13,300	1,433.00	19,058,900	
楽天銀行	7,400	3,035.00	22,459,000	
京都フィナンシャルグループ	19,900	2,252.00	44,814,800	
じもとホールディングス	1,100	297.00	326,700	
めぶきフィナンシャルグループ	73,400	563.70	41,375,580	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	4,100.00	8,200,000	
九州フィナンシャルグループ	30,600	691.50	21,159,900	
ゆうちょ銀行	174,100	1,342.00	233,642,200	
富山第一銀行	5,000	1,045.00	5,225,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	84,300	744.00	62,719,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	8,800	1,656.00	14,572,800	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,636.00	2,290,400	
第四北越フィナンシャルグループ	5,000	2,410.00	12,050,000	
ひろぎんホールディングス	22,300	1,109.00	24,730,700	
おきなわフィナンシャルグループ	1,300	2,236.00	2,906,800	
十六フィナンシャルグループ	2,100	4,000.00	8,400,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,600	4,340.00	6,944,000	
プロクレアホールディングス	1,800	1,789.00	3,220,200	
あいちフィナンシャルグループ	3,300	2,244.00	7,405,200	
あおぞら銀行	11,400	2,558.50	29,166,900	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	965,000	1,562.00	1,507,330,000	代用有価証券 90,000株
りそなホールディングス	181,700	992.60	180,355,420	
三井住友トラストグループ	56,400	3,320.00	187,248,000	
三井住友フィナンシャルグループ	330,500	3,160.00	1,044,380,000	
千葉銀行	44,100	1,106.50	48,796,650	
群馬銀行	30,700	854.60	26,236,220	
武蔵野銀行	2,200	2,629.00	5,783,800	
千葉興業銀行	3,700	1,120.00	4,144,000	
筑波銀行	6,800	225.00	1,530,000	

七十七銀行	4,600	3,880.00	17,848,000	
秋田銀行	1,100	2,080.00	2,288,000	
山形銀行	1,800	978.00	1,760,400	
岩手銀行	1,000	2,286.00	2,286,000	
東邦銀行	12,400	259.00	3,211,600	
東北銀行	300	1,060.00	318,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	13,800	3,465.00	47,817,000	
スルガ銀行	11,900	1,081.00	12,863,900	
八十二銀行	34,000	824.90	28,046,600	
山梨中央銀行	1,800	1,619.00	2,914,200	
大垣共立銀行	3,000	1,820.00	5,460,000	
福井銀行	1,400	1,799.00	2,518,600	
清水銀行	600	1,440.00	864,000	
滋賀銀行	2,600	3,265.00	8,489,000	
南都銀行	2,400	2,989.00	7,173,600	
百五銀行	14,900	548.00	8,165,200	
紀陽銀行	5,700	1,792.00	10,214,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	9,700	1,590.00	15,423,000	
山陰合同銀行	9,800	1,218.00	11,936,400	
鳥取銀行	200	1,221.00	244,200	
百十四銀行	1,600	2,502.00	4,003,200	
四国銀行	2,300	941.00	2,164,300	
阿波銀行	2,200	2,415.00	5,313,000	
大分銀行	1,000	3,040.00	3,040,000	
宮崎銀行	1,000	2,662.00	2,662,000	
佐賀銀行	900	2,040.00	1,836,000	
琉球銀行	3,400	990.00	3,366,000	
セブン銀行	49,500	320.80	15,879,600	
みずほフィナンシャルグループ	213,900	3,115.00	666,298,500	
山口フィナンシャルグループ	15,500	1,492.50	23,133,750	
名古屋銀行	1,000	5,940.00	5,940,000	
北洋銀行	23,900	394.00	9,416,600	
大光銀行	200	1,286.00	257,200	
愛媛銀行	2,100	1,029.00	2,160,900	
トマト銀行	200	1,103.00	220,600	
京葉銀行	6,500	682.00	4,433,000	

栃木銀行	7,800	260.00	2,028,000	
北日本銀行	500	2,454.00	1,227,000	
東和銀行	2,900	574.00	1,664,600	
大東銀行	400	699.00	279,600	
トモニホールディングス	14,900	398.00	5,930,200	
フィデアホールディングス	1,600	1,427.00	2,283,200	
池田泉州ホールディングス	22,000	341.00	7,502,000	
F P G	5,700	2,334.00	13,303,800	
ジャパンインベストメントアドバイザー	2,600	1,022.00	2,657,200	
マーキュリアホールディングス	300	879.00	263,700	
S B I ホールディングス	25,500	3,316.00	84,558,000	
ジャフコ グループ	4,700	2,026.00	9,522,200	
大和証券グループ本社	122,700	1,006.50	123,497,550	
野村ホールディングス	266,500	783.70	208,856,050	
岡三証券グループ	13,800	608.00	8,390,400	
丸三証券	5,300	910.00	4,823,000	
東洋証券	4,300	508.00	2,184,400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,800	480.00	9,024,000	
水戸証券	4,300	448.00	1,926,400	
いちよし証券	3,000	672.00	2,016,000	
松井証券	7,700	786.00	6,052,200	
マネックスグループ	15,500	655.00	10,152,500	
極東証券	2,200	1,290.00	2,838,000	
岩井コスモホールディングス	1,800	1,971.00	3,547,800	
アイザワ証券グループ	2,300	1,701.00	3,912,300	
スパークス・グループ	1,700	1,368.00	2,325,600	
かんぽ生命保険	16,200	2,470.50	40,022,100	
F P パートナー	700	2,759.00	1,931,300	
S O M P O ホールディングス	71,500	3,222.00	230,373,000	
アニコム ホールディングス	5,300	666.00	3,529,800	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	106,400	3,390.00	360,696,000	
第一生命ホールディングス	74,500	3,754.00	279,673,000	
東京海上ホールディングス	154,700	5,521.00	854,098,700	
T & D ホールディングス	42,500	2,458.00	104,465,000	
アドバンスクリエイト	1,200	767.00	920,400	

NEXYZ. Group	400	784.00	313,600
全国保証	4,100	5,507.00	22,578,700
あんしん保証	1,300	170.00	221,000
ジェイリース	1,100	1,393.00	1,532,300
イントラスト	400	726.00	290,400
日本モーゲージサービス	700	416.00	291,200
SBIアルヒ	1,500	804.00	1,206,000
プレミアグループ	2,700	2,435.00	6,574,500
ネットプロテクションズホールディングス	5,300	334.00	1,770,200
クレディセゾン	10,000	3,419.00	34,190,000
芙蓉総合リース	1,500	10,755.00	16,132,500
みずほリース	13,100	997.00	13,060,700
東京センチュリー	11,800	1,559.00	18,396,200
日本証券金融	5,800	1,971.00	11,431,800
アイフル	23,100	315.00	7,276,500
リコーリース	1,500	4,900.00	7,350,000
イオンフィナンシャルサービス	9,000	1,210.00	10,890,000
アコム	28,200	354.40	9,994,080
ジャックス	1,700	3,780.00	6,426,000
オリエントコーポレーション	5,200	896.00	4,659,200
オリックス	95,000	3,233.00	307,135,000
三菱HCキャピタル	70,600	1,010.00	71,306,000
日本取引所グループ	81,700	1,806.50	147,591,050
イー・ギャランティ	2,600	1,504.00	3,910,400
NECキャピタルソリューション	800	3,750.00	3,000,000
大東建託	5,800	16,780.00	97,324,000
サムティホールディングス	3,100	3,290.00	10,199,000
いちご	16,000	410.00	6,560,000
日本駐車場開発	18,800	222.00	4,173,600
スター・マイカ・ホールディングス	1,700	659.00	1,120,300
SREホールディングス	700	3,865.00	2,705,500
ヒューリック	36,900	1,360.00	50,184,000
野村不動産ホールディングス	8,800	3,768.00	33,158,400
三重交通グループホールディングス	3,400	518.00	1,761,200
ディア・ライフ	2,700	823.00	2,222,100
コーセーアールイー	300	675.00	202,500

地主	1,400	2,115.00	2,961,000
プレサンスコーポレーション	2,100	1,869.00	3,924,900
THEグローバル社	400	610.00	244,000
JPMC	900	1,136.00	1,022,400
サンセイランディック	300	941.00	282,300
エストラスト	200	670.00	134,000
フージャースホールディングス	2,400	1,016.00	2,438,400
オープンハウスグループ	5,800	5,566.00	32,282,800
東急不動産ホールディングス	47,600	971.50	46,243,400
飯田グループホールディングス	15,200	2,152.00	32,710,400
イーグランド	100	1,349.00	134,900
ムゲンエステート	400	1,554.00	621,600
ビーロッド	300	1,140.00	342,000
ファーストブラザーズ	300	1,110.00	333,000
And Doホールディングス	1,100	1,034.00	1,137,400
シーアールイー	700	1,219.00	853,300
ケイアイスター不動産	800	3,915.00	3,132,000
アグレ都市デザイン	200	1,498.00	299,600
グッドコムアセット	1,300	896.00	1,164,800
ジェイ・エス・ビー	700	2,717.00	1,901,900
ロードスターキャピタル	900	2,322.00	2,089,800
イノベーションホールディングス	300	915.00	274,500
グローバル・リンク・マネジメント	100	2,234.00	223,400
霞ヶ関キャピタル	700	15,370.00	10,759,000
パーク24	12,300	1,864.50	22,933,350
パラカ	500	1,754.00	877,000
ミガロホールディングス	200	1,615.00	323,000
宮越ホールディングス	700	1,724.00	1,206,800
三井不動産	219,800	1,322.00	290,575,600
三菱地所	99,400	2,286.00	227,228,400
平和不動産	2,600	4,120.00	10,712,000
東京建物	13,800	2,499.00	34,486,200
京阪神ビルディング	3,000	1,604.00	4,812,000
住友不動産	22,900	4,602.00	105,385,800
テーオーシー	2,900	615.00	1,783,500
レオパレス21	15,800	552.00	8,721,600

スターツコーポレーション	2,300	3,540.00	8,142,000
フジ住宅	2,000	698.00	1,396,000
空港施設	2,300	574.00	1,320,200
明和地所	1,100	975.00	1,072,500
ゴールドクレスト	1,300	3,025.00	3,932,500
エスリード	700	4,585.00	3,209,500
日神グループホールディングス	2,500	498.00	1,245,000
日本エスコン	3,000	966.00	2,898,000
M I R A R T Hホールディングス	8,100	491.00	3,977,100
イオンモール	8,200	2,026.00	16,613,200
毎日コムネット	300	719.00	215,700
カチタス	4,300	1,925.00	8,277,500
トーセイ	2,600	2,357.00	6,128,200
サンフロンティア不動産	2,300	1,796.00	4,130,800
F J ネクストホールディングス	1,700	1,138.00	1,934,600
グランディハウス	1,800	554.00	997,200
日本空港ビルデング	5,600	5,418.00	30,340,800
明豊ファシリティワークス	300	847.00	254,100
M I X I	3,600	2,793.00	10,054,800
ジェイエシーリクルートメント	6,000	714.00	4,284,000
日本M&Aセンターホールディングス	26,400	594.10	15,684,240
中広	400	441.00	176,400
UTグループ	2,200	2,559.00	5,629,800
アイティメディア	600	1,600.00	960,000
ケアネット	3,400	674.00	2,291,600
E・Jホールディングス	1,000	1,703.00	1,703,000
オープンアップグループ	5,000	1,965.00	9,825,000
コンダカホールディングス	5,000	1,196.00	5,980,000
アルトナー	200	1,727.00	345,400
パソナグループ	2,000	2,064.00	4,128,000
C D S	200	1,755.00	351,000
リンクアンドモチベーション	4,100	572.00	2,345,200
エス・エム・エス	5,800	2,121.50	12,304,700
サニーサイドアップグループ	300	538.00	161,400
パーソルホールディングス	168,100	258.80	43,504,280
アイ・ケイ・ケイホールディングス	400	762.00	304,800

学情	900	1,747.00	1,572,300
スタジオアリス	800	2,030.00	1,624,000
エプロ	200	751.00	150,200
N J S	400	4,030.00	1,612,000
総合警備保障	27,600	1,058.50	29,214,600
カカクコム	10,700	2,335.50	24,989,850
アイロムグループ	700	2,779.00	1,945,300
セントケア・ホールディング	1,200	733.00	879,600
ルネサンス	1,300	1,055.00	1,371,500
ディップ	2,500	2,667.00	6,667,500
デジタルホールディングス	1,000	973.00	973,000
新日本科学	1,500	1,234.00	1,851,000
キャリアデザインセンター	200	1,775.00	355,000
エムスリー	32,700	1,705.00	55,753,500
ツカダ・グローバルホールディング	700	393.00	275,100
ウェルネット	500	692.00	346,000
ワールドホールディングス	600	1,910.00	1,146,000
ディー・エヌ・エー	5,900	1,802.00	10,631,800
博報堂DYホールディングス	21,000	1,223.00	25,683,000
ぐるなび	3,100	306.00	948,600
タカミヤ	2,300	442.00	1,016,600
ファンコミュニケーションズ	2,600	413.00	1,073,800
ライク	700	1,374.00	961,800
エスプール	5,300	355.00	1,881,500
WDBホールディングス	900	1,717.00	1,545,300
ティア	900	429.00	386,100
アドウェイズ	2,500	325.00	812,500
バリューコマース	1,500	1,114.00	1,671,000
インフォマート	15,600	363.00	5,662,800
J Pホールディングス	4,200	719.00	3,019,800
プレステージ・インターナショナル	7,700	677.00	5,212,900
プロトコーポレーション	1,700	1,418.00	2,410,600
アミューズ	1,000	1,365.00	1,365,000
ドリームインキュベータ	500	2,164.00	1,082,000
クイック	1,200	1,956.00	2,347,200
電通グループ	17,900	4,710.00	84,309,000

ぴあ	600	3,060.00	1,836,000	
イオンファンタジー	600	2,558.00	1,534,800	
シーティーエス	2,100	901.00	1,892,100	
H. U. グループホールディングス	4,900	2,612.00	12,798,800	
アルプス技研	1,400	2,779.00	3,890,600	
日本空調サービス	1,800	1,021.00	1,837,800	
オリエンタルランド	87,500	3,614.00	316,225,000	
ダスキン	3,600	3,999.00	14,396,400	
明光ネットワークジャパン	2,100	666.00	1,398,600	
ファルコホールディングス	700	2,361.00	1,652,700	
ラウンドワン	15,500	952.00	14,756,000	
リゾートトラスト	7,200	2,756.00	19,843,200	
ビー・エム・エル	2,000	2,738.00	5,476,000	
リソー教育	8,400	275.00	2,310,000	
早稲田アカデミー	900	1,641.00	1,476,900	
ユー・エス・エス	37,000	1,272.00	47,064,000	
東京個別指導学院	2,300	397.00	913,100	
サイバーエージェント	36,500	1,016.50	37,102,250	
楽天グループ	116,300	907.80	105,577,140	
クリーク・アンド・リバー社	800	1,599.00	1,279,200	
SBIグローバルアセットマネジメント	3,300	580.00	1,914,000	
テー・オー・ダブリュー	3,300	324.00	1,069,200	
山田コンサルティンググループ	700	2,055.00	1,438,500	
セントラルスポーツ	600	2,422.00	1,453,200	
フルキャストホールディングス	1,400	1,549.00	2,168,600	
エン・ジャパン	2,700	2,406.00	6,496,200	
リソルホールディングス	100	5,030.00	503,000	
テクノプロ・ホールディングス	9,600	2,714.50	26,059,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	1,100	855.00	940,500	
Keepers 技研	1,000	4,105.00	4,105,000	
楽待	300	698.00	209,400	
三機サービス	200	878.00	175,600	
Gunosy	1,500	714.00	1,071,000	
イー・ガーディアン	800	1,815.00	1,452,000	
リブセンス	1,000	164.00	164,000	
ジャパンマテリアル	5,100	1,817.00	9,266,700	

ベクトル	2,000	951.00	1,902,000
チャーム・ケア・コーポレーション	1,400	1,251.00	1,751,400
キャリアリンク	600	2,471.00	1,482,600
I B J	1,600	659.00	1,054,400
アサンテ	800	1,702.00	1,361,600
バリューHR	1,500	1,707.00	2,560,500
M&Aキャピタルパートナーズ	1,300	2,335.00	3,035,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	800	1,002.00	801,600
ER I ホールディングス	200	1,828.00	365,600
シグマクシス・ホールディングス	2,200	1,695.00	3,729,000
ウィルグループ	1,400	972.00	1,360,800
メドピア	1,600	560.00	896,000
レアジョブ	500	398.00	199,000
リクルートホールディングス	119,100	9,217.00	1,097,744,700
エラン	2,200	860.00	1,892,000
日本郵政	172,800	1,375.00	237,600,000
ベルシステム24ホールディングス	1,800	1,287.00	2,316,600
鎌倉新書	1,900	513.00	974,700
一蔵	300	512.00	153,600
エアトリ	1,200	1,021.00	1,225,200
ストライク	800	4,385.00	3,508,000
ソラスト	4,600	484.00	2,226,400
セラク	700	1,296.00	907,200
インソース	3,600	977.00	3,517,200
ベイカレント	12,200	4,950.00	60,390,000
Orchestra Holdings	500	836.00	418,000
アイモバイル	2,400	504.00	1,209,600
MS-Japan	900	1,028.00	925,200
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,400	2,926.00	15,800,400
グリーンズ	200	1,505.00	301,000
エル・ティール・エス	300	1,788.00	536,400
ミダックホールディングス	1,000	1,783.00	1,783,000
キュービーネットホールディングス	1,000	1,015.00	1,015,000
マネジメントソリューションズ	800	1,853.00	1,482,400
プロレド・パートナーズ	700	483.00	338,100

フロンティア・マネジメント	700	1,151.00	805,700
コプロ・ホールディングス	200	1,378.00	275,600
アンビスホールディングス	3,600	1,878.00	6,760,800
カーブスホールディングス	4,500	803.00	3,613,500
フォーラムエンジニアリング	2,300	874.00	2,010,200
Fast Fitness Japan	700	1,316.00	921,200
Macbee Planet	500	2,611.00	1,305,500
ポピンズ	500	1,389.00	694,500
LITALICO	1,300	1,197.00	1,556,100
コンフィデンス・インターワークス	100	1,692.00	169,200
アドバンテッジリスクマネジメント	700	567.00	396,900
リログループ	8,200	1,846.50	15,141,300
東祥	1,400	672.00	940,800
ID&Eホールディングス	1,000	4,395.00	4,395,000
ビーウィズ	400	1,551.00	620,400
サンウェルズ	600	1,744.00	1,046,400
TREホールディングス	3,200	1,788.00	5,721,600
人・夢・技術グループ	700	1,662.00	1,163,400
NISSOホールディングス	1,500	801.00	1,201,500
大栄環境	3,000	3,120.00	9,360,000
日本管財ホールディングス	1,700	2,630.00	4,471,000
M&A総研ホールディングス	1,800	2,754.00	4,957,200
エイチ・アイ・エス	5,300	1,688.00	8,946,400
ラックランド	800	1,936.00	1,548,800
共立メンテナンス	5,200	2,439.00	12,682,800
イチネンホールディングス	1,800	1,789.00	3,220,200
建設技術研究所	900	4,510.00	4,059,000
スペース	1,200	1,147.00	1,376,400
燦ホールディングス	1,500	1,107.00	1,660,500
スバル興業	600	3,100.00	1,860,000
ナガラ	500	6,620.00	3,310,000
東京都競馬	1,200	4,130.00	4,956,000
カナモト	2,600	2,754.00	7,160,400
ニシオホールディングス	1,400	3,730.00	5,222,000
トランス・コスモス	1,900	3,370.00	6,403,000
乃村工藝社	7,200	765.00	5,508,000

藤田観光	700	8,560.00	5,992,000	
KNT-CTホールディングス	1,000	1,260.00	1,260,000	
トーカイ	1,500	2,217.00	3,325,500	
白洋舎	100	2,331.00	233,100	
セコム	33,700	5,404.00	182,114,800	
セントラル警備保障	900	2,731.00	2,457,900	
丹青社	3,200	813.00	2,601,600	
メイテックグループホールディングス	5,700	3,086.00	17,590,200	
応用地質	1,600	2,545.00	4,072,000	
船井総研ホールディングス	3,300	2,396.00	7,906,800	
オオバ	400	1,008.00	403,200	
学究社	600	1,906.00	1,143,600	
イオンディライト	1,800	4,315.00	7,767,000	
ナック	1,700	559.00	950,300	
ダイセキ	3,400	3,965.00	13,481,000	
ステップ	600	2,018.00	1,210,800	
合 計	29,824,500		60,171,635,490	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
預金	286,898,610	196,781,854
コール・ローン	3,860,179,962	5,409,605,502
株式	292,245,103,382	438,182,602,948
投資証券	5,687,435,505	8,771,913,614
派生商品評価勘定	59,273,744	274,493,130
未収入金	81,153,485	9,718
未収配当金	214,263,884	252,361,121
未収利息	-	34,698
差入委託証拠金	414,214,306	815,107,993
流動資産合計	302,848,522,878	453,902,910,578
資産合計	302,848,522,878	453,902,910,578
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	83,210,703	6,259,956
未払解約金	1,877,026,677	2,845,585,499
未払利息	1,375	-
流動負債合計	1,960,238,755	2,851,845,455
負債合計	1,960,238,755	2,851,845,455
純資産の部		
元本等		
元本	60,617,205,489	64,836,376,772
剰余金		
剰余金又は欠損金(△)	240,271,078,634	386,214,688,351
元本等合計	300,888,284,123	451,051,065,123
純資産合計	300,888,284,123	451,051,065,123
負債純資産合計	302,848,522,878	453,902,910,578

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

(貸借対照表に関する注記)

		2023 年 10 月 26 日現在	2024 年 10 月 28 日現在
1.	期首	2022 年 10 月 27 日	2023 年 10 月 27 日
	期首元本額	58,419,890,528 円	60,617,205,489 円
	期首からの追加設定元本額	10,020,807,446 円	10,662,451,336 円
	期首からの一部解約元本額	7,823,492,485 円	6,443,280,053 円
	元本の内訳 ※		
	インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC 専用）	33,033,504,086 円	36,022,586,256 円
	DC インデックスバランス（株式 20）	113,435,960 円	100,356,958 円
	DC インデックスバランス（株式 40）	313,862,875 円	290,891,069 円
	DC インデックスバランス（株式 60）	674,344,956 円	650,033,342 円
	DC インデックスバランス（株式 80）	811,294,314 円	835,188,038 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	1,254,888,146 円	969,197,889 円
	日興五大陸株式ファンド	3,477,499,117 円	3,418,980,544 円
	インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）	13,258,596 円	— 円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	75,144,450 円	62,045,402 円
	インデックスファンド先進国株式（適格機関投資家向け）	5,869,865,622 円	5,592,442,193 円
	グローバル 3 倍 3 分法ファンド（適格機関投資家向け）	8,685,455,095 円	6,883,396,555 円
	Tracers グローバル 3 分法（おとなのバランス）	7,448,649 円	19,839,881 円
	インデックスファンドMSCI オール・カンントリー（全世界株式）	233,610,327 円	4,097,981,363 円
	Tracers MSCI オール・カンントリー・インデックス（全世界株式）	300,017,123 円	613,069,842 円
	Ni つみインデックスラップ世界 10 指数（均等型）	263,039 円	574,085 円
	Ni つみインデックスラップ世界 10 指数（安定成長型）	148,330 円	240,690 円

国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,338,394,962円	968,780,337円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	15,811,296円	12,378,193円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	46,137,440円	39,937,025円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	73,311,676円	64,723,731円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	73,782,515円	68,162,879円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,205,726,915円	4,125,570,500円
計	60,617,205,489円	64,836,376,772円
2. 受益権の総数	60,617,205,489口	64,836,376,772口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

	自 2022年10月27日 至 2023年10月26日	自 2023年10月27日 至 2024年10月28日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等による場合、当該価額が異なる	同左

	ることもあります。	
--	-----------	--

(有価証券に関する注記)

(2023年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	20,078,428,575
投資証券	△670,055,296
合計	19,408,373,279

(2024年10月28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	104,829,778,640
投資証券	2,117,399,462
合計	106,947,178,102

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2023年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,105,221,913	—	3,022,281,000	△82,940,913
合計		3,105,221,913	—	3,022,281,000	△82,940,913

(2024年10月28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	4,123,723,947	—	4,178,121,320	54,397,373
合計		4,123,723,947	—	4,178,121,320	54,397,373

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(2023年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,398,406,226	—	2,456,192,930	57,786,704
	米ドル	2,007,327,400	—	2,061,665,290	54,337,890
	ユーロ	391,078,826	—	394,527,640	3,448,814
	売建	86,125,500	—	84,908,250	1,217,250
	豪ドル	86,125,500	—	84,908,250	1,217,250
合計		2,484,531,726	—	2,541,101,180	59,003,954

(2024年10月28日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,272,090,160	—	3,488,457,135	216,366,975
	米ドル	2,795,176,030	—	2,993,232,360	198,056,330
	ユーロ	476,914,130	—	495,224,775	18,310,645
	売建	313,261,958	—	315,793,132	△2,531,174
	米ドル	228,120,000	—	230,145,000	△2,025,000
	ユーロ	72,432,968	—	72,879,532	△446,564
	豪ドル	12,708,990	—	12,768,600	△59,610
合計		3,585,352,118	—	3,804,250,267	213,835,801

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づ

いて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年10月26日現在		2024年10月28日現在	
1口当たり純資産額	4,9637円	1口当たり純資産額	6,9568円
(1万口当たり純資産額)	(49,637円)	(1万口当たり純資産額)	(69,568円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	APA CORP	18,890	24.82	468,849.80	
	BAKER HUGHES CO	47,175	37.52	1,770,006.00	
	CHENIERE ENERGY INC	9,880	184.93	1,827,108.40	
	CHEVRON CORP	77,801	150.81	11,733,168.81	
	CHORD ENERGY CORP	2,600	128.85	335,010.00	
	CONOCOPHILLIPS	51,626	104.56	5,398,014.56	
	COTERRA ENERGY INC	32,460	23.85	774,171.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	25,260	39.19	989,939.40	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	7,580	184.38	1,397,600.40	
	EOG RESOURCES INC	26,282	123.17	3,237,153.94	
	EQT CORP	23,250	37.48	871,410.00	
	EXPAND ENERGY CORP	8,220	84.79	696,973.80	
	EXXON MOBIL CORP	198,509	119.49	23,719,840.41	
	HALLIBURTON CO	37,607	28.25	1,062,397.75	
	HESS CORP	12,700	138.02	1,752,854.00	
	HF SINCLAIR CORP	5,940	43.01	255,479.40	
	KINDER MORGAN INC	91,790	24.95	2,290,160.50	
	MARATHON OIL CORP	28,380	26.46	750,934.80	
	MARATHON PETROLEUM CORP	15,742	152.36	2,398,451.12	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	28,351	51.58	1,462,344.58	
ONEOK INC	26,380	96.66	2,549,890.80		
OVINTIV INC	13,280	40.39	536,379.20		
PHILLIPS 66	18,855	128.17	2,416,645.35		

SCHLUMBERGER LTD	60,961	41.74	2,544,512.14
TARGA RESOURCES CORP	9,510	165.96	1,578,279.60
TEXAS PACIFIC LAND CORP	735	1,098.01	807,037.35
VALERO ENERGY CORP	14,682	132.40	1,943,896.80
WILLIAMS COS INC	55,354	52.50	2,906,085.00
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	10,125	318.02	3,219,952.50
ALBEMARLE CORP	4,750	93.51	444,172.50
AMCOR PLC	65,600	11.00	721,600.00
AVERY DENNISON CORP	3,040	207.16	629,766.40
BALL CORP	14,380	64.03	920,751.40
CELANESE CORP	4,090	128.87	527,078.30
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,820	83.19	650,545.80
CORTEVA INC	29,832	60.35	1,800,361.20
CRH PLC	29,300	92.39	2,707,027.00
CROWN HOLDINGS INC	6,535	93.70	612,329.50
DOW INC	31,205	49.70	1,550,888.50
DUPONT DE NEMOURS INC	19,162	83.30	1,596,194.60
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,815	105.43	507,645.45
ECOLAB INC	11,060	253.49	2,803,599.40
FREEMONT-MCMORAN INC	61,328	46.60	2,857,884.80
INTERNATIONAL PAPER CO	13,670	48.57	663,951.90
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,755	101.45	1,192,544.75
LINDE PLC	21,260	473.76	10,072,137.60
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,860	87.50	1,125,250.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,720	570.21	1,550,971.20
MOSAIC CO/THE	13,580	26.94	365,845.20
NEWMONT CORP	49,002	48.42	2,372,676.84
NUCOR CORP	9,959	141.47	1,408,899.73
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	225.86	808,578.80
PPG INDUSTRIES INC	10,334	126.45	1,306,734.30
RELIANCE INC	2,770	283.54	785,405.80
RPM INTERNATIONAL INC	4,960	128.45	637,112.00
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,626	359.04	3,815,159.04
SMURFIT WESTROCK PLC	22,989	45.84	1,053,815.76
STEEL DYNAMICS INC	7,090	129.58	918,722.20
VULCAN MATERIALS CO	5,563	256.54	1,427,132.02

WESTLAKE CORP	1,360	132.73	180,512.80
3M CO	23,576	124.75	2,941,106.00
AECOM	7,170	104.49	749,193.30
AERCAP HOLDINGS NV	9,760	95.42	931,299.20
ALLEGION PLC	3,340	142.60	476,284.00
AMETEK INC	10,233	166.96	1,708,501.68
AXON ENTERPRISE INC	3,320	444.52	1,475,806.40
BOEING CO/THE	26,012	155.01	4,032,120.12
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	5,240	180.80	947,392.00
CARLISLE COS INC	2,250	417.20	938,700.00
CARRIER GLOBAL CORP	37,428	73.72	2,759,192.16
CATERPILLAR INC	21,646	385.97	8,354,706.62
CNH INDUSTRIAL NV	40,400	11.20	452,480.00
CUMMINS INC	6,355	329.17	2,091,875.35
DEERE & CO	11,625	407.93	4,742,186.25
DOVER CORP	6,680	186.98	1,249,026.40
EATON CORP PLC	17,676	344.49	6,089,205.24
EMCOR GROUP INC	2,010	428.58	861,445.80
EMERSON ELECTRIC CO	24,700	108.13	2,670,811.00
FASTENAL CO	24,326	75.85	1,845,127.10
FERGUSON ENTERPRISES INC	8,440	196.23	1,656,181.20
FORTIVE CORP	14,854	74.97	1,113,604.38
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	5,050	85.49	431,724.50
GE VERNOVA INC	11,966	293.54	3,512,499.64
GENERAL DYNAMICS CORP	10,277	302.52	3,108,998.04
GENERAL ELECTRIC CO	48,197	179.10	8,632,082.70
GRACO INC	8,120	82.14	666,976.80
HEICO CORP	1,800	253.80	456,840.00
HEICO CORP-CLASS A	3,120	197.70	616,824.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	29,006	208.00	6,033,248.00
HOWMET AEROSPACE INC	17,943	101.39	1,819,240.77
HUBBELL INC	2,320	444.52	1,031,286.40
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,530	253.83	388,359.90
IDEX CORP	3,640	202.82	738,264.80
ILLINOIS TOOL WORKS	12,835	254.08	3,261,116.80
INGERSOLL-RAND INC	16,398	96.12	1,576,175.76

JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,570	37.05	243,418.50
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	29,834	76.74	2,289,461.16
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	8,570	252.81	2,166,581.70
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,385	609.18	843,714.30
LOCKHEED MARTIN CORP	9,486	562.29	5,333,882.94
MASCO CORP	9,849	81.26	800,329.74
NORDSON CORP	2,345	248.10	581,794.50
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,154	519.35	3,196,079.90
OTIS WORLDWIDE CORP	17,124	101.26	1,733,976.24
OWENS CORNING	3,550	181.90	645,745.00
PACCAR INC	21,896	105.90	2,318,786.40
PARKER HANNIFIN CORP	5,775	621.74	3,590,548.50
PENTAIR PLC	6,918	98.96	684,605.28
QUANTA SERVICES INC	6,700	308.17	2,064,739.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,178	269.86	1,397,335.08
RTX CORP	58,476	125.16	7,318,856.16
SMITH (A. O.) CORP	5,020	76.87	385,887.40
SNAP-ON INC	2,525	326.58	824,614.50
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,226	101.98	736,907.48
TEXTRON INC	7,956	82.35	655,176.60
TORO CO	4,950	81.70	404,415.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	10,066	392.57	3,951,609.62
TRANSDIGM GROUP INC	2,560	1,354.83	3,468,364.80
UNITED RENTALS INC	3,005	812.50	2,441,562.50
VERTIV HOLDINGS CO	16,260	112.17	1,823,884.20
WABTEC CORP	8,150	188.76	1,538,394.00
WATSCO INC	1,540	475.90	732,886.00
WW GRAINGER INC	1,847	1,090.94	2,014,966.18
XYLEM INC	10,898	130.42	1,421,317.16
AUTOMATIC DATA PROCESSING	18,051	287.96	5,197,965.96
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,910	181.93	1,075,206.30
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	5,230	214.03	1,119,376.90
CINTAS CORP	15,528	207.41	3,220,662.48
COPART INC	37,560	51.71	1,942,227.60
DAYFORCE INC	7,010	64.84	454,528.40
EQUIFAX INC	5,024	269.89	1,355,927.36

JACOBS SOLUTIONS INC	6,200	140.52	871,224.00
LEIDOS HOLDINGS INC	5,950	168.71	1,003,824.50
PAYCHEX INC	14,002	140.33	1,964,900.66
PAYCOM SOFTWARE INC	2,765	164.63	455,201.95
REPUBLIC SERVICES INC	9,560	199.83	1,910,374.80
ROLLINS INC	14,385	46.54	669,477.90
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	70.04	593,238.80
TRANSUNION	7,940	103.59	822,504.60
VERALTO CORP	11,363	104.05	1,182,320.15
VERISK ANALYTICS INC	6,310	264.65	1,669,941.50
WASTE CONNECTIONS INC	11,916	175.80	2,094,832.80
WASTE MANAGEMENT INC	17,874	206.80	3,696,343.20
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,930	108.12	533,031.60
CSX CORP	84,959	33.27	2,826,585.93
DELTA AIR LINES INC	8,345	54.12	451,631.40
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,467	119.84	775,005.28
FEDEX CORP	10,298	272.12	2,802,291.76
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	77,000	4.07	313,390.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,750	174.83	655,612.50
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,140	52.55	322,657.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,745	251.09	2,446,872.05
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,450	197.79	1,671,325.50
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	29.43	160,982.10
U-HAUL HOLDING CO	3,375	65.56	221,265.00
UBER TECHNOLOGIES INC	83,530	77.62	6,483,598.60
UNION PACIFIC CORP	26,946	230.30	6,205,663.80
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	32,557	137.43	4,474,308.51
APTIV PLC	12,290	69.31	851,819.90
FORD MOTOR COMPANY	177,905	11.07	1,969,408.35
GENERAL MOTORS CORP	52,355	52.07	2,726,124.85
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	39,110	10.45	408,699.50
TESLA INC	126,915	269.19	34,164,248.85
DECKERS OUTDOOR CORP	7,320	168.11	1,230,565.20
DR HORTON INC	12,896	179.24	2,311,479.04
GARMIN LTD	7,025	162.30	1,140,157.50
LENNAR CORP-CL A	10,040	173.28	1,739,731.20

LULULEMON ATHLETICA INC	5,360	304.15	1,630,244.00
NIKE INC -CL B	54,038	78.85	4,260,896.30
NVR INC	148	9,329.74	1,380,801.52
PULTE GROUP INC	8,850	132.47	1,172,359.50
AIRBNB INC-CLASS A	18,550	134.58	2,496,459.00
BOOKING HOLDINGS INC	1,498	4,347.82	6,513,034.36
CARNIVAL CORP	43,817	20.91	916,213.47
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	60,100	59.44	3,572,344.00
DARDEN RESTAURANTS INC	4,853	159.92	776,091.76
DOMINO'S PIZZA INC	1,375	413.81	568,988.75
DOORDASH INC - A	12,760	153.88	1,963,508.80
DRAFTKINGS INC-CL A	20,420	36.47	744,717.40
EXPEDIA GROUP INC	6,032	158.39	955,408.48
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	7,820	224.92	1,758,874.40
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,650	236.11	2,514,571.50
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,680	154.56	259,660.80
LAS VEGAS SANDS CORP	16,310	52.76	860,515.60
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,673	262.12	2,797,606.76
MCDONALD'S CORP	31,791	292.61	9,302,364.51
MGM RESORTS INTERNATIONAL	12,900	40.36	520,644.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,018	200.91	2,213,626.38
STARBUCKS CORP	50,054	97.31	4,870,754.74
WYNN RESORTS LTD	4,180	97.99	409,598.20
YUM! BRANDS INC	13,354	133.04	1,776,616.16
ALPHABET INC-CL A	259,790	165.27	42,935,493.30
ALPHABET INC-CL C	223,110	166.99	37,257,138.90
CHARTER COMMUNICATION-A	4,316	336.00	1,450,176.00
COMCAST CORP-CLASS A	173,804	41.66	7,240,674.64
ELECTRONIC ARTS INC	10,834	145.20	1,573,096.80
FOX CORP - CLASS A	13,084	41.71	545,733.64
FOX CORP- CLASS B	5,466	38.35	209,621.10
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,096	29.80	449,860.80
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	10,280	79.15	813,662.00
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,420	116.32	746,774.40
MATCH GROUP INC	10,912	37.21	406,035.52
META PLATFORMS INC-CLASS A	96,790	573.25	55,484,867.50

NETFLIX INC	19,065	754.68	14,387,974.20
NEWS CORP - CLASS A	14,750	25.99	383,352.50
OMNICOM GROUP	9,397	100.52	944,586.44
PARAMOUNT GLOBAL	22,823	10.27	234,392.21
PINTEREST INC- CLASS A	27,330	32.35	884,125.50
ROBLOX CORP -CLASS A	21,110	42.14	889,575.40
ROKU INC	6,620	75.27	498,287.40
SEA LTD-ADR	16,470	99.15	1,633,000.50
SNAP INC - A	45,300	10.45	473,385.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,240	161.79	1,171,359.60
THE WALT DISNEY CO.	81,122	95.03	7,709,023.66
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	19,370	119.47	2,314,133.90
WARNER BROS DISCOVERY INC	94,890	7.60	721,164.00
AMAZON.COM INC	413,920	187.83	77,746,593.60
AUTOZONE INC	722	3,130.96	2,260,553.12
BATH & BODY WORKS INC	9,270	30.38	281,622.60
BEST BUY CO INC	7,814	92.68	724,201.52
BURLINGTON STORES INC	2,935	251.65	738,592.75
CARMAX INC	8,089	72.00	582,408.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,600	204.37	531,362.00
EBAY INC	21,897	63.10	1,381,700.70
GENUINE PARTS CO	5,751	114.24	656,994.24
GLOBAL-E ONLINE LTD	5,190	37.95	196,960.50
HOME DEPOT INC	43,925	398.91	17,522,121.75
LKQ CORP	10,260	37.55	385,263.00
LOWE'S COS INC	25,272	267.64	6,763,798.08
MERCADOLIBRE INC	2,020	2,047.35	4,135,647.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,610	1,195.22	3,119,524.20
POOL CORP	1,540	366.00	563,640.00
ROSS STORES INC	14,742	144.22	2,126,091.24
TJX COMPANIES INC	50,336	113.82	5,729,243.52
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,530	272.77	1,235,648.10
ULTA BEAUTY INC	2,100	373.30	783,930.00
WILLIAMS-SONOMA INC	6,000	134.76	808,560.00
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	17,570	18.41	323,463.70
COSTCO WHOLESALE CORP	19,584	891.22	17,453,652.48

DOLLAR GENERAL CORP	9,855	80.38	792,144.90
DOLLAR TREE INC	8,986	66.45	597,119.70
KROGER CO	30,580	57.37	1,754,374.60
SYSCO CORP	20,636	73.92	1,525,413.12
TARGET CORP	19,870	151.16	3,003,549.20
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	30,782	9.26	285,041.32
WALMART INC	195,256	82.51	16,110,572.56
ALTRIA GROUP INC	76,018	49.71	3,778,854.78
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,143	56.56	1,252,408.08
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	10,590	48.37	512,238.30
BUNGE GLOBAL SA	5,847	89.78	524,943.66
CAMPBELL SOUP CO	7,885	47.07	371,146.95
CELSIUS HOLDINGS INC	6,050	31.66	191,543.00
COCA-COLA CO/THE	180,712	66.92	12,093,247.04
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	10,150	77.98	791,497.00
CONAGRA BRANDS INC	20,640	29.43	607,435.20
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,870	239.38	1,644,540.60
GENERAL MILLS INC	25,189	68.30	1,720,408.70
HERSHEY CO/THE	6,245	181.26	1,131,968.70
HORMEL FOODS CORP	15,290	31.06	474,907.40
JM SMUCKER CO/THE	4,100	116.07	475,887.00
KELLANOVA	11,098	80.88	897,606.24
KEURIG DR PEPPER INC	46,480	34.58	1,607,278.40
KRAFT HEINZ CO/THE	38,121	34.74	1,324,323.54
LAMB WESTON HOLDING INC	6,150	76.92	473,058.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,420	77.86	811,301.20
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,570	55.77	422,178.90
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	59,855	69.23	4,143,761.65
MONSTER BEVERAGE CORP	31,880	53.37	1,701,435.60
PEPSICO INC	61,051	171.79	10,487,951.29
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	68,418	129.86	8,884,761.48
TYSON FOODS INC-CL A	12,336	58.67	723,753.12
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,310	100.84	1,039,660.40
CLOROX COMPANY	5,266	156.69	825,129.54
COLGATE-PALMOLIVE CO	34,820	95.61	3,329,140.20
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	10,080	87.25	879,480.00

KENVUE INC	89,200	22.64	2,019,488.00
KIMBERLY-CLARK CORP	14,753	135.52	1,999,326.56
PROCTER & GAMBLE CO	104,529	168.22	17,583,868.38
ABBOTT LABORATORIES	77,176	114.22	8,815,042.72
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,060	219.30	671,058.00
BAXTER INTERNATIONAL INC	23,599	35.97	848,856.03
BECTON DICKINSON AND CO	12,277	238.13	2,923,522.01
BOSTON SCIENTIFIC CORP	65,518	84.73	5,551,340.14
CARDINAL HEALTH INC	10,305	110.89	1,142,721.45
CENCORA INC	8,304	234.47	1,947,038.88
CENTENE CORP	22,367	64.22	1,436,408.74
CIGNA GROUP/THE	12,530	316.85	3,970,130.50
COOPER COS INC/THE	9,240	107.82	996,256.80
CVS HEALTH CORP	54,808	56.49	3,096,103.92
DAVITA INC	2,108	156.99	330,934.92
DEXCOM INC	16,520	73.44	1,213,228.80
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	26,110	69.38	1,811,511.80
ELEVANCE HEALTH INC	10,326	425.27	4,391,338.02
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	19,125	88.42	1,691,032.50
HCA HEALTHCARE INC	8,580	363.55	3,119,259.00
HENRY SCHEIN INC	5,280	70.00	369,600.00
HOLOGIC INC	9,858	80.83	796,822.14
HUMANA INC	5,055	260.73	1,317,990.15
IDEXX LABORATORIES INC	3,720	451.41	1,679,245.20
INSULET CORP	2,745	233.63	641,314.35
INTUITIVE SURGICAL INC	15,745	511.27	8,049,946.15
LABCORP HOLDINGS INC	4,005	228.63	915,663.15
MCKESSON CORP	5,929	507.41	3,008,433.89
MEDTRONIC PLC	58,348	90.59	5,285,745.32
MOLINA HEALTHCARE INC	2,655	325.54	864,308.70
QUEST DIAGNOSTICS	5,276	155.04	817,991.04
RESMED INC	6,510	256.07	1,667,015.70
SOLVENTUM CORP	5,894	73.19	431,381.86
STERIS PLC	4,240	224.12	950,268.80
STRYKER CORP	15,243	352.82	5,378,035.26
TELEFLEX INC	2,290	233.63	535,012.70

UNITEDHEALTH GROUP INC	40,650	564.56	22,949,364.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,720	202.75	551,480.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	6,870	212.23	1,458,020.10
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,902	102.35	1,013,469.70
ABBVIE INC	77,866	187.85	14,627,128.10
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,750	130.19	1,659,922.50
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,760	284.86	1,640,793.60
AMGEN INC	23,641	316.98	7,493,724.18
AVANTOR INC	27,110	22.43	608,077.30
BIO-RAD LABORATORIES-A	950	320.23	304,218.50
BIO-TECHNE CORP	6,730	68.68	462,216.40
BIOGEN INC	6,663	181.69	1,210,600.47
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,380	69.73	584,337.40
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	90,215	51.92	4,683,962.80
CATALENT INC	7,860	59.09	464,447.40
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,420	182.12	440,730.40
DANAHER CORP	29,569	245.39	7,255,936.91
ELI LILLY & CO	35,659	892.70	31,832,789.30
EXACT SCIENCES CORP	7,370	69.11	509,340.70
GILEAD SCIENCES INC	55,584	89.00	4,946,976.00
ILLUMINA INC	6,855	141.95	973,067.25
INCYTE CORP	7,670	65.07	499,086.90
IQVIA HOLDINGS INC	8,208	214.63	1,761,683.04
JOHNSON & JOHNSON	106,491	160.88	17,132,272.08
MERCK & CO. INC.	112,083	103.98	11,654,390.34
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	965	1,292.77	1,247,523.05
MODERNA INC	14,425	53.09	765,823.25
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,120	116.08	478,249.60
PFIZER INC	251,520	28.45	7,155,744.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,815	933.02	4,492,491.30
REVVITY INC	4,910	116.33	571,180.30
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,800	26.95	506,660.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	49,020	17.90	877,458.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	16,929	554.38	9,385,099.02
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,900	348.65	662,435.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,465	477.70	5,476,830.50

VIATRIS INC	53,899	11.44	616,604.56
WATERS CORP	2,661	324.55	863,627.55
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,550	307.92	1,093,116.00
ZOETIS INC	20,385	180.01	3,669,503.85
BANK OF AMERICA CORP	311,349	41.89	13,042,409.61
CITIGROUP INC	85,007	61.76	5,250,032.32
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,310	41.51	801,558.10
FIFTH THIRD BANCORP	29,319	43.22	1,267,167.18
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	450	1,881.83	846,823.50
HUNTINGTON BANCSHARES INC	68,620	15.38	1,055,375.60
JPMORGAN CHASE & CO	126,780	222.31	28,184,461.80
KEYCORP	36,108	17.04	615,280.32
M & T BANK CORP	8,063	192.57	1,552,691.91
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	17,950	185.82	3,335,469.00
REGIONS FINANCIAL CORP	40,884	23.50	960,774.00
TRUIST FINANCIAL CORP	61,350	42.63	2,615,350.50
US BANCORP	70,761	47.74	3,378,130.14
WELLS FARGO & CO	154,290	64.53	9,956,333.70
ALLY FINANCIAL INC	12,240	34.42	421,300.80
AMERICAN EXPRESS CO	25,434	267.35	6,799,779.90
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,225	504.48	2,131,428.00
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	16,940	143.09	2,423,944.60
ARES MANAGEMENT CORP-A	8,510	169.47	1,442,189.70
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	32,742	75.20	2,462,198.40
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	58,535	454.01	26,575,475.35
BLACKROCK INC	6,620	974.07	6,448,343.40
BLACKSTONE INC	31,620	167.50	5,296,350.00
BLOCK INC	25,180	72.61	1,828,319.80
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,385	161.27	2,803,678.95
CARLYLE GROUP INC/THE	12,810	50.22	643,318.20
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,570	212.82	972,587.40
CME GROUP INC	15,350	226.14	3,471,249.00
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	8,570	205.04	1,757,192.80
COREBRIDGE FINANCIAL INC	12,150	31.55	383,332.50
CORPAY INC	2,880	340.72	981,273.60
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,750	148.90	1,600,675.00

EQUITABLE HOLDINGS INC	14,420	44.97	648,467.40
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,590	454.94	723,354.60
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	26,148	89.72	2,345,998.56
FISERV INC	25,854	199.52	5,158,390.08
FRANKLIN RESOURCES INC	11,755	20.37	239,449.35
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	92.58	231,450.00
GLOBAL PAYMENTS INC	10,989	99.13	1,089,339.57
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,193	512.60	7,275,331.80
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	25,540	165.31	4,222,017.40
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,200	182.44	583,808.00
KKR & CO INC -A	27,920	139.88	3,905,449.60
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,185	260.93	831,062.05
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,545	286.45	442,565.25
MASTERCARD INC - A	36,610	507.36	18,574,449.60
MOODY'S CORP	7,072	462.80	3,272,921.60
MORGAN STANLEY	54,193	116.88	6,334,077.84
MSCI INC	3,715	588.72	2,187,094.80
NASDAQ INC	19,695	74.69	1,471,019.55
NORTHERN TRUST CORP	9,930	100.19	994,886.70
PAYPAL HOLDINGS INC	42,267	81.70	3,453,213.90
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,470	144.91	1,227,387.70
ROBINHOOD MARKETS INC - A	23,380	27.06	632,662.80
S&P GLOBAL INC	14,215	490.61	6,974,021.15
SCHWAB (CHARLES) CORP	67,403	71.82	4,840,883.46
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,375	75.10	328,562.50
STATE STREET CORP	12,947	90.38	1,170,149.86
SYNCHRONY FINANCIAL	19,010	55.15	1,048,401.50
T ROWE PRICE GROUP INC	10,315	111.33	1,148,368.95
TOAST INC-CLASS A	18,170	29.49	535,833.30
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,200	132.50	556,500.00
VISA INC-CLASS A SHARES	69,752	281.73	19,651,230.96
AFLAC INC	23,424	109.75	2,570,784.00
ALLSTATE CORP	11,983	188.12	2,254,241.96
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,660	129.41	344,230.60
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	30,345	76.82	2,331,102.90
AON PLC	8,567	375.44	3,216,394.48

ARCH CAPITAL GROUP LTD	16,205	105.30	1,706,386.50
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,950	282.97	2,815,551.50
ASSURANT INC	2,470	191.77	473,671.90
BROWN & BROWN INC	10,940	103.98	1,137,541.20
CHUBB LTD	16,995	287.99	4,894,390.05
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,350	141.25	1,038,187.50
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,090	444.02	483,981.80
EVEREST GROUP LTD	1,989	379.61	755,044.29
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	11,071	59.96	663,817.16
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,382	112.26	1,390,003.32
LOEWS CORP	9,765	79.57	777,001.05
MARKEL GROUP INC	530	1,549.80	821,394.00
MARSH & MCLENNAN COS	21,888	221.31	4,844,033.28
METLIFE INC	26,335	82.39	2,169,740.65
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,520	83.71	796,919.20
PROGRESSIVE CORP	25,750	243.78	6,277,335.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,962	123.46	1,847,208.52
TRAVELERS COS INC/THE	10,189	250.50	2,552,344.50
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,848	290.45	1,408,101.60
WR BERKLEY CORP	12,136	58.16	705,829.76
ACCENTURE PLC-CL A	27,723	360.80	10,002,458.40
ADOBE INC	19,589	483.72	9,475,591.08
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,030	101.97	614,879.10
ANSYS INC	3,935	322.81	1,270,257.35
APPROVIN CORP-CLASS A	9,200	161.63	1,486,996.00
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,300	236.77	307,801.00
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	6,850	188.73	1,292,800.50
AUTODESK INC	9,390	286.04	2,685,915.60
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	9,480	49.15	465,942.00
CADENCE DESIGN SYS INC	11,820	257.30	3,041,286.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,840	207.16	795,494.40
CLOUDFLARE INC-CLASS A	13,050	88.76	1,158,318.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	21,758	74.82	1,627,933.56
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,980	300.62	3,000,187.60
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,920	290.04	556,876.80
DATADOG INC-CLASS A	11,930	126.60	1,510,338.00

DOCUSIGN INC	8,320	68.99	573,996.80
DYNATRACE INC	12,980	54.07	701,828.60
EPAM SYSTEMS INC	2,500	191.52	478,800.00
FAIR ISAAC CORP	1,120	1,999.97	2,239,966.40
FORTINET INC	28,035	80.34	2,252,331.90
GARTNER INC	3,490	513.36	1,791,626.40
GEN DIGITAL INC	24,365	26.97	657,124.05
GODADDY INC-CLASS A	6,020	160.53	966,390.60
HUBSPOT INC	2,075	565.67	1,173,765.25
INTL BUSINESS MACHINES CORP	40,692	214.67	8,735,351.64
INTUIT INC	12,401	609.27	7,555,557.27
MANHATTAN ASSOCIATES INC	3,220	275.70	887,754.00
MICROSOFT CORP	311,884	428.15	133,533,134.60
MICROSTRATEGY INC-CL A	7,160	234.34	1,677,874.40
MONDAY.COM LTD	1,970	299.61	590,231.70
MONGODB INC	3,420	268.74	919,090.80
OKTA INC	7,610	72.24	549,746.40
ORACLE CORP	72,973	173.52	12,662,274.96
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	90,090	44.86	4,041,437.40
PALO ALTO NETWORKS INC	14,395	366.44	5,274,903.80
PTC INC	5,250	187.01	981,802.50
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,990	542.00	2,704,580.00
SALESFORCE INC	42,956	290.46	12,476,999.76
SAMSARA INC-CL A	9,840	47.69	469,269.60
SERVICENOW INC	9,040	950.85	8,595,684.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	13,900	116.04	1,612,956.00
SYNOPSYS INC	6,732	501.58	3,376,636.56
TWILIO INC - A	7,225	70.47	509,145.75
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,830	605.86	1,108,723.80
VERISIGN INC	4,530	181.26	821,107.80
WIX.COM LTD	2,280	164.27	374,535.60
WORKDAY INC-CLASS A	9,170	237.71	2,179,800.70
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	12,150	72.63	882,454.50
ZSCALER INC	3,630	184.96	671,404.80
AMPHENOL CORP-CL A	53,530	69.41	3,715,517.30
APPLE INC	643,644	231.41	148,945,658.04

ARISTA NETWORKS INC	11,860	394.09	4,673,907.40
CDW CORP/DE	5,895	217.01	1,279,273.95
CISCO SYSTEMS INC	177,400	55.74	9,888,276.00
CORNING INC	38,258	46.25	1,769,432.50
DELL TECHNOLOGIES -C	12,542	122.55	1,537,022.10
F5 INC	2,385	216.87	517,234.95
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	57,545	19.46	1,119,825.70
HP INC	45,695	36.88	1,685,231.60
JABIL INC	5,590	124.72	697,184.80
JUNIPER NETWORKS INC	13,453	39.08	525,743.24
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,160	155.98	1,116,816.80
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,290	462.32	3,370,312.80
NETAPP INC	9,416	119.41	1,124,364.56
PURE STORAGE INC - CLASS A	13,200	54.05	713,460.00
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	9,164	103.01	943,983.64
SUPER MICRO COMPUTER INC	22,800	47.27	1,077,756.00
TE CONNECTIVITY PLC	14,145	149.13	2,109,443.85
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,020	469.19	947,763.80
TRIMBLE INC	11,410	60.90	694,869.00
WESTERN DIGITAL CORP	14,028	69.45	974,244.60
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,075	360.09	747,186.75
AT&T INC	316,447	21.83	6,908,038.01
T-MOBILE US INC	23,319	226.36	5,278,488.84
VERIZON COMMUNICATIONS INC	186,197	41.38	7,704,831.86
AES CORP	27,958	16.96	474,167.68
ALLIANT ENERGY CORP	12,150	60.74	737,991.00
AMEREN CORPORATION	12,892	87.80	1,131,917.60
AMERICAN ELECTRIC POWER	22,348	98.19	2,194,350.12
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,295	137.66	1,279,549.70
ATMOS ENERGY CORP	6,760	140.72	951,267.20
CENTERPOINT ENERGY INC	31,272	29.31	916,582.32
CMS ENERGY CORP	15,200	70.76	1,075,552.00
CONSOLIDATED EDISON INC	16,506	104.60	1,726,527.60
CONSTELLATION ENERGY	14,338	264.41	3,791,110.58
DOMINION ENERGY INC	36,341	59.58	2,165,196.78
DTE ENERGY COMPANY	8,318	126.57	1,052,809.26

DUKE ENERGY CORP	34,456	117.21	4,038,587.76
EDISON INTERNATIONAL	16,329	83.91	1,370,166.39
ENTERGY CORP	9,247	135.38	1,251,858.86
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,210	38.84	435,396.40
EVERGY INC	8,720	60.77	529,914.40
EVERSOURCE ENERGY	14,310	65.84	942,170.40
EXELON CORP	43,056	40.07	1,725,253.92
FIRSTENERGY CORP	23,295	43.41	1,011,235.95
NEXTERA ENERGY INC	91,420	81.43	7,444,330.60
NISOURCE INC	23,010	34.82	801,208.20
NRG ENERGY INC	9,770	87.53	855,168.10
P G & E CORP	85,070	20.36	1,732,025.20
PPL CORP	30,338	32.43	983,861.34
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	22,058	89.63	1,977,058.54
SEMPRA	27,094	84.38	2,286,191.72
SOUTHERN CO	48,275	91.88	4,435,507.00
VISTRA CORP	14,720	124.03	1,825,721.60
WEC ENERGY GROUP INC	14,270	97.19	1,386,901.30
XCEL ENERGY INC	26,934	64.46	1,736,165.64
ADVANCED MICRO DEVICES	71,644	156.23	11,192,942.12
ANALOG DEVICES INC	22,067	230.17	5,079,161.39
APPLIED MATERIALS INC	36,743	186.52	6,853,304.36
BROADCOM INC	195,160	173.00	33,762,680.00
ENPHASE ENERGY INC	6,430	83.83	539,026.90
ENTEGRIS INC	6,650	105.01	698,316.50
FIRST SOLAR INC	4,560	198.47	905,023.20
INTEL CORP	189,542	22.68	4,298,812.56
KLA CORP	5,909	673.07	3,977,170.63
LAM RESEARCH CORP	57,770	77.68	4,487,573.60
MARVELL TECHNOLOGY INC	40,254	81.61	3,285,128.94
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	23,418	76.29	1,786,559.22
MICRON TECHNOLOGY INC	48,957	107.91	5,282,949.87
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,200	901.29	1,982,838.00
NVIDIA CORP	1,086,420	141.54	153,771,886.80
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,887	243.16	2,647,282.92
ON SEMICONDUCTOR CORP	20,910	71.25	1,489,837.50

	QORVO INC	4,240	99.01	419,802.40	
	QUALCOMM INC	49,502	170.27	8,428,705.54	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,440	95.20	613,088.00	
	TERADYNE INC	6,880	111.75	768,840.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	40,182	206.93	8,314,861.26	
	CBRE GROUP INC - A	14,480	132.54	1,919,179.20	
	COSTAR GROUP INC	18,730	74.48	1,395,010.40	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,500	3.93	159,165.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	6,370	59.65	379,970.50	
米ドル小計		16,260,221		2,199,318,926.75 (337,485,489,309)	
加ドル	ARC RESOURCES LTD	25,510	24.02	612,750.20	
	CAMECO CORP	19,282	74.76	1,441,522.32	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	93,918	49.39	4,638,610.02	
	CENOVUS ENERGY INC	68,613	23.48	1,611,033.24	
	ENBRIDGE INC	95,987	56.93	5,464,539.91	
	IMPERIAL OIL LTD	8,922	105.72	943,233.84	
	KEYERA CORP	8,460	42.94	363,272.40	
	MEG ENERGY CORP	11,500	26.07	299,805.00	
	PARKLAND CORP	6,170	34.44	212,494.80	
	PEMBINA PIPELINE CORP	29,072	59.07	1,717,283.04	
	SUNCOR ENERGY INC	53,489	54.16	2,896,964.24	
	TC ENERGY CORP	45,033	65.68	2,957,767.44	
	TOURMALINE OIL CORP	15,980	64.81	1,035,663.80	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	21,496	120.79	2,596,501.84	
	BARRICK GOLD CORP	84,324	27.26	2,298,672.24	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	82.73	475,697.50	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	18.91	428,311.50	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,125	188.50	1,531,562.50	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	24,510	19.25	471,817.50	
	KINROSS GOLD CORP	55,925	14.62	817,623.50	
	LUNDIN MINING CORP	25,010	14.17	354,391.70	
	NUTRIEN LTD	24,688	66.60	1,644,220.80	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	16,410	34.37	564,011.70	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	21,725	65.80	1,429,505.00	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,450	135.46	331,877.00	

WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,165	91.91	1,761,455.15
CAE INC	12,305	25.81	317,592.05
STANTEC INC	5,720	113.64	650,020.80
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,260	126.09	411,053.40
WSP GLOBAL INC	5,800	248.34	1,440,372.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	21,040	28.58	601,323.20
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	11,710	55.68	652,012.80
RB GLOBAL INC	7,560	118.00	892,080.00
THOMSON REUTERS CORP	7,350	229.02	1,683,297.00
AIR CANADA	7,190	18.92	136,034.80
CANADIAN NATL RAILWAY CO	23,418	154.25	3,612,226.50
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	41,421	107.18	4,439,502.78
TFI INTERNATIONAL INC	3,210	185.88	596,674.80
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,668	58.35	622,477.80
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,570	70.47	110,637.90
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,040	66.81	470,342.40
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	12,858	98.06	1,260,855.48
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,250	156.92	353,070.00
DOLLARAMA INC	12,990	141.66	1,840,163.40
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	34,600	71.43	2,471,478.00
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	39.91	277,374.50
LOBLAW COMPANIES LTD	6,339	173.00	1,096,647.00
METRO INC	9,570	81.71	781,964.70
WESTON (GEORGE) LTD	2,808	218.33	613,070.64
SAPUTO INC	9,620	27.25	262,145.00
BANK OF MONTREAL	30,681	128.95	3,956,314.95
BANK OF NOVA SCOTIA	52,339	71.99	3,767,884.61
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	42,300	87.32	3,693,636.00
NATIONAL BANK OF CANADA	16,550	131.67	2,179,138.50
ROYAL BANK OF CANADA	61,789	170.22	10,517,723.58
TORONTO-DOMINION BANK	77,700	78.30	6,083,910.00
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	13,859	72.91	1,010,459.69
BROOKFIELD CORP	57,209	74.35	4,253,489.15
IGM FINANCIAL INC	3,335	41.64	138,869.40
ONEX CORPORATION	2,765	96.88	267,873.20
TMX GROUP LTD	10,850	42.85	464,922.50

	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	1,736.70	1,563,030.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	11,324	47.01	532,341.24	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,075	112.94	460,230.50	
	INTACT FINANCIAL CORP	7,215	267.38	1,929,146.70	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	84,561	41.41	3,501,671.01	
	POWER CORP OF CANADA	27,929	44.15	1,233,065.35	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	24,774	78.40	1,942,281.60	
	CGI INC	9,510	157.25	1,495,447.50	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	870	4,281.75	3,725,122.50	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,740	144.62	540,878.80	
	OPEN TEXT CORP	11,190	46.23	517,313.70	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	53,850	109.84	5,914,884.00	
	BCE INC	3,000	45.57	136,710.00	
	QUEBECOR INC -CL B	6,110	35.37	216,110.70	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	16,655	51.60	859,398.00	
	TELUS CORP	12,662	22.00	278,564.00	
	ALTAGAS LTD	11,170	33.71	376,540.70	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	46.34	252,321.30	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	35.96	163,977.60	
	EMERA INC	15,550	53.13	826,171.50	
	FORTIS INC	22,635	60.89	1,378,245.15	
	HYDRO ONE LTD	13,230	45.39	600,509.70	
	FIRSTSERVICE CORP	1,500	263.60	395,400.00	
加ドル小計		1,803,243		129,666,588.26 (14,325,564,670)	
ユーロ	ENI SPA	100,696	14.42	1,452,841.88	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	18,755	16.60	311,426.77	
	NESTE OYJ	18,710	14.79	276,720.90	
	OMV AG	5,480	38.98	213,610.40	
	REPSOL SA	54,849	11.96	656,268.28	
	TENARIS SA	23,455	14.81	347,485.82	
	TOTALENERGIES SE	94,227	60.27	5,679,061.29	
	AIR LIQUIDE SA	25,534	167.44	4,275,412.96	
	AKZO NOBEL	6,937	59.46	412,474.02	
	ARCELORMITTAL	20,552	22.23	456,870.96	
	ARKEMA	2,215	80.80	178,972.00	

BASF SE	41,325	46.17	1,907,975.25
COVESTRO AG	7,410	58.20	431,262.00
DSM-FIRMENICH AG	8,752	114.75	1,004,292.00
EVONIK INDUSTRIES AG	16,230	20.60	334,338.00
HEIDELBERG MATERIALS AG	5,715	99.02	565,899.30
STORA ENSO OYJ-R SHS	25,365	10.70	271,405.50
SYENSQO SA	2,811	73.07	205,399.77
SYMRISE AG	5,790	113.60	657,744.00
UPM-KYMMENE OYJ	25,098	28.96	726,838.08
VOESTALPINE AG	4,249	20.12	85,489.88
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,876	43.76	344,653.76
AIRBUS GROUP SE	26,528	140.48	3,726,653.44
ALSTOM	13,962	20.55	286,919.10
BOUYGUES SA	8,460	29.38	248,554.80
BRENTAG SE	6,865	61.62	423,021.30
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	19,106	81.88	1,564,399.28
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	23,136	39.17	906,237.12
DASSAULT AVIATION SA	900	192.80	173,520.00
EIFFAGE	3,250	85.38	277,485.00
FERROVIAL SE	24,155	37.20	898,566.00
GEA GROUP AG	6,020	46.52	280,050.40
IMCD NV	2,120	149.75	317,470.00
KINGSPAN GROUP PLC	7,300	78.95	576,335.00
KNORR-BREMSE AG	2,970	79.70	236,709.00
KONE OYJ-B	13,614	51.22	697,309.08
LEGRAND SA	11,128	104.50	1,162,876.00
LEONARDO SPA	16,300	21.79	355,177.00
METSO CORPORATION	24,200	9.03	218,574.40
MTU AERO ENGINES AG	2,540	309.00	784,860.00
PRYSMIAN SPA	12,035	68.00	818,380.00
RATIONAL AG	230	924.50	212,635.00
REXEL SA	11,150	25.80	287,670.00
RHEINMETALL AG	2,090	485.80	1,015,322.00
SAFRAN SA	14,810	211.50	3,132,315.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	24,348	242.35	5,900,737.80
SIEMENS AG-REG	33,566	180.42	6,055,977.72

SIEMENS ENERGY AG	31,643	38.35	1,213,509.05
THALES SA	4,925	152.05	748,846.25
VINCI SA	23,010	100.75	2,318,257.50
WARTSILA OYJ ABP	25,650	20.06	514,539.00
BUREAU VERITAS SA	16,910	29.26	494,786.60
RANDSTAD NV	4,675	43.36	202,708.00
TELEPERFORMANCE	2,240	96.06	215,174.40
WOLTERS KLUWER	11,667	158.70	1,851,552.90
ADP	1,630	109.30	178,159.00
AENA SA	3,750	204.80	768,000.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	6.72	160,569.12
DEUTSCHE POST AG-REG	46,023	37.72	1,735,987.56
GETLINK	17,310	15.53	268,824.30
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,355	76.00	1,014,980.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,150	71.65	225,697.50
CONTINENTAL AG	4,385	58.70	257,399.50
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	4,380	70.28	307,826.40
FERRARI NV	5,459	450.10	2,457,095.90
MERCEDES-BENZ GROUP AG	34,202	57.79	1,976,533.58
MICHELIN (CGDE)	30,986	31.16	965,523.76
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	40.37	228,897.90
RENAULT SA	8,247	43.10	355,445.70
STELLANTIS NV	98,206	12.67	1,244,466.43
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,083	92.28	838,179.24
ADIDAS AG	7,481	217.00	1,623,377.00
HERMES INTERNATIONAL	1,372	2,105.00	2,888,060.00
KERING	3,537	234.95	831,018.15
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	12,164	627.00	7,626,828.00
MONCLER SPA	10,320	54.06	557,899.20
PUMA SE	4,200	42.54	178,668.00
SEB SA	987	98.55	97,268.85
ACCOR SA	10,106	41.79	422,329.74
AMADEUS IT GROUP SA	21,100	67.24	1,418,764.00
DELIVERY HERO SE	9,610	41.00	394,010.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	37.26	145,314.00
SODEXO SA	3,240	80.10	259,524.00

BOLLORE SE	33, 530	5. 81	194, 809. 30
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	2, 660	97. 55	259, 483. 00
PUBLICIS GROUPE	9, 305	99. 38	924, 730. 90
SCOUT24 SE	2, 970	80. 60	239, 382. 00
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	36, 410	23. 61	859, 640. 10
VIVENDI SE	26, 070	10. 22	266, 565. 75
D' IETEREN GROUP	1, 050	190. 60	200, 130. 00
INDITEX	45, 895	54. 56	2, 504, 031. 20
PROSUS NV	62, 794	39. 70	2, 493, 235. 77
ZALANDO SE	8, 260	29. 13	240, 613. 80
CARREFOUR SA	22, 633	14. 60	330, 441. 80
JERONIMO MARTINS	10, 585	16. 80	177, 828. 00
KESKO OYJ-B SHS	10, 930	17. 89	195, 537. 70
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	40, 028	30. 71	1, 229, 259. 88
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	41, 131	59. 54	2, 448, 939. 74
DANONE	30, 254	65. 78	1, 990, 108. 12
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	30, 650	7. 73	237, 047. 10
HEINEKEN HOLDING NV	7, 005	67. 15	470, 385. 75
HEINEKEN NV	12, 733	79. 62	1, 013, 801. 46
JDE PEET' S NV	6, 290	21. 58	135, 738. 20
KERRY GROUP PLC-A	6, 460	94. 75	612, 085. 00
LOTUS BAKERIES	20	12, 220. 00	244, 400. 00
PERNOD-RICARD SA	9, 916	123. 35	1, 223, 138. 60
BEIERSDORF AG	4, 375	129. 00	564, 375. 00
HENKEL AG & CO KGAA	4, 520	74. 20	335, 384. 00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6, 793	81. 98	556, 890. 14
L' OREAL	10, 646	355. 65	3, 786, 249. 90
AMPLIFON SPA	4, 830	27. 46	132, 631. 80
BIOMERIEUX	1, 690	104. 90	177, 281. 00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1, 610	62. 80	101, 108. 00
DIASORIN ITALIA SPA	930	102. 00	94, 860. 00
ESSILORLUXOTTICA	12, 675	219. 50	2, 782, 162. 50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	9, 583	39. 02	373, 928. 66
FRESENIUS SE & CO KGAA	20, 905	33. 86	707, 843. 30
KONINKLIJKE PHILIPS NV	38, 028	29. 48	1, 121, 065. 44
SIEMENS HEALTHINEERS AG	13, 430	51. 32	689, 227. 60

ARGENX SE	2,495	521.00	1,299,895.00
BAYER AG-REG	43,824	25.75	1,128,468.00
EUROFINS SCIENTIFIC	5,050	46.73	235,986.50
IPSEN	1,600	115.30	184,480.00
MERCK KGAA	5,940	156.30	928,422.00
ORION OYJ-CLASS B	4,500	44.32	199,440.00
QIAGEN N. V.	10,072	38.72	389,987.84
RECORDATI SPA	3,720	53.75	199,950.00
SANOFI	50,646	100.08	5,068,651.68
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,230	244.60	300,858.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	188.80	203,904.00
UCB SA	5,398	178.75	964,892.50
ABN AMRO BANK NV-CVA	23,550	15.23	358,666.50
AIB GROUP PLC	70,100	4.85	339,985.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	267,563	9.04	2,419,304.64
BANCO BPM SPA	49,000	6.08	298,312.00
BANCO DE SABADELL SA	232,000	1.80	418,760.00
BANCO SANTANDER SA	694,189	4.57	3,176,261.76
BANK OF IRELAND GROUP PLC	44,790	8.85	396,749.82
BNP PARIBAS	44,242	65.33	2,890,329.86
CAIXABANK S. A	163,050	5.36	874,274.10
COMMERZBANK AG	50,774	16.15	820,000.10
CREDIT AGRICOLE SA	49,662	14.00	695,268.00
ERSTE GROUP BANK AG	15,328	48.84	748,619.52
FINECOBANK SPA	23,540	15.01	353,453.10
ING GROEP NV-CVA	146,925	15.67	2,303,490.15
INTESA SANPAOLO	621,793	3.87	2,410,069.66
KBC GROEP NV	11,219	67.58	758,180.02
MEDIOBANCA SPA	19,520	15.34	299,534.40
NORDEA BANK ABP	131,132	10.84	1,421,470.88
SOCIETE GENERALE	30,909	23.72	733,161.48
UNICREDIT SPA	64,276	40.15	2,581,002.78
ADYEN NV	935	1,417.60	1,325,456.00
AMUNDI SA	2,140	68.65	146,911.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	80,935	15.67	1,268,737.06
DEUTSCHE BOERSE AG	8,250	216.00	1,782,000.00

EDENRED	9,626	28.93	278,480.18
EURAZEO SE	2,497	70.80	176,787.60
EURONEXT NV	3,470	103.00	357,410.00
EXOR NV	4,164	99.80	415,567.20
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,452	67.90	234,390.80
NEXI SPA	21,240	5.86	124,466.40
SOFINA	655	229.80	150,519.00
AEGON LTD	69,679	5.88	410,269.95
AGEAS	5,924	48.30	286,129.20
ALLIANZ SE-REG	17,203	293.80	5,054,241.40
ASR NEDERLAND NV	5,880	44.06	259,072.80
AXA SA	83,692	34.89	2,920,013.88
GENERALI	50,398	25.96	1,308,332.08
HANNOVER RUECK SE-REG	2,775	245.40	680,985.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,046	469.50	2,838,597.00
NN GROUP NV	10,270	46.01	472,522.70
POSTE ITALIANE SPA	19,560	13.04	255,160.20
SAMPO OYJ-A SHS	19,639	40.62	797,736.18
TALANX AG	2,500	71.20	178,000.00
BECHTLE AG	3,070	33.92	104,134.40
CAP GEMINI SA	6,509	175.05	1,139,400.45
DASSAULT SYSTEMES SE	30,390	31.52	957,892.80
NEMETSCHEK SE	2,350	101.90	239,465.00
SAP SE	46,042	221.05	10,177,584.10
NOKIA OYJ	251,336	4.41	1,109,522.77
CELLNEX TELECOM SA	24,690	35.12	867,112.80
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	151,666	28.10	4,261,814.60
ELISA OYJ	6,005	43.64	262,058.20
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	10.53	159,740.10
KONINKLIJKE KPN NV	204,956	3.75	769,814.73
ORANGE S. A.	83,604	10.10	844,818.42
TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.24	96,203.22
TELEFONICA SA	195,629	4.33	847,660.45
ACCIONA SA	830	123.20	102,256.00
E. ON SE	108,799	12.75	1,387,187.25
EDP RENOVAVEIS SA	11,333	13.08	148,235.64

	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	126,131	3.76	474,504.82
	ELIA GROUP SA/NV	1,356	92.00	124,752.00
	ENDESA SA	12,050	19.68	237,144.00
	ENEL SPA	344,237	7.18	2,474,375.55
	ENGIE	82,214	15.65	1,286,649.10
	FORTUM OYJ	16,755	14.22	238,256.10
	IBERDROLA SA	272,062	13.95	3,795,264.90
	REDEIA CORP SA	20,650	16.85	347,952.50
	RWE AG	25,835	30.71	793,392.85
	SNAM SPA	91,120	4.49	409,402.16
	TERNA SPA	71,827	8.09	581,080.43
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	31,150	29.11	906,776.50
	VERBUND AG	2,780	78.80	219,064.00
	ASM INTERNATIONAL NV	2,105	521.00	1,096,705.00
	ASML HOLDING NV	17,697	664.10	11,752,577.70
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	3,290	105.65	347,588.50
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	56,495	30.70	1,734,396.50
	STMICROELECTRONICS NV	29,593	26.17	774,448.81
	LEG IMMOBILIEN SE	3,010	88.92	267,649.20
	VONOVIA SE	33,969	30.98	1,052,359.62
	ユーロ小計	8,046,126		227,767,414.39 (37,729,672,193)
英ポンド	BP PLC	739,418	4.04	2,993,903.48
	SHELL PLC-NEW	282,377	25.50	7,202,025.38
	ANGLO AMERICAN PLC	54,004	24.34	1,314,727.38
	ANTOFAGASTA PLC	17,080	18.11	309,318.80
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,131	37.18	227,950.58
	ENDEAVOUR MINING PLC	6,490	18.46	119,805.40
	GLENCORE PLC	453,603	4.04	1,833,463.32
	MONDI PLC	16,700	12.72	212,424.00
	RIO TINTO PLC	49,485	50.22	2,485,136.70
	ASHTREAD GROUP PLC	20,500	58.58	1,200,890.00
	BAE SYSTEMS PLC ORD	134,535	12.92	1,738,192.20
	BUNZL PLC	17,316	34.72	601,211.52
	DCC PLC	3,820	50.55	193,101.00
	MELROSE INDUSTRIES PLC	63,400	4.43	280,862.00

ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	380,331	5.56	2,115,401.02
SMITHS GROUP PLC	13,603	15.88	216,015.64
SPIRAX GROUP PLC	2,890	67.70	195,653.00
EXPERIAN PLC	43,618	38.68	1,687,144.24
INTERTEK GROUP PLC	6,025	47.84	288,236.00
RELX PLC	83,125	36.44	3,029,075.00
RENTOKIL INITIAL PLC	115,300	3.76	434,450.40
BARRATT REDROW PLC	76,220	4.72	360,139.50
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,356	46.54	202,728.24
PERSIMMON PLC	12,440	15.74	195,805.60
TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.54	192,215.41
COMPASS GROUP PLC	72,268	25.11	1,814,649.48
ENTAIN PLC	24,860	7.15	177,848.44
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,473	85.06	635,653.38
PEARSON PLC	26,089	10.43	272,108.27
WHITBREAD PLC	8,110	32.93	267,062.30
AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	8.80	321,169.92
INFORMA PLC	56,580	8.20	463,956.00
WPP PLC	41,144	8.22	338,450.54
JD SPORTS FASHION PLC	97,350	1.31	128,453.32
KINGFISHER PLC	78,137	3.10	242,459.11
NEXT PLC	5,667	100.00	566,700.00
SAINSBURY (J) PLC	70,601	2.72	192,599.52
TESCO PLC	338,158	3.52	1,193,021.42
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,295	23.10	422,614.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	84,677	26.58	2,250,714.66
COCA-COLA HBC AG-CDI	11,230	27.76	311,744.80
DIAGEO PLC	95,292	25.65	2,444,716.26
IMPERIAL BRANDS PLC	38,792	22.89	887,948.88
HALEON PLC	298,551	3.74	1,118,372.04
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	30,695	48.49	1,488,400.55
UNILEVER PLC	109,872	47.62	5,232,104.64
NMC HEALTH PLC	8,090	—	—
SMITH & NEPHEW PLC	33,906	10.88	368,897.28
ASTRAZENECA PLC	68,352	116.06	7,932,933.12
GSK PLC	182,410	14.48	2,642,208.85

	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,740	19.42	111,470.80
	BARCLAYS PLC	639,751	2.41	1,544,358.91
	HSBC HOLDINGS PLC	833,261	6.82	5,683,673.28
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,972,636	0.57	1,714,021.91
	NATWEST GROUP PLC	275,835	3.63	1,003,763.56
	STANDARD CHARTERED PLC	95,420	8.53	813,932.60
	3I GROUP PLC	40,649	32.78	1,332,474.22
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	20,707	106.05	2,195,977.35
	M&G PLC	99,522	2.00	199,541.61
	SCHRODERS PLC	30,300	3.56	108,110.40
	WISE PLC - A	29,200	7.35	214,620.00
	ADMIRAL GROUP PLC	12,845	25.72	330,373.40
	AVIVA PLC	134,324	4.62	621,382.82
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	294,051	2.20	648,382.45
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,230	5.06	153,114.95
	PRUDENTIAL PLC	121,002	6.47	783,124.94
	SAGE GROUP PLC/THE	49,540	10.15	502,831.00
	HALMA PLC	14,690	24.69	362,696.10
	BT GROUP PLC	267,752	1.44	386,633.88
	VODAFONE GROUP PLC	996,528	0.73	734,241.83
	CENTRICA PLC	209,200	1.23	257,839.00
	NATIONAL GRID PLC	204,765	9.98	2,044,783.29
	SEVERN TRENT PLC	13,573	26.33	357,377.09
	SSE PLC	53,447	18.29	977,545.63
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	10.50	274,102.50
英ポンド小計		12,041,009		84,701,036.61 (16,848,730,202)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	7,990	12.55	100,274.50
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	679.00	183,330.00
	GIVAUDAN-REG	423	4,194.00	1,774,062.00
	HOLCIM LTD	22,219	83.04	1,845,065.76
	SIG GROUP AG	10,900	18.99	206,991.00
	SIKA AG-REG	6,605	247.10	1,632,095.50
	ABB LTD-REG	70,005	48.75	3,412,743.75
	GEBERIT AG-REG	1,490	517.20	770,628.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,070	247.00	264,290.00

SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	252.80	374,144.00
VAT GROUP AG	1,295	368.00	476,560.00
ADECCO GROUP AG-REG	6,817	28.00	190,876.00
SGS SA-REG	5,950	91.56	544,782.00
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,810	220.00	618,200.00
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	23,819	128.45	3,059,550.55
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,525	183.90	280,447.50
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,950	36.25	70,687.50
AVOLTA AG	3,460	34.48	119,300.80
BARRY CALLEBAUT AG-REG	130	1,570.00	204,100.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	40	10,540.00	421,600.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	103,600.00	518,000.00
NESTLE SA-REG	117,690	84.54	9,949,512.60
ALCON INC	22,714	81.96	1,861,639.44
SONOVA HOLDING AG-REG	2,051	312.20	640,322.20
STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,520	126.70	699,384.00
BACHEM HOLDING AG	1,400	69.70	97,580.00
GALDERMA GROUP AG	2,090	81.07	169,436.30
LONZA GROUP AG-REG	3,333	556.20	1,853,814.60
NOVARTIS AG-REG	86,923	98.66	8,575,823.18
ROCHE HOLDING AG-BR	1,640	307.20	503,808.00
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	30,993	281.20	8,715,231.60
SANDOZ GROUP AG	21,268	38.37	816,053.16
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,510	88.70	133,937.00
JULIUS BAER GROUP LTD	8,420	54.32	457,374.40
PARTNERS GROUP HOLDING AG	995	1,260.50	1,254,197.50
UBS GROUP AG-REG	146,722	27.87	4,089,142.14
BALOISE HOLDING AG - REG	1,740	174.20	303,108.00
HELVETIA HOLDING AG-REG	1,320	150.70	198,924.00
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,285	711.60	914,406.00
SWISS RE AG	14,419	111.75	1,611,323.25
ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,521	518.80	3,383,094.80
TEMENOS AG	2,280	63.45	144,666.00
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	70.28	468,064.80
SWISSCOM AG-REG	1,024	559.00	572,416.00
BKW AG	840	156.80	131,712.00

	SWISS PRIME SITE-REG	3,441	94.55	325,346.55	
スイスフラン小計		663,052		64,938,046.38 (11,460,266,425)	
スウェーデン ローナ	BOLIDEN AB	10,290	335.60	3,453,324.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,520	437.60	1,540,352.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	22,680	149.20	3,383,856.00	
	ADDTECH AB-B SHARES	11,400	296.00	3,374,400.00	
	ALFA LAVAL AB	15,220	481.80	7,332,996.00	
	ASSA ABLOY AB-B	42,940	334.60	14,367,724.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	122,590	179.55	22,011,034.50	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	67,170	158.75	10,663,237.50	
	BEIJER REF AB	15,480	158.50	2,453,580.00	
	EPIROC AB-A	31,565	213.90	6,751,753.50	
	EPIROC AB-B	15,450	188.10	2,906,145.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	70.34	1,055,100.00	
	INDUTRADE AB	10,180	295.00	3,003,100.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	298.20	2,027,760.00	
	LIFCO AB-B SHS	8,470	321.60	2,723,952.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	63,000	51.78	3,262,140.00	
	SAAB AB-B	11,120	230.70	2,565,384.00	
	SANDVIK AB	49,820	211.00	10,512,020.00	
	SKANSKA AB-B SHS	14,390	216.90	3,121,191.00	
	SKF AB-B SHARES-B	14,079	201.40	2,835,510.60	
	TRELLEBORG AB-B SHS	9,190	365.00	3,354,350.00	
	VOLVO AB-A SHS	9,530	279.80	2,666,494.00	
	VOLVO AB-B SHS-B	70,890	277.20	19,650,708.00	
	SECURITAS AB-B SHS	17,788	128.90	2,292,873.20	
	VOLVO CAR AB-B	39,400	23.60	930,037.00	
	EVOLUTION AB	8,150	1,044.50	8,512,675.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,848	172.35	4,799,602.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	29,035	304.60	8,844,061.00	
	GETINGE AB-B SHS	9,470	198.50	1,879,795.00	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	8,148	346.40	2,822,467.20	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	72,400	149.60	10,831,040.00		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60,120	111.80	6,721,416.00		
SWEDBANK AB - A SHARES	34,550	214.90	7,424,795.00		

	EQT AB	17,960	320.00	5,747,200.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	369.40	1,841,089.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	368.70	2,204,826.00	
	INVESTOR AB-B SHS	79,850	306.00	24,434,100.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,590	538.50	1,933,215.00	
	ERICSSON LM-B SHS	114,915	89.94	10,335,455.10	
	HEXAGON AB-B SHS	94,990	105.35	10,007,196.50	
	TELE2 AB-B SHS	23,245	112.95	2,625,522.75	
	TELIA CO AB	118,530	32.10	3,804,813.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	23,220	83.00	1,927,260.00	
	SAGAX AB-B	11,880	263.00	3,124,440.00	
スウェーデンクローナ小計		1,446,827		258,059,992.25 (3,726,386,288)	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	12,100	233.50	2,825,350.00	
	EQUINOR ASA	39,014	282.60	11,025,356.40	
	NORSK HYDRO A S	50,660	68.52	3,471,223.20	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,670	339.60	2,265,132.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,900	1,143.00	4,457,700.00	
	MOWI ASA	16,360	197.30	3,227,828.00	
	ORKLA ASA	32,290	99.25	3,204,782.50	
	SALMAR ASA	3,590	585.00	2,100,150.00	
	DNB BANK ASA	45,435	230.40	10,468,224.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,410	202.00	1,496,820.00	
	TELENOR ASA	23,915	131.40	3,142,431.00	
ノルウェークローネ小計		241,344		47,684,997.10 (665,205,709)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	16,690	442.40	7,383,656.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	315	2,942.00	926,730.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	47,690	132.15	6,302,233.50	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	115	10,300.00	1,184,500.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	195	10,640.00	2,074,800.00	
	DSV A/S	8,890	1,500.00	13,335,000.00	
	PANDORA A/S	3,310	1,040.50	3,444,055.00	
	CARLSBERG AS-B	3,910	785.00	3,069,350.00	
	COLOPLAST-B	6,475	883.80	5,722,605.00	
	DEMANT A/S	3,640	269.80	982,072.00	

	GENMAB A/S	2,920	1,593.50	4,653,020.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	142,520	784.30	111,778,436.00	
	ZEALAND PHARMA A/S	2,810	841.50	2,364,615.00	
	DANSKE BANK A/S	31,185	198.80	6,199,578.00	
	TRYG A/S	13,945	161.40	2,250,723.00	
	ORSTED A/S	7,570	433.60	3,282,352.00	
デンマーククローネ小計		292,180		174,953,725.50 (3,883,972,706)	
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	28.12	246,753.00	
	SANTOS LTD	151,760	6.93	1,051,696.80	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	84,316	24.29	2,048,035.64	
	BHP GROUP LTD	225,267	42.39	9,549,068.13	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	20.70	379,017.00	
	FORTESCUE LTD	73,745	18.99	1,400,417.55	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	20,365	49.71	1,012,344.15	
	MINERAL RESOURCES LTD	7,320	34.12	249,758.40	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	53,090	18.29	971,016.10	
	ORICA LIMITED	17,675	17.42	307,898.50	
	PILBARA MINERALS LTD	114,530	2.74	313,812.20	
	RIO TINTO LTD	16,698	118.08	1,971,699.84	
	SOUTH32 LTD	207,787	3.71	770,889.77	
	REECE LTD	10,200	23.71	241,842.00	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	8,410	41.79	351,453.90	
	BRAMBLES LTD	54,798	18.16	995,131.68	
	COMPUTERSHARE LTD	20,910	26.23	548,469.30	
	QANTAS AIRWAYS LTD	35,030	8.03	281,290.90	
	TRANSURBAN GROUP	151,796	12.95	1,965,758.20	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	29,060	59.00	1,714,540.00	
	LOTTERY CORP LTD/THE	85,554	4.97	425,203.38	
	CAR GROUP LTD	14,500	37.09	537,805.00	
	REA GROUP LTD	1,820	229.34	417,398.80	
	SEEK LTD	12,860	25.55	328,573.00	
	WESFARMERS LTD	47,855	68.01	3,254,618.55	
	COLES GROUP LTD	57,925	18.16	1,051,918.00	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	82,662	4.73	390,991.26	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	54,692	32.69	1,787,881.48	

	TREASURY WINE ESTATES LTD	43,206	11.77	508,534.62	
	COCHLEAR LTD	2,947	283.94	836,771.18	
	PRO MEDICUS LTD	2,450	185.30	453,985.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,105	41.70	296,278.50	
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	27.67	488,652.20	
	CSL LTD	21,382	293.69	6,279,679.58	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	126,149	31.71	4,000,184.79	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	74,307	144.02	10,701,694.14	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	135,333	38.95	5,271,220.35	
	WESTPAC BANKING CORP	148,101	32.14	4,759,966.14	
	ASX LTD	7,105	67.47	479,374.35	
	MACQUARIE GROUP LTD	16,084	233.22	3,751,110.48	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,370	33.81	282,989.70	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	7.49	712,486.25	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	108,430	3.69	400,106.70	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	70,410	17.23	1,213,164.30	
	SUNCORP GROUP LTD	55,536	18.04	1,001,869.44	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,450	112.00	834,400.00	
	XERO LTD	5,960	147.40	878,504.00	
	TELSTRA GROUP LTD	164,284	3.87	635,779.08	
	APA GROUP	69,418	7.18	498,421.24	
	ORIGIN ENERGY LTD	93,120	9.66	899,539.20	
豪ドル小計		2,947,642		79,749,993.77 (8,082,661,868)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,165	7.26	342,417.90	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,130	36.84	852,109.20	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	2.99	229,348.11	
	MERCURY NZ LTD	34,100	6.61	225,401.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	57,830	5.92	342,353.60	
ニュージーランドドル小計		238,802		1,991,629.81 (182,612,537)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	125,708	41.75	5,248,309.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	17,517	64.90	1,136,853.30	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	58,500	114.80	6,715,800.00	
	MTR CORP	62,500	28.50	1,781,250.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	23.15	1,203,800.00	

	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	91,000	34.30	3,121,300.00	
	SANDS CHINA LTD	96,600	19.86	1,918,476.00	
	WH GROUP LTD	450,894	6.28	2,831,614.32	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	203,500	25.65	5,219,775.00	
	HANG SENG BANK LTD	36,900	95.50	3,523,950.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	52,800	312.80	16,515,840.00	
	AIA GROUP LTD	482,390	62.85	30,318,211.50	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	9.74	1,461,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	54.90	1,372,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	71,500	66.80	4,776,200.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	456,237	6.12	2,792,170.44	
	POWER ASSETS HOLDINGS	58,000	51.70	2,998,600.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	80,538	32.30	2,601,377.40	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	25.55	1,479,370.55	
	SINO LAND CO	189,050	7.85	1,484,042.50	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,480	85.10	5,146,848.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	43,000	21.85	939,550.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	24.10	1,537,580.00	
香港ドル小計		2,985,815		106,124,418.01 (2,094,896,011)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	68,560	6.51	446,325.60	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	63,300	4.72	298,776.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	6.47	348,733.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.82	174,157.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	3.25	240,370.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	84,034	39.15	3,289,931.10	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	150,740	15.32	2,309,336.80	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	57,300	32.49	1,861,677.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	11.65	495,125.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	354,480	3.21	1,137,880.80	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	30,200	5.27	159,154.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	105,000	2.87	301,350.00	
シンガポールドル小計		1,295,074		11,062,816.80 (1,282,512,351)	
イスラエルシユケル	ICL GROUP LTD	39,490	15.67	618,808.30	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,010	808.40	816,484.00	

	BANK HAPOALIM BM	50,495	38.22	1,929,918.90	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	62,565	37.10	2,321,161.50	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	48,330	21.22	1,025,562.60	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,900	149.90	1,034,310.00	
	NICE LTD	3,040	662.70	2,014,608.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,780	274.00	487,720.00	
イスラエルシケル小計		213,610		10,248,573.30 (414,632,679)	
合計		48,474,945		438,182,602,948 (438,182,602,948)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	6,910	780,968.20	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	12,110	463,449.70	
		AMERICAN TOWER CORP	20,829	4,640,701.20	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	18,847	367,328.03	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,790	1,310,566.50	
		BXP INC	5,717	497,321.83	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,810	568,974.90	
		CROWN CASTLE INC	18,590	2,024,636.90	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,395	2,605,638.95	
		EQUINIX INC	4,208	3,847,500.64	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	9,580	664,756.20	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	15,450	1,153,651.50	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,020	892,863.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	9,880	1,644,032.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,340	564,391.80	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36,875	821,943.75	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	33,579	590,318.82	
		INVITATION HOMES INC	25,700	863,520.00	
		IRON MOUNTAIN INC	13,365	1,706,710.50	
		KIMCO REALTY CORP	29,910	704,380.50	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,630	863,191.60			

		PROLOGIS INC	40,885	4,805,622.90	
		PUBLIC STORAGE	6,849	2,303,592.66	
		REALTY INCOME CORP	39,211	2,404,026.41	
		REGENCY CENTERS CORP	7,565	537,190.65	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,735	1,144,875.65	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	15,054	2,567,008.08	
		SUN COMMUNITIES INC	5,920	792,628.80	
		UDR INC	12,100	530,827.00	
		VENTAS INC	17,025	1,106,114.25	
		VICI PROPERTIES INC	45,610	1,464,081.00	
		WELLTOWER INC	27,660	3,601,332.00	
		WEYERHAEUSER CO	29,998	953,936.40	
		WP CAREY INC	8,610	493,180.80	
米ドル小計			567,757	50,281,263.12 (7,715,659,825)	
加ドル	新株予約権証券	CONSTELLATION SOFTWARE IN-40	810.00	—	
	新株予約権証券小計		810.00	— (—)	
	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	135,800.00	
	投資証券小計		2,800	135,800.00 (15,003,184)	
加ドル小計			3,610	135,800.00 (15,003,184)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	103,372.50	
		GECINA SA	1,950	195,780.00	
		KLEPIERRE	8,402	248,195.08	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,990	384,928.60	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,730	172,533.60	
ユーロ小計			24,997	1,104,809.78 (183,011,740)	
英ポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	164,669.44	
		SEGRO PLC	65,733	530,728.24	
英ポンド小計			92,357	695,397.68 (138,328,506)	
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	42,067	303,303.07	
		GOODMAN GROUP	70,642	2,545,937.68	

		GPT GROUP	71,335	345,261.40	
		MIRVAC GROUP	159,875	353,323.75	
		SCENTRE GROUP	280,871	991,474.63	
		STOCKLAND	102,400	528,384.00	
		VICINITY CENTRES	154,902	339,235.38	
豪ドル小計			882,092	5,406,919.91 (547,991,332)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	104,160	3,838,296.00	
香港ドル小計			104,160	3,838,296.00 (75,767,963)	
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,243	380,168.25	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	221,291	449,220.73	
シンガポールドル小計			359,534	829,388.98 (96,151,064)	
合計				8,771,913,614 (8,771,913,614)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株予約権 証券時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 572 銘柄	97.8%	—	—	75.7%
	投資証券 34 銘柄	—	—	2.2%	1.7%
加ドル	株式 84 銘柄	99.9%	—	—	3.2%
	新株予約権 証券 1 銘柄	—	—	—	—
	投資証券 1 銘柄	—	—	0.1%	0.0%
ユーロ	株式 211 銘柄	99.5%	—	—	8.4%
	投資証券 5 銘柄	—	—	0.5%	0.0%
英ポンド	株式 75 銘柄	99.2%	—	—	3.8%
	投資証券 2 銘柄	—	—	0.8%	0.0%
スイスフラン	株式 46 銘柄	100.0%	—	—	2.6%
スウェーデンクローナ	株式 44 銘柄	100.0%	—	—	0.8%
ノルウェークローネ	株式 11 銘柄	100.0%	—	—	0.1%
デンマーククローネ	株式 16 銘柄	100.0%	—	—	0.9%
豪ドル	株式 50 銘柄	93.7%	—	—	1.8%
	投資証券 7 銘柄	—	—	6.3%	0.1%

ニュージーランドドル	株式	5 銘柄	100.0%	—	—	0.0%
香港ドル	株式	23 銘柄	96.5%	—	—	0.5%
	投資証券	1 銘柄	—	—	3.5%	0.0%
シンガポールドル	株式	12 銘柄	93.0%	—	—	0.3%
	投資証券	2 銘柄	—	—	7.0%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	8 銘柄	100.0%	—	—	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
預金	104,846,891	84,270,649
コール・ローン	604,845,106	1,057,671,371
株式	18,864,148,524	26,024,703,041
投資証券	365,107,258	527,870,389
派生商品評価勘定	8,604,707	15,707,142
未収入金	5,135,967	801
未収配当金	13,823,892	14,894,529
未収利息	-	6,784
差入委託証拠金	342,727,613	462,421,171
流動資産合計	20,309,239,958	28,187,545,877
資産合計	20,309,239,958	28,187,545,877
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	375,702,990	1,256,987,507
未払金	17,481,332	2,068,198
未払解約金	3,268,722	13,611,082
未払利息	215	-
流動負債合計	396,453,259	1,272,666,787
負債合計	396,453,259	1,272,666,787
純資産の部		
元本等		
元本	8,773,758,808	9,154,839,298
剰余金		
剰余金又は欠損金(△)	11,139,027,891	17,760,039,792
元本等合計	19,912,786,699	26,914,879,090
純資産合計	19,912,786,699	26,914,879,090
負債純資産合計	20,309,239,958	28,187,545,877

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

(貸借対照表に関する注記)

		2023 年 10 月 26 日現在	2024 年 10 月 28 日現在
1.	期首	2022 年 10 月 27 日	2023 年 10 月 27 日
	期首元本額	8,061,313,419 円	8,773,758,808 円
	期首からの追加設定元本額	1,273,602,778 円	1,059,430,374 円
	期首からの一部解約元本額	561,157,389 円	678,349,884 円
	元本の内訳 ※		
	インデックスファンド海外株式ヘッジあり (DC 専用)	7,331,730,031 円	7,820,883,068 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)	311,113,933 円	283,193,664 円
	N i つみインデックスラップ世界 10 指数 (均等型)	570,911 円	1,322,307 円
	N i つみインデックスラップ世界 10 指数 (安定成長型)	321,600 円	555,175 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 20)	34,386,093 円	28,776,225 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 40)	100,071,776 円	90,212,470 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 60)	158,576,513 円	147,654,931 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 80)	159,949,483 円	153,483,896 円
	インデックスファンド海外株式 (ヘッジあり)	677,038,468 円	628,757,562 円
計	8,773,758,808 円	9,154,839,298 円	
2.	受益権の総数	8,773,758,808 口	9,154,839,298 口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	自 2022 年 10 月 27 日	自 2023 年 10 月 27 日
--	--------------------	--------------------

	至 2023 年 10 月 26 日	至 2024 年 10 月 28 日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	2023 年 10 月 26 日現在	2024 年 10 月 28 日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2023 年 10 月 26 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,333,910,881
投資証券	△45,196,394
合計	1,288,714,487

(2024 年 10 月 28 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

株式	6,249,871,846
投資証券	126,836,796
合計	6,376,708,642

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2023年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	724,550,405	—	680,013,225	△44,537,180
合計		724,550,405	—	680,013,225	△44,537,180

(2024年10月28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	715,560,166	—	731,171,231	15,611,065
合計		715,560,166	—	731,171,231	15,611,065

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(2023年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建	19,185,693,266	—	19,508,254,369	△322,561,103
	米ドル	14,254,594,644	—	14,534,472,941	△279,878,297
	加ドル	635,959,583	—	642,321,661	△6,362,078

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

(2024年10月28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	25,700,681,623	—	26,957,573,053	△1,256,891,430
	米ドル	19,680,049,302	—	20,767,298,772	△1,087,249,470
	加ドル	834,344,075	—	857,275,461	△22,931,386
	ユーロ	2,321,113,276	—	2,383,351,386	△62,238,110
	英ポンド	983,990,475	—	1,020,147,465	△36,156,990
	スイスフラン	659,925,171	—	676,397,379	△16,472,208
	スウェーデンクローナ	212,692,779	—	216,102,223	△3,409,444
	ノルウェークローネ	41,279,440	—	41,767,880	△488,440
	デンマーククローネ	224,866,168	—	231,802,992	△6,936,824
	豪ドル	504,531,294	—	516,854,851	△12,323,557
	ニュージーランドドル	8,332,920	—	8,456,097	△123,177
	香港ドル	123,531,825	—	128,751,030	△5,219,205
	シンガポールドル	81,596,557	—	83,931,001	△2,334,444
	イスラエルシェケル	24,428,341	—	25,436,516	△1,008,175
	合計	25,700,681,623	—	26,957,573,053	△1,256,891,430

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、

以下のように評価しております。

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年10月26日現在		2024年10月28日現在	
1口当たり純資産額	2,2696円	1口当たり純資産額	2,9400円
(1万口当たり純資産額)	(22,696円)	(1万口当たり純資産額)	(29,400円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	APA CORP	890	24.82	22,089.80	
	BAKER HUGHES CO	2,370	37.52	88,922.40	
	CHENIERE ENERGY INC	606	184.93	112,067.58	
	CHEVRON CORP	4,590	150.81	692,217.90	
	CHORD ENERGY CORP	200	128.85	25,770.00	
	CONOCOPHILLIPS	3,090	104.56	323,090.40	
	COTERRA ENERGY INC	2,100	23.85	50,085.00	
	DEVON ENERGY CORPORATION	1,690	39.19	66,231.10	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	500	184.38	92,190.00	
	EOG RESOURCES INC	1,460	123.17	179,828.20	
	EQT CORP	1,710	37.48	64,090.80	
	EXPAND ENERGY CORP	270	84.79	22,893.30	
	EXXON MOBIL CORP	11,730	119.49	1,401,617.70	
	HALLIBURTON CO	2,110	28.25	59,607.50	

HESS CORP	670	138.02	92,473.40
HF SINCLAIR CORP	420	43.01	18,064.20
KINDER MORGAN INC	5,650	24.95	140,967.50
MARATHON OIL CORP	1,710	26.46	45,246.60
MARATHON PETROLEUM CORP	900	152.36	137,124.00
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,660	51.58	85,622.80
ONEOK INC	1,510	96.66	145,956.60
OVINTIV INC	660	40.39	26,657.40
PHILLIPS 66	1,070	128.17	137,141.90
SCHLUMBERGER LTD	4,000	41.74	166,960.00
TARGA RESOURCES CORP	550	165.96	91,278.00
TEXAS PACIFIC LAND CORP	60	1,098.01	65,880.60
VALERO ENERGY CORP	810	132.40	107,244.00
WILLIAMS COS INC	3,340	52.50	175,350.00
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	590	318.02	187,631.80
ALBEMARLE CORP	307	93.51	28,707.57
AMCOR PLC	4,230	11.00	46,530.00
AVERY DENNISON CORP	196	207.16	40,603.36
BALL CORP	855	64.03	54,745.65
CELANESE CORP	280	128.87	36,083.60
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	420	83.19	34,939.80
CORTEVA INC	1,690	60.35	101,991.50
CRH PLC	1,760	92.39	162,606.40
CROWN HOLDINGS INC	298	93.70	27,922.60
DOW INC	2,240	49.70	111,328.00
DUPONT DE NEMOURS INC	1,130	83.30	94,129.00
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	300	105.43	31,629.00
ECOLAB INC	700	253.49	177,443.00
FREEPORT-MCMORAN INC	3,530	46.60	164,498.00
INTERNATIONAL PAPER CO	874	48.57	42,450.18
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	590	101.45	59,855.50
LINDE PLC	1,270	473.76	601,675.20
LYONDELLBASELL INDU-CL A	670	87.50	58,625.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	150	570.21	85,531.50
MOSAIC CO/THE	882	26.94	23,761.08
NEWMONT CORP	3,070	48.42	148,649.40

NUCOR CORP	640	141.47	90,540.80
PACKAGING CORP OF AMERICA	240	225.86	54,206.40
PPG INDUSTRIES INC	660	126.45	83,457.00
RELIANCE INC	170	283.54	48,201.80
RPM INTERNATIONAL INC	385	128.45	49,453.25
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	640	359.04	229,785.60
SMURFIT WESTROCK PLC	1,302	45.84	59,683.68
STEEL DYNAMICS INC	390	129.58	50,536.20
VULCAN MATERIALS CO	310	256.54	79,527.40
3M CO	1,410	124.75	175,897.50
AECOM	380	104.49	39,706.20
AERCAP HOLDINGS NV	450	95.42	42,939.00
ALLEGION PLC	231	142.60	32,940.60
AMETEK INC	630	166.96	105,184.80
AXON ENTERPRISE INC	190	444.52	84,458.80
BOEING CO/THE	1,570	155.01	243,365.70
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	300	180.80	54,240.00
CARLISLE COS INC	130	417.20	54,236.00
CARRIER GLOBAL CORP	2,090	73.72	154,074.80
CATERPILLAR INC	1,290	385.97	497,901.30
CNH INDUSTRIAL NV	2,590	11.20	29,008.00
CUMMINS INC	360	329.17	118,501.20
DEERE & CO	700	407.93	285,551.00
DOVER CORP	354	186.98	66,190.92
EATON CORP PLC	1,070	344.49	368,604.30
EMCOR GROUP INC	120	428.58	51,429.60
EMERSON ELECTRIC CO	1,460	108.13	157,869.80
FASTENAL CO	1,560	75.85	118,326.00
FERGUSON ENTERPRISES INC	530	196.23	104,001.90
FORTIVE CORP	950	74.97	71,221.50
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	347	85.49	29,665.03
GE VERNOVA INC	697	293.54	204,597.38
GENERAL DYNAMICS CORP	600	302.52	181,512.00
GENERAL ELECTRIC CO	2,870	179.10	514,017.00
GRACO INC	490	82.14	40,248.60
HEICO CORP	80	253.80	20,304.00

HEICO CORP-CLASS A	253	197.70	50,018.10
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,720	208.00	357,760.00
HOWMET AEROSPACE INC	1,146	101.39	116,192.94
HUBBELL INC	140	444.52	62,232.80
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	117	253.83	29,698.11
IDEX CORP	206	202.82	41,780.92
ILLINOIS TOOL WORKS	760	254.08	193,100.80
INGERSOLL-RAND INC	1,003	96.12	96,408.36
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	500	37.05	18,525.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	1,710	76.74	131,225.40
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	520	252.81	131,461.20
LENNOX INTERNATIONAL INC	80	609.18	48,734.40
LOCKHEED MARTIN CORP	550	562.29	309,259.50
MASCO CORP	710	81.26	57,694.60
NORDSON CORP	120	248.10	29,772.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	350	519.35	181,772.50
OTIS WORLDWIDE CORP	1,170	101.26	118,474.20
OWENS CORNING	242	181.90	44,019.80
PACCAR INC	1,460	105.90	154,614.00
PARKER HANNIFIN CORP	350	621.74	217,609.00
PENTAIR PLC	590	98.96	58,386.40
QUANTA SERVICES INC	370	308.17	114,022.90
ROCKWELL AUTOMATION INC	270	269.86	72,862.20
RTX CORP	3,490	125.16	436,808.40
SMITH (A. O.) CORP	270	76.87	20,754.90
SNAP-ON INC	152	326.58	49,640.16
STANLEY BLACK & DECKER INC	421	101.98	42,933.58
TEXTRON INC	508	82.35	41,833.80
TORO CO	300	81.70	24,510.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	610	392.57	239,467.70
TRANSDIGM GROUP INC	140	1,354.83	189,676.20
UNITED RENTALS INC	180	812.50	146,250.00
VERTIV HOLDINGS CO	890	112.17	99,831.30
WABTEC CORP	460	188.76	86,829.60
WATSCO INC	90	475.90	42,831.00
WW GRAINGER INC	110	1,090.94	120,003.40

XYLEM INC	640	130.42	83,468.80
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,090	287.96	313,876.40
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	365	181.93	66,404.45
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	280	214.03	59,928.40
CINTAS CORP	960	207.41	199,113.60
COPART INC	2,080	51.71	107,556.80
DAYFORCE INC	300	64.84	19,452.00
EQUIFAX INC	290	269.89	78,268.10
JACOBS SOLUTIONS INC	290	140.52	40,750.80
LEIDOS HOLDINGS INC	309	168.71	52,131.39
PAYCHEX INC	790	140.33	110,860.70
PAYCOM SOFTWARE INC	160	164.63	26,340.80
REPUBLIC SERVICES INC	580	199.83	115,901.40
ROLLINS INC	910	46.54	42,351.40
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	603	70.04	42,234.12
TRANSUNION	455	103.59	47,133.45
VERALTO CORP	596	104.05	62,013.80
VERISK ANALYTICS INC	360	264.65	95,274.00
WASTE CONNECTIONS INC	760	175.80	133,608.00
WASTE MANAGEMENT INC	1,080	206.80	223,344.00
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	300	108.12	32,436.00
CSX CORP	5,150	33.27	171,340.50
DELTA AIR LINES INC	276	54.12	14,937.12
EXPEDITORS INTL WASH INC	430	119.84	51,531.20
FEDEX CORP	610	272.12	165,993.20
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	3,920	4.07	15,954.40
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	219	174.83	38,287.77
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	463	52.55	24,330.65
NORFOLK SOUTHERN CORP	560	251.09	140,610.40
OLD DOMINION FREIGHT LINE	500	197.79	98,895.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	466	29.43	13,714.38
U-HAUL HOLDING CO	230	65.56	15,078.80
UBER TECHNOLOGIES INC	4,990	77.62	387,323.80
UNION PACIFIC CORP	1,590	230.30	366,177.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,960	137.43	269,362.80
APTIV PLC	720	69.31	49,903.20

FORD MOTOR COMPANY	10,870	11.07	120,330.90
GENERAL MOTORS CORP	3,060	52.07	159,334.20
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	1,840	10.45	19,228.00
TESLA INC	7,560	269.19	2,035,076.40
DECKERS OUTDOOR CORP	420	168.11	70,606.20
DR HORTON INC	790	179.24	141,599.60
GARMIN LTD	460	162.30	74,658.00
LENNAR CORP-CL A	610	173.28	105,700.80
LULULEMON ATHLETICA INC	310	304.15	94,286.50
NIKE INC -CL B	3,260	78.85	257,051.00
NVR INC	10	9,329.74	93,297.40
PULTE GROUP INC	610	132.47	80,806.70
AIRBNB INC-CLASS A	1,110	134.58	149,383.80
BOOKING HOLDINGS INC	90	4,347.82	391,303.80
CARNIVAL CORP	2,298	20.91	48,051.18
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,500	59.44	208,040.00
DARDEN RESTAURANTS INC	311	159.92	49,735.12
DOMINO'S PIZZA INC	93	413.81	38,484.33
DOORDASH INC - A	730	153.88	112,332.40
DRAFTKINGS INC-CL A	1,130	36.47	41,211.10
EXPEDIA GROUP INC	390	158.39	61,772.10
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	440	224.92	98,964.80
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	610	236.11	144,027.10
HYATT HOTELS CORP - CL A	130	154.56	20,092.80
LAS VEGAS SANDS CORP	909	52.76	47,958.84
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	600	262.12	157,272.00
MCDONALD'S CORP	1,900	292.61	555,959.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	761	40.36	30,713.96
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	680	200.91	136,618.80
STARBUCKS CORP	3,050	97.31	296,795.50
WYNN RESORTS LTD	210	97.99	20,577.90
YUM! BRANDS INC	730	133.04	97,119.20
ALPHABET INC-CL A	15,420	165.27	2,548,463.40
ALPHABET INC-CL C	13,330	166.99	2,225,976.70
CHARTER COMMUNICATION-A	250	336.00	84,000.00
COMCAST CORP-CLASS A	10,310	41.66	429,514.60

ELECTRONIC ARTS INC	620	145.20	90,024.00
FOX CORP - CLASS A	730	41.71	30,448.30
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	932	29.80	27,773.60
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	514	79.15	40,683.10
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	440	116.32	51,180.80
MATCH GROUP INC	682	37.21	25,377.22
META PLATFORMS INC-CLASS A	5,760	573.25	3,301,920.00
NETFLIX INC	1,130	754.68	852,788.40
NEWS CORP - CLASS A	1,450	25.99	37,685.50
OMNICOM GROUP	510	100.52	51,265.20
PARAMOUNT GLOBAL	1,604	10.27	16,473.08
PINTEREST INC- CLASS A	1,460	32.35	47,231.00
ROBLOX CORP -CLASS A	1,150	42.14	48,461.00
ROKU INC	306	75.27	23,032.62
SEA LTD-ADR	950	99.15	94,192.50
SNAP INC - A	2,685	10.45	28,058.25
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	417	161.79	67,466.43
THE WALT DISNEY CO.	4,870	95.03	462,796.10
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1,230	119.47	146,948.10
WARNER BROS DISCOVERY INC	6,490	7.60	49,324.00
AMAZON.COM INC	24,620	187.83	4,624,374.60
AUTOZONE INC	50	3,130.96	156,548.00
BATH & BODY WORKS INC	593	30.38	18,015.34
BEST BUY CO INC	559	92.68	51,808.12
BURLINGTON STORES INC	158	251.65	39,760.70
CARMAX INC	443	72.00	31,896.00
DICK'S SPORTING GOODS INC	160	204.37	32,699.20
EBAY INC	1,170	63.10	73,827.00
GENUINE PARTS CO	390	114.24	44,553.60
HOME DEPOT INC	2,610	398.91	1,041,155.10
LKQ CORP	715	37.55	26,848.25
LOWE'S COS INC	1,500	267.64	401,460.00
MERCADOLIBRE INC	120	2,047.35	245,682.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	150	1,195.22	179,283.00
POOL CORP	94	366.00	34,404.00
ROSS STORES INC	810	144.22	116,818.20

TJX COMPANIES INC	2,960	113.82	336,907.20
TRACTOR SUPPLY COMPANY	288	272.77	78,557.76
ULTA BEAUTY INC	130	373.30	48,529.00
WILLIAMS-SONOMA INC	320	134.76	43,123.20
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	730	18.41	13,439.30
COSTCO WHOLESALE CORP	1,160	891.22	1,033,815.20
DOLLAR GENERAL CORP	550	80.38	44,209.00
DOLLAR TREE INC	490	66.45	32,560.50
KROGER CO	1,730	57.37	99,250.10
SYSCO CORP	1,330	73.92	98,313.60
TARGET CORP	1,170	151.16	176,857.20
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,830	9.26	16,945.80
WALMART INC	11,510	82.51	949,690.10
ALTRIA GROUP INC	4,350	49.71	216,238.50
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,370	56.56	77,487.20
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	720	48.37	34,826.40
BUNGE GLOBAL SA	384	89.78	34,475.52
CAMPBELL SOUP CO	618	47.07	29,089.26
CELSIUS HOLDINGS INC	350	31.66	11,081.00
COCA-COLA CO/THE	10,630	66.92	711,359.60
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	578	77.98	45,072.44
CONAGRA BRANDS INC	1,363	29.43	40,113.09
CONSTELLATION BRANDS INC-A	420	239.38	100,539.60
GENERAL MILLS INC	1,480	68.30	101,084.00
HERSHEY CO/THE	373	181.26	67,609.98
HORMEL FOODS CORP	990	31.06	30,749.40
JM SMUCKER CO/THE	281	116.07	32,615.67
KELLANOVA	840	80.88	67,939.20
KEURIG DR PEPPER INC	2,840	34.58	98,207.20
KRAFT HEINZ CO/THE	2,450	34.74	85,113.00
LAMB WESTON HOLDING INC	370	76.92	28,460.40
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	670	77.86	52,166.20
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	620	55.77	34,577.40
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	3,500	69.23	242,305.00
MONSTER BEVERAGE CORP	1,990	53.37	106,206.30
PEPSICO INC	3,560	171.79	611,572.40

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	4,040	129.86	524,634.40
TYSON FOODS INC-CL A	731	58.67	42,887.77
CHURCH & DWIGHT CO INC	624	100.84	62,924.16
CLOROX COMPANY	311	156.69	48,730.59
COLGATE-PALMOLIVE CO	1,980	95.61	189,307.80
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	610	87.25	53,222.50
KENVUE INC	5,210	22.64	117,954.40
KIMBERLY-CLARK CORP	840	135.52	113,836.80
PROCTER & GAMBLE CO	6,150	168.22	1,034,553.00
ABBOTT LABORATORIES	4,570	114.22	521,985.40
ALIGN TECHNOLOGY INC	189	219.30	41,447.70
BAXTER INTERNATIONAL INC	1,380	35.97	49,638.60
BECTON DICKINSON AND CO	720	238.13	171,453.60
BOSTON SCIENTIFIC CORP	3,860	84.73	327,057.80
CARDINAL HEALTH INC	600	110.89	66,534.00
CENCORA INC	460	234.47	107,856.20
CENTENE CORP	1,450	64.22	93,119.00
CIGNA GROUP/THE	740	316.85	234,469.00
COOPER COS INC/THE	552	107.82	59,516.64
CVS HEALTH CORP	3,350	56.49	189,241.50
DAVITA INC	130	156.99	20,408.70
DEXCOM INC	1,140	73.44	83,721.60
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,620	69.38	112,395.60
ELEVANCE HEALTH INC	600	425.27	255,162.00
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	1,180	88.42	104,335.60
HCA HEALTHCARE INC	510	363.55	185,410.50
HENRY SCHEIN INC	310	70.00	21,700.00
HOLOGIC INC	640	80.83	51,731.20
HUMANA INC	320	260.73	83,433.60
IDEXX LABORATORIES INC	200	451.41	90,282.00
INSULET CORP	183	233.63	42,754.29
INTUITIVE SURGICAL INC	940	511.27	480,593.80
LABCORP HOLDINGS INC	230	228.63	52,584.90
MCKESSON CORP	320	507.41	162,371.20
MEDTRONIC PLC	3,430	90.59	310,723.70
MOLINA HEALTHCARE INC	160	325.54	52,086.40

QUEST DIAGNOSTICS	309	155.04	47,907.36
RESMED INC	410	256.07	104,988.70
SOLVENTUM CORP	352	73.19	25,762.88
STERIS PLC	230	224.12	51,547.60
STRYKER CORP	910	352.82	321,066.20
TELEFLEX INC	138	233.63	32,240.94
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,410	564.56	1,360,589.60
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	184	202.75	37,306.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	380	212.23	80,647.40
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	540	102.35	55,269.00
ABBVIE INC	4,630	187.85	869,745.50
AGILENT TECHNOLOGIES INC	760	130.19	98,944.40
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	340	284.86	96,852.40
AMGEN INC	1,400	316.98	443,772.00
AVANTOR INC	2,120	22.43	47,551.60
BIO-RAD LABORATORIES-A	64	320.23	20,494.72
BIO-TECHNE CORP	388	68.68	26,647.84
BIOGEN INC	350	181.69	63,591.50
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	488	69.73	34,028.24
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	5,380	51.92	279,329.60
CATALENT INC	429	59.09	25,349.61
CHARLES RIVER LABORATORIES	125	182.12	22,765.00
DANAHER CORP	1,760	245.39	431,886.40
ELI LILLY & CO	2,120	892.70	1,892,524.00
EXACT SCIENCES CORP	426	69.11	29,440.86
GILEAD SCIENCES INC	3,180	89.00	283,020.00
ILLUMINA INC	440	141.95	62,458.00
INCYTE CORP	600	65.07	39,042.00
IQVIA HOLDINGS INC	520	214.63	111,607.60
JOHNSON & JOHNSON	6,280	160.88	1,010,326.40
MERCK & CO. INC.	6,650	103.98	691,467.00
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	50	1,292.77	64,638.50
MODERNA INC	790	53.09	41,941.10
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	220	116.08	25,537.60
PFIZER INC	15,050	28.45	428,172.50
REGENERON PHARMACEUTICALS	280	933.02	261,245.60

REVVITY INC	380	116.33	44,205.40
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	845	26.95	22,772.75
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	2,710	17.90	48,509.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,010	554.38	559,923.80
UNITED THERAPEUTICS CORP	130	348.65	45,324.50
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	680	477.70	324,836.00
VIATRIS INC	3,111	11.44	35,589.84
WATERS CORP	130	324.55	42,191.50
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	199	307.92	61,276.08
ZOETIS INC	1,220	180.01	219,612.20
BANK OF AMERICA CORP	18,410	41.89	771,194.90
CITIGROUP INC	5,060	61.76	312,505.60
CITIZENS FINANCIAL GROUP	960	41.51	39,849.60
FIFTH THIRD BANCORP	1,760	43.22	76,067.20
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	30	1,881.83	56,454.90
HUNTINGTON BANCSHARES INC	4,310	15.38	66,287.80
JPMORGAN CHASE & CO	7,500	222.31	1,667,325.00
KEYCORP	2,531	17.04	43,128.24
M & T BANK CORP	450	192.57	86,656.50
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,040	185.82	193,252.80
REGIONS FINANCIAL CORP	2,407	23.50	56,564.50
TRUIST FINANCIAL CORP	3,610	42.63	153,894.30
US BANCORP	4,230	47.74	201,940.20
WELLS FARGO & CO	9,040	64.53	583,351.20
ALLY FINANCIAL INC	600	34.42	20,652.00
AMERICAN EXPRESS CO	1,530	267.35	409,045.50
AMERIPRISE FINANCIAL INC	240	504.48	121,075.20
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	1,000	143.09	143,090.00
ARES MANAGEMENT CORP-A	560	169.47	94,903.20
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	2,120	75.20	159,424.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	3,470	454.01	1,575,414.70
BLACKROCK INC	390	974.07	379,887.30
BLACKSTONE INC	1,900	167.50	318,250.00
BLOCK INC	1,370	72.61	99,475.70
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,070	161.27	172,558.90
CARLYLE GROUP INC/THE	590	50.22	29,629.80

CBOE GLOBAL MARKETS INC	306	212.82	65,122.92
CME GROUP INC	920	226.14	208,048.80
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	450	205.04	92,268.00
CORPAY INC	192	340.72	65,418.24
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	610	148.90	90,829.00
EQUITABLE HOLDINGS INC	960	44.97	43,171.20
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	120	454.94	54,592.80
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	1,480	89.72	132,785.60
FISERV INC	1,550	199.52	309,256.00
FRANKLIN RESOURCES INC	780	20.37	15,888.60
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	139	92.58	12,868.62
GLOBAL PAYMENTS INC	700	99.13	69,391.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	840	512.60	430,584.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,500	165.31	247,965.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	201	182.44	36,670.44
KKR & CO INC -A	1,680	139.88	234,998.40
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	200	260.93	52,186.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	94	286.45	26,926.30
MASTERCARD INC - A	2,190	507.36	1,111,118.40
MOODY'S CORP	410	462.80	189,748.00
MORGAN STANLEY	3,210	116.88	375,184.80
MSCI INC	200	588.72	117,744.00
NASDAQ INC	1,190	74.69	88,881.10
NORTHERN TRUST CORP	508	100.19	50,896.52
PAYPAL HOLDINGS INC	2,690	81.70	219,773.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	570	144.91	82,598.70
ROBINHOOD MARKETS INC - A	1,190	27.06	32,201.40
S&P GLOBAL INC	860	490.61	421,924.60
SCHWAB (CHARLES) CORP	4,000	71.82	287,280.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	347	75.10	26,059.70
STATE STREET CORP	790	90.38	71,400.20
SYNCHRONY FINANCIAL	1,226	55.15	67,613.90
T ROWE PRICE GROUP INC	690	111.33	76,817.70
TOAST INC-CLASS A	990	29.49	29,195.10
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	333	132.50	44,122.50
VISA INC-CLASS A SHARES	4,140	281.73	1,166,362.20

AFLAC INC	1,400	109.75	153,650.00
ALLSTATE CORP	640	188.12	120,396.80
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	204	129.41	26,399.64
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,790	76.82	137,507.80
AON PLC	510	375.44	191,474.40
ARCH CAPITAL GROUP LTD	955	105.30	100,561.50
ARTHUR J GALLAGHER & CO	540	282.97	152,803.80
ASSURANT INC	167	191.77	32,025.59
BROWN & BROWN INC	595	103.98	61,868.10
CHUBB LTD	1,000	287.99	287,990.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	382	141.25	53,957.50
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	70	444.02	31,081.40
EVEREST GROUP LTD	105	379.61	39,859.05
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	870	59.96	52,165.20
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	800	112.26	89,808.00
LOEWS CORP	575	79.57	45,752.75
MARKEL GROUP INC	34	1,549.80	52,693.20
MARSH & MCLENNAN COS	1,290	221.31	285,489.90
METLIFE INC	1,490	82.39	122,761.10
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	658	83.71	55,081.18
PROGRESSIVE CORP	1,520	243.78	370,545.60
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,050	123.46	129,633.00
TRAVELERS COS INC/THE	620	250.50	155,310.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	280	290.45	81,326.00
WR BERKLEY CORP	900	58.16	52,344.00
ACCENTURE PLC-CL A	1,650	360.80	595,320.00
ADOBE INC	1,170	483.72	565,952.40
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	400	101.97	40,788.00
ANSYS INC	210	322.81	67,790.10
APPROVIN CORP-CLASS A	580	161.63	93,745.40
ASPEN TECHNOLOGY INC	100	236.77	23,677.00
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	430	188.73	81,153.90
AUTODESK INC	520	286.04	148,740.80
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	519	49.15	25,508.85
CADENCE DESIGN SYS INC	680	257.30	174,964.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	200	207.16	41,432.00

CLOUDFLARE INC-CLASS A	780	88.76	69,232.80
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	1,300	74.82	97,266.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	620	300.62	186,384.40
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	121	290.04	35,094.84
DATADOG INC-CLASS A	780	126.60	98,748.00
DOCUSIGN INC	501	68.99	34,563.99
DYNATRACE INC	565	54.07	30,549.55
EPAM SYSTEMS INC	180	191.52	34,473.60
FAIR ISAAC CORP	62	1,999.97	123,998.14
FORTINET INC	1,750	80.34	140,595.00
GARTNER INC	210	513.36	107,805.60
GEN DIGITAL INC	1,407	26.97	37,946.79
GODADDY INC-CLASS A	320	160.53	51,369.60
HUBSPOT INC	123	565.67	69,577.41
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,390	214.67	513,061.30
INTUIT INC	740	609.27	450,859.80
MANHATTAN ASSOCIATES INC	170	275.70	46,869.00
MICROSOFT CORP	18,550	428.15	7,942,182.50
MICROSTRATEGY INC-CL A	400	234.34	93,736.00
MONDAY.COM LTD	80	299.61	23,968.80
MONGODB INC	180	268.74	48,373.20
OKTA INC	349	72.24	25,211.76
ORACLE CORP	4,360	173.52	756,547.20
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	5,420	44.86	243,141.20
PALO ALTO NETWORKS INC	860	366.44	315,138.40
PTC INC	270	187.01	50,492.70
ROPER TECHNOLOGIES INC	290	542.00	157,180.00
SALESFORCE INC	2,560	290.46	743,577.60
SAMSARA INC-CL A	410	47.69	19,552.90
SERVICENOW INC	540	950.85	513,459.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	720	116.04	83,548.80
SYNOPSYS INC	410	501.58	205,647.80
TWILIO INC - A	437	70.47	30,795.39
TYLER TECHNOLOGIES INC	100	605.86	60,586.00
VERISIGN INC	250	181.26	45,315.00
WIX.COM LTD	150	164.27	24,640.50

WORKDAY INC-CLASS A	580	237.71	137,871.80
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	567	72.63	41,181.21
ZSCALER INC	227	184.96	41,985.92
AMPHENOL CORP-CL A	3,290	69.41	228,358.90
APPLE INC	38,260	231.41	8,853,746.60
ARISTA NETWORKS INC	700	394.09	275,863.00
CDW CORP/DE	330	217.01	71,613.30
CISCO SYSTEMS INC	10,480	55.74	584,155.20
CORNING INC	2,060	46.25	95,275.00
DELL TECHNOLOGIES -C	770	122.55	94,363.50
F5 INC	167	216.87	36,217.29
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	3,350	19.46	65,191.00
HP INC	2,760	36.88	101,788.80
JABIL INC	360	124.72	44,899.20
JUNIPER NETWORKS INC	802	39.08	31,342.16
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	400	155.98	62,392.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	410	462.32	189,551.20
NETAPP INC	510	119.41	60,899.10
PURE STORAGE INC - CLASS A	790	54.05	42,699.50
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	463	103.01	47,693.63
SUPER MICRO COMPUTER INC	1,300	47.27	61,451.00
TE CONNECTIVITY PLC	770	149.13	114,830.10
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	120	469.19	56,302.80
TRIMBLE INC	530	60.90	32,277.00
WESTERN DIGITAL CORP	807	69.45	56,046.15
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	120	360.09	43,210.80
AT&T INC	18,830	21.83	411,058.90
T-MOBILE US INC	1,360	226.36	307,849.60
VERIZON COMMUNICATIONS INC	11,110	41.38	459,731.80
AES CORP	2,110	16.96	35,785.60
ALLIANT ENERGY CORP	780	60.74	47,377.20
AMEREN CORPORATION	860	87.80	75,508.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	1,430	98.19	140,411.70
AMERICAN WATER WORKS CO INC	520	137.66	71,583.20
ATMOS ENERGY CORP	430	140.72	60,509.60
CENTERPOINT ENERGY INC	1,340	29.31	39,275.40

CMS ENERGY CORP	650	70.76	45,994.00
CONSOLIDATED EDISON INC	980	104.60	102,508.00
CONSTELLATION ENERGY	840	264.41	222,104.40
DOMINION ENERGY INC	2,040	59.58	121,543.20
DTE ENERGY COMPANY	510	126.57	64,550.70
DUKE ENERGY CORP	2,050	117.21	240,280.50
EDISON INTERNATIONAL	910	83.91	76,358.10
ENTERGY CORP	590	135.38	79,874.20
ESSENTIAL UTILITIES INC	610	38.84	23,692.40
EVERGY INC	730	60.77	44,362.10
EVERSOURCE ENERGY	1,150	65.84	75,716.00
EXELON CORP	2,340	40.07	93,763.80
FIRSTENERGY CORP	1,610	43.41	69,890.10
NEXTERA ENERGY INC	5,420	81.43	441,350.60
NISOURCE INC	1,151	34.82	40,077.82
NRG ENERGY INC	520	87.53	45,515.60
P G & E CORP	5,830	20.36	118,698.80
PPL CORP	2,470	32.43	80,102.10
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	1,190	89.63	106,659.70
SEMPRA	1,570	84.38	132,476.60
SOUTHERN CO	2,850	91.88	261,858.00
VISTRA CORP	921	124.03	114,231.63
WEC ENERGY GROUP INC	740	97.19	71,920.60
XCEL ENERGY INC	1,520	64.46	97,979.20
ADVANCED MICRO DEVICES	4,260	156.23	665,539.80
ANALOG DEVICES INC	1,330	230.17	306,126.10
APPLIED MATERIALS INC	2,160	186.52	402,883.20
BROADCOM INC	11,610	173.00	2,008,530.00
ENPHASE ENERGY INC	400	83.83	33,532.00
ENTEGRIS INC	410	105.01	43,054.10
FIRST SOLAR INC	250	198.47	49,617.50
INTEL CORP	11,400	22.68	258,552.00
KLA CORP	350	673.07	235,574.50
LAM RESEARCH CORP	3,500	77.68	271,880.00
MARVELL TECHNOLOGY INC	2,330	81.61	190,151.30
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	1,370	76.29	104,517.30

	MICRON TECHNOLOGY INC	2,930	107.91	316,176.30	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	130	901.29	117,167.70	
	NVIDIA CORP	64,600	141.54	9,143,484.00	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	680	243.16	165,348.80	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	1,100	71.25	78,375.00	
	QORVO INC	316	99.01	31,287.16	
	QUALCOMM INC	2,930	170.27	498,891.10	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	437	95.20	41,602.40	
	TERADYNE INC	403	111.75	45,035.25	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	2,380	206.93	492,493.40	
	CBRE GROUP INC - A	850	132.54	112,659.00	
	COSTAR GROUP INC	1,080	74.48	80,438.40	
	ZILLOW GROUP INC - C	478	59.65	28,512.70	
	米ドル小計	965,243		130,622,035.14 (20,043,951,292)	
加ドル	ARC RESOURCES LTD	1,760	24.02	42,275.20	
	CAMECO CORP	960	74.76	71,769.60	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	5,340	49.39	263,742.60	
	CENOVUS ENERGY INC	3,390	23.48	79,597.20	
	ENBRIDGE INC	5,930	56.93	337,594.90	
	IMPERIAL OIL LTD	600	105.72	63,432.00	
	KEYERA CORP	660	42.94	28,340.40	
	PARKLAND CORP	500	34.44	17,220.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	1,530	59.07	90,377.10	
	SUNCOR ENERGY INC	3,410	54.16	184,685.60	
	TC ENERGY CORP	2,970	65.68	195,069.60	
	TOURMALINE OIL CORP	870	64.81	56,384.70	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	1,300	120.79	157,027.00	
	BARRICK GOLD CORP	4,940	27.26	134,664.40	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	530	82.73	43,846.90	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	1,389	18.91	26,265.99	
	FRANCO-NEVADA CORP	507	188.50	95,569.50	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	1,881	19.25	36,209.25	
	KINROSS GOLD CORP	4,540	14.62	66,374.80	
	NUTRIEN LTD	1,310	66.60	87,246.00	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	611	34.37	21,000.07	

TECK RESOURCES LTD-CLS B	1,299	65.80	85,474.20
WEST FRASER TIMBER CO LTD	150	135.46	20,319.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,240	91.91	113,968.40
CAE INC	753	25.81	19,434.93
STANTEC INC	290	113.64	32,955.60
TOROMONT INDUSTRIES LTD	270	126.09	34,044.30
WSP GLOBAL INC	330	248.34	81,952.20
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	1,200	28.58	34,296.00
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	503	55.68	28,007.04
RB GLOBAL INC	520	118.00	61,360.00
THOMSON REUTERS CORP	430	229.02	98,478.60
AIR CANADA	550	18.92	10,406.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,530	154.25	236,002.50
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	2,370	107.18	254,016.60
TFI INTERNATIONAL INC	260	185.88	48,328.80
MAGNA INTERNATIONAL INC	590	58.35	34,426.50
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	670	98.06	65,700.20
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	139	156.92	21,811.88
DOLLARAMA INC	750	141.66	106,245.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	2,100	71.43	150,003.00
LOBLAW COMPANIES LTD	480	173.00	83,040.00
METRO INC	776	81.71	63,406.96
WESTON (GEORGE) LTD	220	218.33	48,032.60
SAPUTO INC	748	27.25	20,383.00
BANK OF MONTREAL	2,070	128.95	266,926.50
BANK OF NOVA SCOTIA	3,020	71.99	217,409.80
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	2,540	87.32	221,792.80
NATIONAL BANK OF CANADA	855	131.67	112,577.85
ROYAL BANK OF CANADA	3,720	170.22	633,218.40
TORONTO-DOMINION BANK	4,620	78.30	361,746.00
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	980	72.91	71,451.80
BROOKFIELD CORP	3,460	74.35	257,251.00
TMX GROUP LTD	1,090	42.85	46,706.50
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	60	1,736.70	104,202.00
GREAT-WEST LIFE CO INC	917	47.01	43,108.17
INTACT FINANCIAL CORP	473	267.38	126,470.74

	MANULIFE FINANCIAL CORP	4,570	41.41	189,243.70
	POWER CORP OF CANADA	1,536	44.15	67,814.40
	SUN LIFE FINANCIAL INC	1,430	78.40	112,112.00
	CGI INC	605	157.25	95,136.25
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	60	4,281.75	256,905.00
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	270	144.62	39,047.40
	OPEN TEXT CORP	973	46.23	44,981.79
	SHOPIFY INC - CLASS-A	3,290	109.84	361,373.60
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	971	51.60	50,103.60
	TELUS CORP	1,220	22.00	26,840.00
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	411	46.34	19,045.74
	EMERA INC	675	53.13	35,862.75
	FORTIS INC	1,170	60.89	71,241.30
	HYDRO ONE LTD	950	45.39	43,120.50
	FIRSTSERVICE CORP	137	263.60	36,113.20
加ドル小計		105,169		7,762,588.91 (857,610,822)
ユーロ	ENI SPA	6,760	14.42	97,533.28
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	1,090	16.60	18,099.45
	NESTE OYJ	1,076	14.79	15,914.04
	OMV AG	430	38.98	16,761.40
	REPSOL SA	3,620	11.96	43,313.30
	TENARIS SA	1,520	14.81	22,518.80
	TOTALENERGIES SE	5,790	60.27	348,963.30
	AIR LIQUIDE SA	1,560	167.44	261,206.40
	AKZO NOBEL	468	59.46	27,827.28
	ARCELORMITTAL	1,590	22.23	35,345.70
	ARKEMA	208	80.80	16,806.40
	BASF SE	2,440	46.17	112,654.80
	COVESTRO AG	543	58.20	31,602.60
	DSM-FIRMENICH AG	480	114.75	55,080.00
	HEIDELBERG MATERIALS AG	333	99.02	32,973.66
	STORA ENSO OYJ-R SHS	1,558	10.70	16,670.60
	SYENSCO SA	192	73.07	14,029.44
	SYMRISE AG	480	113.60	54,528.00
	UPM-KYMMENE OYJ	1,438	28.96	41,644.48

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	468	43.76	20,479.68
AIRBUS GROUP SE	1,610	140.48	226,172.80
ALSTOM	1,050	20.55	21,577.50
BRENTAG SE	402	61.62	24,771.24
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	1,440	81.88	117,907.20
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	1,179	39.17	46,181.43
EIFFAGE	260	85.38	22,198.80
FERROVIAL SE	1,472	37.20	54,758.40
IMCD NV	150	149.75	22,462.50
KINGSPAN GROUP PLC	320	78.95	25,264.00
KNORR-BREMSE AG	225	79.70	17,932.50
KONE OYJ-B	899	51.22	46,046.78
LEGRAND SA	680	104.50	71,060.00
LEONARDO SPA	1,000	21.79	21,790.00
METSO CORPORATION	1,250	9.03	11,290.00
MTU AERO ENGINES AG	140	309.00	43,260.00
PRYSMIAN SPA	690	68.00	46,920.00
RATIONAL AG	15	924.50	13,867.50
RHEINMETALL AG	110	485.80	53,438.00
SAFRAN SA	990	211.50	209,385.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,470	242.35	356,254.50
SIEMENS AG-REG	2,040	180.42	368,056.80
SIEMENS ENERGY AG	1,430	38.35	54,840.50
THALES SA	230	152.05	34,971.50
VINCI SA	1,360	100.75	137,020.00
WARTSILA OYJ ABP	1,289	20.06	25,857.34
BUREAU VERITAS SA	1,035	29.26	30,284.10
TELEPERFORMANCE	160	96.06	15,369.60
WOLTERS KLUWER	640	158.70	101,568.00
ADP	93	109.30	10,164.90
AENA SA	247	204.80	50,585.60
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,970	6.72	13,246.28
DEUTSCHE POST AG-REG	2,730	37.72	102,975.60
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	950	76.00	72,200.00
CONTINENTAL AG	268	58.70	15,731.60
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	300	70.28	21,084.00

FERRARI NV	330	450.10	148,533.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	2,010	57.79	116,157.90
MICHELIN (CGDE)	1,690	31.16	52,660.40
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	404	40.37	16,309.48
RENAULT SA	490	43.10	21,119.00
STELLANTIS NV	5,450	12.67	69,062.40
VOLKSWAGEN AG-PFD	740	92.28	68,287.20
ADIDAS AG	390	217.00	84,630.00
HERMES INTERNATIONAL	90	2,105.00	189,450.00
KERING	180	234.95	42,291.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	730	627.00	457,710.00
MONCLER SPA	532	54.06	28,759.92
PUMA SE	260	42.54	11,060.40
ACCOR SA	541	41.79	22,608.39
AMADEUS IT GROUP SA	1,320	67.24	88,756.80
DELIVERY HERO SE	387	41.00	15,867.00
SODEXO SA	273	80.10	21,867.30
PUBLICIS GROUPE	590	99.38	58,634.20
SCOUT24 SE	240	80.60	19,344.00
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	2,083	23.61	49,179.63
VIVENDI SE	2,083	10.22	21,298.67
INDITEX	2,980	54.56	162,588.80
PROSUS NV	4,100	39.70	162,790.50
ZALANDO SE	601	29.13	17,507.13
CARREFOUR SA	1,713	14.60	25,009.80
JERONIMO MARTINS	860	16.80	14,448.00
KESKO OYJ-B SHS	643	17.89	11,503.27
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	2,610	30.71	80,153.10
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	2,670	59.54	158,971.80
DANONE	1,720	65.78	113,141.60
HEINEKEN HOLDING NV	410	67.15	27,531.50
HEINEKEN NV	730	79.62	58,122.60
KERRY GROUP PLC-A	390	94.75	36,952.50
PERNOD-RICARD SA	500	123.35	61,675.00
BEIERSDORF AG	230	129.00	29,670.00
HENKEL AG & CO KGAA	400	74.20	29,680.00

HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	600	81.98	49,188.00
L' OREAL	650	355.65	231,172.50
AMPLIFON SPA	380	27.46	10,434.80
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	135	62.80	8,478.00
ESSILORLUXOTTICA	790	219.50	173,405.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	585	39.02	22,826.70
FRESENIUS SE & CO KGAA	1,254	33.86	42,460.44
KONINKLIJKE PHILIPS NV	2,569	29.48	75,734.12
SIEMENS HEALTHINEERS AG	723	51.32	37,104.36
ARGENX SE	180	521.00	93,780.00
BAYER AG-REG	3,010	25.75	77,507.50
EUROFINS SCIENTIFIC	362	46.73	16,916.26
IPSEN	120	115.30	13,836.00
MERCK KGAA	290	156.30	45,327.00
QIAGEN N. V.	533	38.72	20,637.76
SANOFI	3,070	100.08	307,245.60
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	60	244.60	14,676.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	76	188.80	14,348.80
UCB SA	330	178.75	58,987.50
ABN AMRO BANK NV-CVA	809	15.23	12,321.07
AIB GROUP PLC	3,990	4.85	19,351.50
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	15,320	9.04	138,523.44
BANCO BPM SPA	4,100	6.08	24,960.80
BANCO DE SABADELL SA	14,440	1.80	26,064.20
BANCO SANTANDER SA	38,920	4.57	178,078.46
BANK OF IRELAND GROUP PLC	3,690	8.85	32,686.02
BNP PARIBAS	2,840	65.33	185,537.20
CAIXABANK S. A	11,895	5.36	63,780.99
COMMERZBANK AG	2,690	16.15	43,443.50
CREDIT AGRICOLE SA	3,122	14.00	43,708.00
ERSTE GROUP BANK AG	820	48.84	40,048.80
FINECOBANK SPA	1,495	15.01	22,447.42
ING GROEP NV-CVA	9,000	15.67	141,102.00
INTESA SANPAOLO	40,460	3.87	156,822.96
KBC GROEP NV	743	67.58	50,211.94
MEDIOBANCA SPA	1,030	15.34	15,805.35

NORDEA BANK ABP	7,720	10.84	83,684.80
SOCIETE GENERALE	1,600	23.72	37,952.00
UNICREDIT SPA	3,890	40.15	156,202.95
ADYEN NV	60	1,417.60	85,056.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	4,610	15.67	72,266.36
DEUTSCHE BOERSE AG	530	216.00	114,480.00
EDENRED	658	28.93	19,035.94
EURONEXT NV	240	103.00	24,720.00
EXOR NV	344	99.80	34,331.20
NEXI SPA	1,336	5.86	7,828.96
AEGON LTD	4,432	5.88	26,095.61
ALLIANZ SE-REG	1,060	293.80	311,428.00
AXA SA	4,660	34.89	162,587.40
GENERALI	2,840	25.96	73,726.40
HANNOVER RUECK SE-REG	148	245.40	36,319.20
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	340	469.50	159,630.00
NN GROUP NV	680	46.01	31,286.80
SAMPO OYJ-A SHS	1,336	40.62	54,268.32
BECHTLE AG	230	33.92	7,801.60
CAP GEMINI SA	390	175.05	68,269.50
DASSAULT SYSTEMES SE	1,860	31.52	58,627.20
NEMETSCHEK SE	178	101.90	18,138.20
SAP SE	2,780	221.05	614,519.00
NOKIA OYJ	14,570	4.41	64,319.26
CELLNEX TELECOM SA	1,417	35.12	49,765.04
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	9,470	28.10	266,107.00
KONINKLIJKE KPN NV	9,792	3.75	36,778.75
ORANGE S. A.	5,254	10.10	53,091.67
TELECOM ITALIA SPA	22,100	0.24	5,308.42
TELEFONICA SA	13,410	4.33	58,105.53
E.ON SE	5,959	12.75	75,977.25
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	9,250	3.76	34,798.50
ENEL SPA	21,380	7.18	153,679.44
ENGIE	4,990	15.65	78,093.50
FORTUM OYJ	1,026	14.22	14,589.72
IBERDROLA SA	16,640	13.95	232,128.00

	RWE AG	1,700	30.71	52,207.00	
	SNAM SPA	7,266	4.49	32,646.13	
	TERNA SPA	4,271	8.09	34,552.39	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	2,070	29.11	60,257.70	
	VERBUND AG	152	78.80	11,977.60	
	ASM INTERNATIONAL NV	116	521.00	60,436.00	
	ASML HOLDING NV	1,060	664.10	703,946.00	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	180	105.65	19,017.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	3,220	30.70	98,854.00	
	STMICROELECTRONICS NV	1,810	26.17	47,367.70	
	LEG IMMOBILIEN SE	250	88.92	22,230.00	
	VONOVIA SE	1,810	30.98	56,073.80	
ユーロ小計		475,674		13,473,301.70	(2,231,852,426)
英ポンド	BP PLC	44,330	4.04	179,492.17	
	SHELL PLC-NEW	16,550	25.50	422,107.75	
	ANGLO AMERICAN PLC	3,170	24.34	77,173.65	
	ANTOFAGASTA PLC	1,183	18.11	21,424.13	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	385	37.18	14,314.30	
	GLENORE PLC	31,150	4.04	125,908.30	
	MONDI PLC	1,253	12.72	15,938.16	
	RIO TINTO PLC	2,840	50.22	142,624.80	
	ASHTED GROUP PLC	1,030	58.58	60,337.40	
	BAE SYSTEMS PLC ORD	8,500	12.92	109,820.00	
	BUNZL PLC	865	34.72	30,032.80	
	DCC PLC	217	50.55	10,969.35	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	3,490	4.43	15,460.70	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	23,180	5.56	128,927.16	
	SPIRAX GROUP PLC	235	67.70	15,909.50	
	EXPERIAN PLC	2,560	38.68	99,020.80	
	INTERTEK GROUP PLC	590	47.84	28,225.60	
	RELX PLC	4,730	36.44	172,361.20	
	RENTOKIL INITIAL PLC	5,870	3.76	22,118.16	
	BARRATT REDROW PLC	5,720	4.72	27,027.00	
	PERSIMMON PLC	994	15.74	15,645.56	
	TAYLOR WIMPEY PLC	13,940	1.54	21,593.06	

COMPASS GROUP PLC	4,620	25.11	116,008.20
ENTAIN PLC	1,657	7.15	11,854.17
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	510	85.06	43,380.60
PEARSON PLC	1,530	10.43	15,957.90
WHITBREAD PLC	639	32.93	21,042.27
AUTO TRADER GROUP PLC	2,915	8.80	25,663.66
INFORMA PLC	4,393	8.20	36,022.60
WPP PLC	3,319	8.22	27,302.09
JD SPORTS FASHION PLC	8,520	1.31	11,242.14
KINGFISHER PLC	6,190	3.10	19,207.57
NEXT PLC	260	100.00	26,000.00
TESCO PLC	20,870	3.52	73,629.36
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	857	23.10	19,796.70
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	5,510	26.58	146,455.80
COCA-COLA HBC AG-CDI	556	27.76	15,434.56
DIAGEO PLC	6,300	25.65	161,626.50
IMPERIAL BRANDS PLC	2,070	22.89	47,382.30
HALEON PLC	20,850	3.74	78,104.10
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,820	48.49	88,251.80
UNILEVER PLC	6,570	47.62	312,863.40
SMITH & NEPHEW PLC	1,973	10.88	21,466.24
ASTRAZENECA PLC	4,120	116.06	478,167.20
GSK PLC	11,200	14.48	162,232.00
BARCLAYS PLC	35,650	2.41	86,059.10
HSBC HOLDINGS PLC	49,060	6.82	334,638.26
LLOYDS BANKING GROUP PLC	175,380	0.57	101,124.10
NATWEST GROUP PLC	16,560	3.63	60,261.84
STANDARD CHARTERED PLC	5,050	8.53	43,076.50
3I GROUP PLC	2,819	32.78	92,406.82
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	1,370	106.05	145,288.50
WISE PLC - A	1,551	7.35	11,399.85
ADMIRAL GROUP PLC	760	25.72	19,547.20
AVIVA PLC	7,600	4.62	35,157.60
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	14,010	2.20	30,892.05
PRUDENTIAL PLC	6,840	6.47	44,268.48
SAGE GROUP PLC/THE	3,107	10.15	31,536.05

	HALMA PLC	1,095	24.69	27,035.55	
	BT GROUP PLC	16,090	1.44	23,233.96	
	VODAFONE GROUP PLC	59,770	0.73	44,038.53	
	CENTRICA PLC	15,090	1.23	18,598.42	
	NATIONAL GRID PLC	13,600	9.98	135,809.60	
	SEVERN TRENT PLC	682	26.33	17,957.06	
	SSE PLC	2,750	18.29	50,297.50	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,628	10.50	17,094.00	
英ボンド小計		720,493		5,085,243.68 (1,011,556,672)	
スイスフラン	GIVAUDAN-REG	23	4,194.00	96,462.00	
	HOLCIM LTD	1,540	83.04	127,881.60	
	SIG GROUP AG	1,130	18.99	21,458.70	
	SIKA AG-REG	410	247.10	101,311.00	
	ABB LTD-REG	4,300	48.75	209,625.00	
	GEBERIT AG-REG	96	517.20	49,651.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	145	252.80	36,656.00	
	VAT GROUP AG	70	368.00	25,760.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	419	28.00	11,732.00	
	SGS SA-REG	425	91.56	38,913.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	110	220.00	24,200.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	1,460	128.45	187,537.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	95	183.90	17,470.50	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	3	10,540.00	31,620.00	
	NESTLE SA-REG	6,960	84.54	588,398.40	
	ALCON INC	1,390	81.96	113,924.40	
	SONOVA HOLDING AG-REG	153	312.20	47,766.60	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	290	126.70	36,743.00	
	BACHEM HOLDING AG	120	69.70	8,364.00	
	LONZA GROUP AG-REG	190	556.20	105,678.00	
	NOVARTIS AG-REG	5,220	98.66	515,005.20	
	ROCHE HOLDING AG-BR	90	307.20	27,648.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,850	281.20	520,220.00	
	SANDOZ GROUP AG	1,052	38.37	40,365.24	
	JULIUS BAER GROUP LTD	579	54.32	31,451.28	
	PARTNERS GROUP HOLDIING AG	63	1,260.50	79,411.50	

	UBS GROUP AG-REG	8,860	27.87	246,928.20	
	BALOISE HOLDING AG - REG	160	174.20	27,872.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	87	711.60	61,909.20	
	SWISS RE AG	760	111.75	84,930.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	400	518.80	207,520.00	
	TEMENOS AG	155	63.45	9,834.75	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	484	70.28	34,015.52	
	SWISSCOM AG-REG	80	559.00	44,720.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	220	94.55	20,801.00	
スイスフラン小計		39,389		3,833,784.29 (676,586,251)	
スウェーデン ローナ	BOLIDEN AB	620	335.60	208,072.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	1,812	149.20	270,350.40	
	ADDTech AB-B SHARES	1,020	296.00	301,920.00	
	ALFA LAVAL AB	680	481.80	327,624.00	
	ASSA ABLOY AB-B	2,713	334.60	907,769.80	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	6,260	179.55	1,123,983.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	4,540	158.75	720,725.00	
	BEIJER REF AB	960	158.50	152,160.00	
	EPIROC AB-A	2,430	213.90	519,777.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	1,126	70.34	79,202.84	
	INDUTRADE AB	620	295.00	182,900.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	349	298.20	104,071.80	
	LIFCO AB-B SHS	830	321.60	266,928.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	3,908	51.78	202,356.24	
	SAAB AB-B	800	230.70	184,560.00	
	SANDVIK AB	3,052	211.00	643,972.00	
	SKANSKA AB-B SHS	1,056	216.90	229,046.40	
	SKF AB-B SHARES-B	1,125	201.40	226,575.00	
	TRELLEBORG AB-B SHS	840	365.00	306,600.00	
	VOLVO AB-B SHS-B	4,980	277.20	1,380,456.00	
	SECURITAS AB-B SHS	1,160	128.90	149,524.00	
	EVOLUTION AB	458	1,044.50	478,381.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	1,260	172.35	217,161.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,708	304.60	520,256.80		
GETINGE AB-B SHS	650	198.50	129,025.00		

	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	540	346.40	187,056.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	4,444	149.60	664,822.40	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	4,361	111.80	487,559.80	
	SWEDBANK AB - A SHARES	2,010	214.90	431,949.00	
	EQT AB	830	320.00	265,600.00	
	INVESTOR AB-B SHS	4,550	306.00	1,392,300.00	
	ERICSSON LM-B SHS	7,741	89.94	696,225.54	
	HEXAGON AB-B SHS	5,010	105.35	527,803.50	
	TELE2 AB-B SHS	1,460	112.95	164,907.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	2,238	83.00	185,754.00	
	SAGAX AB-B	600	263.00	157,800.00	
スウェーデンクローナ小計		78,741		14,995,174.52	(216,530,320)
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	1,130	233.50	263,855.00	
	EQUINOR ASA	2,610	282.60	737,586.00	
	NORSK HYDRO A S	4,055	68.52	277,848.60	
	YARA INTERNATIONAL ASA	429	339.60	145,688.40	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	210	1,143.00	240,030.00	
	MOWI ASA	1,466	197.30	289,241.80	
	DNB BANK ASA	3,350	230.40	771,840.00	
	TELENOR ASA	2,000	131.40	262,800.00	
ノルウェークローネ小計		15,250		2,988,889.80	(41,695,012)
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	820	442.40	362,768.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,706	132.15	357,597.90	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	10	10,300.00	103,000.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	10	10,640.00	106,400.00	
	DSV A/S	500	1,500.00	750,000.00	
	PANDORA A/S	230	1,040.50	239,315.00	
	CARLSBERG AS-B	293	785.00	230,005.00	
	COLOPLAST-B	302	883.80	266,907.60	
	DEMANT A/S	302	269.80	81,479.60	
	GENMAB A/S	200	1,593.50	318,700.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	8,510	784.30	6,674,393.00	
	ZEALAND PHARMA A/S	210	841.50	176,715.00	
	DANSKE BANK A/S	2,079	198.80	413,305.20	

	TRYG A/S	1,030	161.40	166,242.00	
	ORSTED A/S	528	433.60	228,940.80	
デンマーククローネ小計		17,730		10,475,769.10 (232,562,074)	
豪ドル	SANTOS LTD	8,590	6.93	59,528.70	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	5,000	24.29	121,450.00	
	BHP GROUP LTD	13,630	42.39	577,775.70	
	FORTESCUE LTD	4,520	18.99	85,834.80	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	1,306	49.71	64,921.26	
	MINERAL RESOURCES LTD	530	34.12	18,083.60	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	3,384	18.29	61,893.36	
	PILBARA MINERALS LTD	8,230	2.74	22,550.20	
	RIO TINTO LTD	960	118.08	113,356.80	
	SOUTH32 LTD	12,462	3.71	46,234.02	
	BRAMBLES LTD	3,858	18.16	70,061.28	
	COMPUTERSHARE LTD	1,410	26.23	36,984.30	
	TRANSURBAN GROUP	8,520	12.95	110,334.00	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,665	59.00	98,235.00	
	LOTTERY CORP LTD/THE	7,922	4.97	39,372.34	
	CAR GROUP LTD	930	37.09	34,493.70	
	SEEK LTD	1,090	25.55	27,849.50	
	WESFARMERS LTD	3,000	68.01	204,030.00	
	COLES GROUP LTD	3,500	18.16	63,560.00	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	4,080	32.69	133,375.20	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	2,315	11.77	27,247.55	
	COCHLEAR LTD	160	283.94	45,430.40	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	450	41.70	18,765.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	1,188	27.67	32,871.96	
	CSL LTD	1,230	293.69	361,238.70	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	7,630	31.71	241,947.30	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	4,490	144.02	646,649.80	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	8,460	38.95	329,517.00	
	WESTPAC BANKING CORP	10,140	32.14	325,899.60	
	ASX LTD	514	67.47	34,679.58	
MACQUARIE GROUP LTD	1,100	233.22	256,542.00		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	8,157	7.49	61,095.93		

	MEDIBANK PRIVATE LTD	7,650	3.69	28,228.50	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	3,874	17.23	66,749.02	
	SUNCORP GROUP LTD	4,089	18.04	73,765.56	
	WISETECH GLOBAL LTD	485	112.00	54,320.00	
	XERO LTD	420	147.40	61,908.00	
	TELSTRA GROUP LTD	10,933	3.87	42,310.71	
	ORIGIN ENERGY LTD	6,790	9.66	65,591.40	
豪ドル小計		174,662		4,764,681.77	(482,900,497)
ニュージーランドドル	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	1,488	36.84	54,817.92	
	MERCURY NZ LTD	2,262	6.61	14,951.82	
	MERIDIAN ENERGY LTD	3,409	5.92	20,181.28	
ニュージーランドドル小計		7,159		89,951.02	(8,247,609)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	6,690	41.75	279,307.50	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	4,000	114.80	459,200.00	
	MTR CORP	5,500	28.50	156,750.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	3,000	23.15	69,450.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	6,161	34.30	211,322.30	
	SANDS CHINA LTD	7,650	19.86	151,929.00	
	WH GROUP LTD	25,500	6.28	160,140.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	10,731	25.65	275,250.15	
	HANG SENG BANK LTD	2,150	95.50	205,325.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	2,971	312.80	929,328.80	
	AIA GROUP LTD	28,540	62.85	1,793,739.00	
	CLP HOLDINGS LTD	4,694	66.80	313,559.20	
	HONG KONG & CHINA GAS	32,768	6.12	200,540.16	
	POWER ASSETS HOLDINGS	4,000	51.70	206,800.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	5,073	32.30	163,857.90	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	4,433	85.10	377,248.30	
	WHARF HOLDINGS LTD	3,000	21.85	65,550.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	5,000	24.10	120,500.00	
	香港ドル小計		161,861		6,139,797.31
シンガポールドル	KEPPEL LTD	5,283	6.51	34,392.33	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	4,100	6.47	26,527.00	

	GENTING SINGAPORE LTD	16,200	0.82	13,365.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	5,062	39.15	198,177.30	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	9,508	15.32	145,662.56	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	3,642	32.49	118,328.58	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	26,600	3.21	85,386.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	8,911	2.87	25,574.57	
シンガポールドル小計		79,306		647,413.34 (75,054,628)	
イスラエルシ ケル	ICL GROUP LTD	2,760	15.67	43,249.20	
	ELBIT SYSTEMS LTD	70	808.40	56,588.00	
	BANK HAPOALIM BM	4,308	38.22	164,651.76	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	4,930	37.10	182,903.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	370	149.90	55,463.00	
	NICE LTD	172	662.70	113,984.40	
イスラエルシケル小計		12,610		616,839.36 (24,955,840)	
合 計		2,853,287		26,024,703,041 (26,024,703,041)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	409	46,225.18	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	800	30,616.00	
		AMERICAN TOWER CORP	1,260	280,728.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	1,163	22,666.87	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	410	92,803.50	
		BXP INC	500	43,495.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	291	34,422.39	
		CROWN CASTLE INC	1,060	115,444.60	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	910	164,719.10	
		EQUINIX INC	260	237,725.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	497	34,486.83	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	1,040	77,656.80	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	175	51,738.75	

		EXTRA SPACE STORAGE INC	620	103,168.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	640	31,852.80	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1,820	40,567.80	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	1,967	34,579.86	
		INVITATION HOMES INC	1,640	55,104.00	
		IRON MOUNTAIN INC	818	104,458.60	
		KIMCO REALTY CORP	1,600	37,680.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	300	45,996.00	
		PROLOGIS INC	2,500	293,850.00	
		PUBLIC STORAGE	390	131,172.60	
		REALTY INCOME CORP	2,240	137,334.40	
		REGENCY CENTERS CORP	482	34,226.82	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	340	82,208.60	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	940	160,288.80	
		SUN COMMUNITIES INC	317	42,443.13	
		UDR INC	827	36,280.49	
		VENTAS INC	1,190	77,314.30	
		VICI PROPERTIES INC	2,730	87,633.00	
		WELLTOWER INC	1,640	213,528.00	
		WEYERHAEUSER CO	1,690	53,742.00	
		WP CAREY INC	594	34,024.32	
米ドル小計			34,060	3,070,182.34	(471,119,480)
加ドル	新株予約権証券	CONSTELLATION SOFTWARE IN-40	60.00	—	
加ドル小計			60.00	—	(—)
ユーロ	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	351	27,076.14	
ユーロ小計			351	27,076.14	(4,485,162)
英ポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	1,694	10,477.39	
		SEGRO PLC	3,361	27,136.71	
英ポンド小計			5,055	37,614.10	(7,482,196)
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	2,875	20,728.75	
		GOODMAN GROUP	4,311	155,368.44	
		MIRVAC GROUP	11,628	25,697.88	

		SCENTRE GROUP	15,350	54,185.50
		STOCKLAND	5,114	26,388.24
		VICINITY CENTRES	10,480	22,951.20
豪ドル小計			49,758	305,320.01 (30,944,183)
香港ドル	投資証券	LINK REIT	6,680	246,158.00
香港ドル小計			6,680	246,158.00 (4,859,158)
シンガポ ールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	14,700	40,425.00
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	18,245	37,037.35
シンガポールドル小計			32,945	77,462.35 (8,980,210)
合計				527,870,389 (527,870,389)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株予約権 証券時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 567 銘柄	97.7%	—	—	75.6%
	投資証券 34 銘柄	—	—	2.3%	1.8%
加ドル	株式 72 銘柄	100.0%	—	—	3.2%
	新株予約権 証券 1 銘柄	—	—	—	—
ユーロ	株式 175 銘柄	99.8%	—	—	8.4%
	投資証券 1 銘柄	—	—	0.2%	0.0%
英ポンド	株式 66 銘柄	99.3%	—	—	3.8%
	投資証券 2 銘柄	—	—	0.7%	0.0%
スイスフラン	株式 35 銘柄	100.0%	—	—	2.5%
スウェーデンクロー ナ	株式 36 銘柄	100.0%	—	—	0.8%
ノルウェークローネ	株式 8 銘柄	100.0%	—	—	0.2%
デンマーククローネ	株式 15 銘柄	100.0%	—	—	0.9%
豪ドル	株式 39 銘柄	94.0%	—	—	1.8%
	投資証券 6 銘柄	—	—	6.0%	0.1%
ニュージーランドド ル	株式 3 銘柄	100.0%	—	—	0.0%
香港ドル	株式 18 銘柄	96.1%	—	—	0.5%

	投資証券	1 銘柄	—	—	3.9%	0.0%
シンガポールドル	株式	8 銘柄	89.3%	—	—	0.3%
	投資証券	2 銘柄	—	—	10.7%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	6 銘柄	100.0%	—	—	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	35,789,646	120,604,204
国債証券	44,169,559,480	48,610,675,610
地方債証券	2,728,710,400	2,301,744,855
特殊債証券	2,503,274,000	1,990,488,000
社債証券	1,296,449,000	2,119,922,997
未収利息	89,566,486	100,057,007
前払費用	1,975,856	4,082,344
流動資産合計	50,825,324,868	55,247,575,017
資産合計	50,825,324,868	55,247,575,017
負債の部		
流動負債		
未払金	-	100,952,000
未払解約金	39,615,852	7,165,542
未払利息	12	-
流動負債合計	39,615,864	108,117,542
負債合計	39,615,864	108,117,542
純資産の部		
元本等		
元本	38,462,644,652	41,909,025,247
剰余金		
剰余金又は欠損金(△)	12,323,064,352	13,230,432,228
元本等合計	50,785,709,004	55,139,457,475
純資産合計	50,785,709,004	55,139,457,475
負債純資産合計	50,825,324,868	55,247,575,017

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
1.	期首	2022年10月27日	2023年10月27日
	期首元本額	35,139,813,158円	38,462,644,652円
	期首からの追加設定元本額	4,986,525,327円	6,489,404,275円
	期首からの一部解約元本額	1,663,693,833円	3,043,023,680円
	元本の内訳 ※		
	DCインデックスバランス（株式20）	5,672,585,007円	6,654,233,157円
	DCインデックスバランス（株式40）	5,467,454,315円	6,441,711,759円
	DCインデックスバランス（株式60）	4,301,495,149円	5,363,473,116円
	DCインデックスバランス（株式80）	771,286,086円	1,034,126,954円
	インデックスファンド日本債券（DC専用）	2,204,907,921円	2,155,198,942円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	4,634,497,139円	4,627,294,198円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,729,528,043円	1,823,476,877円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	13,139,320円	40,857,385円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	1,004,181円	2,957,057円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	1,124,075円	2,503,154円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	3,086,148,563円	2,957,890,403円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,574,305,602円	1,677,841,144円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,578,117,566円	1,769,620,494円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	932,779,513円	1,088,521,133円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	141,132,311円	167,700,410円
	インデックスファンド日本債券（1年決算型）	5,944,219,944円	5,682,161,664円
日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	408,919,917円	419,457,400円	
計	38,462,644,652円	41,909,025,247円	
2.	受益権の総数	38,462,644,652口	41,909,025,247口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	自 2022 年 10 月 27 日 至 2023 年 10 月 26 日	自 2023 年 10 月 27 日 至 2024 年 10 月 28 日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	2023 年 10 月 26 日現在	2024 年 10 月 28 日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2023 年 10 月 26 日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

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

(2024 年 10 月 28 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	△642,073,430
地方債証券	△12,644,145
特殊債券	△9,575,000
社債券	△10,973,003
合計	△675,265,578

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年10月26日現在		2024年10月28日現在	
1口当たり純資産額	1.3204円	1口当たり純資産額	1.3157円
(1万円当たり純資産額)	(13,204円)	(1万円当たり純資産額)	(13,157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454回利付国債(2年)	100,000,000	99,788,000	
	第455回利付国債(2年)	100,000,000	99,646,000	
	第456回利付国債(2年)	100,000,000	99,713,000	
	第457回利付国債(2年)	150,000,000	149,509,500	
	第458回利付国債(2年)	130,000,000	129,697,100	
	第460回利付国債(2年)	100,000,000	99,843,000	
	第461回利付国債(2年)	150,000,000	149,952,000	
	第463回利付国債(2年)	150,000,000	149,895,000	
	第149回利付国債(5年)	100,000,000	99,183,000	
	第150回利付国債(5年)	50,000,000	49,533,000	
	第151回利付国債(5年)	290,000,000	286,981,100	
	第152回利付国債(5年)	100,000,000	99,184,000	
	第153回利付国債(5年)	300,000,000	296,514,000	
	第155回利付国債(5年)	100,000,000	99,473,000	
	第156回利付国債(5年)	200,000,000	198,326,000	

第157回利付国債（5年）	150,000,000	148,573,500	
第158回利付国債（5年）	230,000,000	227,046,800	
第159回利付国債（5年）	150,000,000	147,853,500	
第160回利付国債（5年）	120,000,000	118,712,400	
第161回利付国債（5年）	120,000,000	119,140,800	
第162回利付国債（5年）	130,000,000	128,908,000	
第163回利付国債（5年）	270,000,000	268,763,400	
第164回利付国債（5年）	130,000,000	128,234,600	
第165回利付国債（5年）	130,000,000	128,761,100	
第166回利付国債（5年）	140,000,000	139,232,800	
第167回利付国債（5年）	120,000,000	119,228,400	
第168回利付国債（5年）	150,000,000	150,321,000	
第170回利付国債（5年）	150,000,000	150,202,500	
第171回利付国債（5年）	100,000,000	99,231,000	
第172回利付国債（5年）	200,000,000	199,366,000	
第1回利付国債（40年）	70,000,000	75,362,000	
第2回利付国債（40年）	125,000,000	128,991,250	
第3回利付国債（40年）	85,000,000	87,201,500	
第4回利付国債（40年）	115,000,000	117,051,600	
第5回利付国債（40年）	95,000,000	92,225,050	
第6回利付国債（40年）	110,000,000	103,779,500	
第7回利付国債（40年）	130,000,000	116,321,400	
第8回利付国債（40年）	115,000,000	94,791,050	
第9回利付国債（40年）	210,000,000	124,242,300	
第10回利付国債（40年）	175,000,000	121,621,500	
第11回利付国債（40年）	140,000,000	92,722,000	
第12回利付国債（40年）	175,000,000	101,461,500	
第13回利付国債（40年）	210,000,000	118,962,900	
第14回利付国債（40年）	210,000,000	126,191,100	
第15回利付国債（40年）	230,000,000	152,016,200	
第16回利付国債（40年）	220,000,000	158,943,400	
第17回利付国債（40年）	80,000,000	75,013,600	
第1回クライメート・トランジション利付国債（5年）	60,000,000	59,416,200	
第1回クライメート・トランジション利付国債（10年）	70,000,000	68,904,500	
第2回クライメート・トランジション利付国債（1	50,000,000	50,302,000	

0年)			
第341回利付国債(10年)	700,000,000	699,678,000	
第342回利付国債(10年)	630,000,000	627,561,900	
第343回利付国債(10年)	645,000,000	641,581,500	
第344回利付国債(10年)	700,000,000	695,527,000	
第345回利付国債(10年)	660,000,000	655,162,200	
第346回利付国債(10年)	460,000,000	456,246,400	
第347回利付国債(10年)	680,000,000	673,784,800	
第348回利付国債(10年)	500,000,000	494,860,000	
第349回利付国債(10年)	590,000,000	583,238,600	
第350回利付国債(10年)	540,000,000	533,066,400	
第351回利付国債(10年)	435,000,000	428,775,150	
第352回利付国債(10年)	420,000,000	413,267,400	
第353回利付国債(10年)	400,000,000	392,948,000	
第354回利付国債(10年)	325,000,000	318,662,500	
第355回利付国債(10年)	350,000,000	342,559,000	
第356回利付国債(10年)	350,000,000	341,841,500	
第357回利付国債(10年)	560,000,000	546,302,400	
第358回利付国債(10年)	390,000,000	379,918,500	
第359回利付国債(10年)	420,000,000	408,538,200	
第360回利付国債(10年)	580,000,000	563,168,400	
第361回利付国債(10年)	460,000,000	445,712,400	
第362回利付国債(10年)	400,000,000	386,740,000	
第363回利付国債(10年)	500,000,000	482,335,000	
第364回利付国債(10年)	500,000,000	481,060,000	
第365回利付国債(10年)	410,000,000	393,399,100	
第366回利付国債(10年)	480,000,000	462,811,200	
第367回利付国債(10年)	420,000,000	403,741,800	
第368回利付国債(10年)	450,000,000	431,392,500	
第369回利付国債(10年)	490,000,000	479,861,900	
第370回利付国債(10年)	420,000,000	410,251,800	
第371回利付国債(10年)	480,000,000	463,540,800	
第372回利付国債(10年)	500,000,000	498,135,000	
第373回利付国債(10年)	440,000,000	429,391,600	
第374回利付国債(10年)	410,000,000	406,096,800	
第375回利付国債(10年)	280,000,000	284,211,200	

第1回利付国債（30年）	50,000,000	55,320,500	
第3回利付国債（30年）	70,000,000	76,521,900	
第5回利付国債（30年）	80,000,000	87,990,400	
第6回利付国債（30年）	50,000,000	55,925,500	
第7回利付国債（30年）	50,000,000	55,821,000	
第8回利付国債（30年）	170,000,000	183,855,000	
第9回利付国債（30年）	70,000,000	73,519,600	
第10回利付国債（30年）	50,000,000	51,279,500	
第11回利付国債（30年）	70,000,000	75,182,800	
第12回利付国債（30年）	50,000,000	55,373,500	
第13回利付国債（30年）	180,000,000	197,726,400	
第14回利付国債（30年）	108,000,000	122,502,240	
第15回利付国債（30年）	147,000,000	168,163,590	
第16回利付国債（30年）	65,000,000	74,379,500	
第17回利付国債（30年）	50,000,000	56,759,500	
第18回利付国債（30年）	110,000,000	123,807,200	
第19回利付国債（30年）	40,000,000	45,000,800	
第20回利付国債（30年）	60,000,000	68,739,000	
第21回利付国債（30年）	70,000,000	78,767,500	
第22回利付国債（30年）	70,000,000	80,243,100	
第23回利付国債（30年）	75,000,000	85,968,000	
第24回利付国債（30年）	68,000,000	77,970,840	
第25回利付国債（30年）	60,000,000	67,423,200	
第26回利付国債（30年）	170,000,000	192,938,100	
第27回利付国債（30年）	89,000,000	101,918,350	
第28回利付国債（30年）	144,000,000	164,738,880	
第29回利付国債（30年）	176,000,000	198,781,440	
第30回利付国債（30年）	147,000,000	163,825,620	
第31回利付国債（30年）	120,000,000	131,829,600	
第32回利付国債（30年）	160,000,000	177,556,800	
第33回利付国債（30年）	195,000,000	207,645,750	
第34回利付国債（30年）	180,000,000	196,187,400	
第35回利付国債（30年）	193,000,000	203,943,100	
第36回利付国債（30年）	195,000,000	205,331,100	
第37回利付国債（30年）	211,000,000	218,136,020	
第38回利付国債（30年）	135,000,000	136,890,000	

第39回利付国債（30年）	135,000,000	138,624,750	
第40回利付国債（30年）	100,000,000	100,924,000	
第41回利付国債（30年）	130,000,000	128,789,700	
第42回利付国債（30年）	135,000,000	133,346,250	
第43回利付国債（30年）	125,000,000	123,096,250	
第44回利付国債（30年）	130,000,000	127,627,500	
第45回利付国債（30年）	140,000,000	132,323,800	
第46回利付国債（30年）	160,000,000	150,704,000	
第47回利付国債（30年）	155,000,000	148,214,100	
第48回利付国債（30年）	135,000,000	124,069,050	
第49回利付国債（30年）	140,000,000	128,184,000	
第50回利付国債（30年）	165,000,000	133,242,450	
第51回利付国債（30年）	160,000,000	114,507,200	
第52回利付国債（30年）	190,000,000	141,852,100	
第53回利付国債（30年）	135,000,000	102,609,450	
第54回利付国債（30年）	160,000,000	126,779,200	
第55回利付国債（30年）	140,000,000	110,377,400	
第56回利付国債（30年）	140,000,000	109,907,000	
第57回利付国債（30年）	190,000,000	148,524,900	
第58回利付国債（30年）	180,000,000	140,110,200	
第59回利付国債（30年）	170,000,000	128,542,100	
第60回利付国債（30年）	120,000,000	94,825,200	
第61回利付国債（30年）	130,000,000	97,333,600	
第62回利付国債（30年）	120,000,000	84,793,200	
第63回利付国債（30年）	120,000,000	82,012,800	
第64回利付国債（30年）	130,000,000	88,312,900	
第65回利付国債（30年）	140,000,000	94,610,600	
第66回利付国債（30年）	180,000,000	120,916,800	
第67回利付国債（30年）	165,000,000	116,653,350	
第68回利付国債（30年）	140,000,000	98,421,400	
第69回利付国債（30年）	145,000,000	104,313,000	
第70回利付国債（30年）	140,000,000	100,251,200	
第71回利付国債（30年）	160,000,000	114,036,800	
第72回利付国債（30年）	160,000,000	113,502,400	
第73回利付国債（30年）	150,000,000	105,912,000	
第74回利付国債（30年）	150,000,000	114,726,000	

第75回利付国債(30年)	150,000,000	123,607,500	
第76回利付国債(30年)	150,000,000	126,415,500	
第77回利付国債(30年)	130,000,000	114,648,300	
第78回利付国債(30年)	150,000,000	125,733,000	
第79回利付国債(30年)	140,000,000	111,200,600	
第80回利付国債(30年)	130,000,000	119,546,700	
第81回利付国債(30年)	150,000,000	131,221,500	
第82回利付国債(30年)	150,000,000	137,449,500	
第83回利付国債(30年)	150,000,000	150,133,500	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	133,277,300	
第88回利付国債(20年)	300,000,000	309,192,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	16,530,240	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	258,752,500	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	62,113,800	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	62,212,800	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	51,962,000	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	85,981,920	
第96回利付国債(20年)	248,000,000	258,745,840	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	47,248,650	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	98,429,280	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	122,943,600	
第100回利付国債(20年)	80,000,000	84,616,800	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	70,249,080	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	86,549,310	
第103回利付国債(20年)	71,000,000	75,610,030	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	34,906,740	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	81,688,530	
第106回利付国債(20年)	62,000,000	66,012,020	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	138,329,100	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	141,498,640	
第109回利付国債(20年)	107,000,000	113,262,710	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	104,576,780	
第111回利付国債(20年)	95,000,000	102,069,900	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	85,592,000	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	311,120,700	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	55,988,400	

第115回利付国債（20年）	125,000,000	135,212,500	
第116回利付国債（20年）	135,000,000	146,504,700	
第117回利付国債（20年）	243,000,000	262,437,570	
第118回利付国債（20年）	70,000,000	75,450,200	
第119回利付国債（20年）	60,000,000	64,015,800	
第120回利付国債（20年）	170,000,000	179,470,700	
第121回利付国債（20年）	142,000,000	152,637,220	
第122回利付国債（20年）	17,000,000	18,176,570	
第123回利付国債（20年）	195,000,000	212,390,100	
第124回利付国債（20年）	90,000,000	97,492,500	
第125回利付国債（20年）	90,000,000	98,829,900	
第126回利付国債（20年）	105,000,000	113,974,350	
第127回利付国債（20年）	50,000,000	53,966,000	
第128回利付国債（20年）	135,000,000	145,974,150	
第129回利付国債（20年）	85,000,000	91,368,200	
第130回利付国債（20年）	150,000,000	161,433,000	
第131回利付国債（20年）	92,000,000	98,405,040	
第132回利付国債（20年）	135,000,000	144,575,550	
第133回利付国債（20年）	130,000,000	140,107,500	
第134回利付国債（20年）	120,000,000	129,500,400	
第135回利付国債（20年）	70,000,000	75,049,100	
第136回利付国債（20年）	70,000,000	74,530,400	
第137回利付国債（20年）	100,000,000	107,253,000	
第138回利付国債（20年）	120,000,000	126,916,800	
第139回利付国債（20年）	100,000,000	106,527,000	
第140回利付国債（20年）	318,000,000	341,401,620	
第141回利付国債（20年）	235,000,000	252,324,200	
第142回利付国債（20年）	165,000,000	178,500,300	
第143回利付国債（20年）	154,000,000	164,136,280	
第144回利付国債（20年）	130,000,000	137,532,200	
第145回利付国債（20年）	215,000,000	230,918,600	
第146回利付国債（20年）	195,000,000	209,309,100	
第147回利付国債（20年）	208,000,000	221,232,960	
第148回利付国債（20年）	220,000,000	231,728,200	
第149回利付国債（20年）	225,000,000	236,659,500	
第150回利付国債（20年）	250,000,000	260,172,500	

第151回利付国債（20年）	240,000,000	244,756,800	
第152回利付国債（20年）	250,000,000	254,345,000	
第153回利付国債（20年）	270,000,000	276,725,700	
第154回利付国債（20年）	230,000,000	232,916,400	
第155回利付国債（20年）	270,000,000	267,186,600	
第156回利付国債（20年）	200,000,000	184,522,000	
第157回利付国債（20年）	220,000,000	197,225,600	
第158回利付国債（20年）	230,000,000	212,798,300	
第159回利付国債（20年）	210,000,000	195,814,500	
第160回利付国債（20年）	210,000,000	197,395,800	
第161回利付国債（20年）	180,000,000	166,410,000	
第162回利付国債（20年）	210,000,000	193,233,600	
第163回利付国債（20年）	195,000,000	178,575,150	
第164回利付国債（20年）	255,000,000	229,380,150	
第165回利付国債（20年）	200,000,000	178,972,000	
第166回利付国債（20年）	180,000,000	164,768,400	
第167回利付国債（20年）	200,000,000	177,182,000	
第168回利付国債（20年）	180,000,000	156,288,600	
第169回利付国債（20年）	190,000,000	161,560,800	
第170回利付国債（20年）	160,000,000	135,227,200	
第171回利付国債（20年）	170,000,000	142,886,700	
第172回利付国債（20年）	230,000,000	195,433,300	
第173回利付国債（20年）	190,000,000	160,472,100	
第174回利付国債（20年）	200,000,000	167,992,000	
第175回利付国債（20年）	200,000,000	169,922,000	
第176回利付国債（20年）	190,000,000	160,569,000	
第177回利付国債（20年）	200,000,000	165,202,000	
第178回利付国債（20年）	220,000,000	183,902,400	
第179回利付国債（20年）	220,000,000	182,892,600	
第180回利付国債（20年）	190,000,000	165,714,200	
第181回利付国債（20年）	210,000,000	185,562,300	
第182回利付国債（20年）	200,000,000	182,160,000	
第183回利付国債（20年）	190,000,000	181,216,300	
第184回利付国債（20年）	200,000,000	180,782,000	
第185回利付国債（20年）	200,000,000	180,082,000	
第186回利付国債（20年）	200,000,000	192,218,000	

	第187回利付国債（20年）	170,000,000	157,448,900	
	第188回利付国債（20年）	175,000,000	169,968,750	
	第189回利付国債（20年）	160,000,000	162,793,600	
国債証券 合計		50,570,000,000	48,610,675,610	
地方債証券	第4回東京都公募公債（東京グリーンボンド（5年））	100,000,000	99,723,111	
	第26回東京都公募公債（20年）	100,000,000	106,736,000	
	令和3年度第6回北海道公募公債（5年）	100,000,000	99,096,000	
	平成22年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	101,331,000	
	第24回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	95,451,000	
	令和2年度第2回大分県公募公債	100,000,000	96,632,000	
	第165回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,308,000	
	第208回共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,993,000	
	第253回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,542,000	
	第254回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,618,000	
	第255回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,359,000	
	平成28年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	99,179,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	100,065,000	
	平成29年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	98,817,000	
	平成27年度第2回熊本県公募公債（10年）	100,000,000	100,076,000	
	第2回名古屋市定時償還公募公債（10年）	10,000,000	10,006,628	
	平成27年度第5回札幌市公募公債（10年）	100,000,000	100,120,116	
	第18回川崎市公募公債（20年）	100,000,000	104,790,000	
	令和2年度第1回鹿児島県公募公債（5年）	100,000,000	99,619,000	
	平成26年度第1回福井県公募公債	100,000,000	103,997,000	
	令和6年度第1回福井県公募公債	100,000,000	99,975,000	
令和3年度第1回山梨県公募公債（10年）	100,000,000	95,649,000		
令和元年度第1回秋田県公募公債	100,000,000	96,662,000		
地方債証券 合計		2,310,000,000	2,301,744,855	
特殊債券	第5回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	99,127,000	
	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	198,156,000	
	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	98,863,000	
	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	104,136,000	
	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	105,280,000	
	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	100,016,000	

	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	99,335,000	
	第324回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	197,522,000	
	第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,471,000	
	第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	197,976,000	
	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,001,000	
	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	197,730,000	
	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	98,377,000	
	第395回信金中金債（5年）	100,000,000	98,692,000	
	第405回信金中金債（5年）	100,000,000	98,732,000	
	第37回国際協力機構債券	100,000,000	99,074,000	
	特殊債券 合計	2,000,000,000	1,990,488,000	
社債券	第22回味の素株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,641,000	
	第25回味の素株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,197,000	
	第24回森ビル株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	98,130,000	
	第17回株式会社オリエントランド無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	98,425,000	
	第17回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）（ソーシャルボンド）	100,000,000	98,733,000	
	第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,492,000	
	第53回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	105,497,000	
	第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,735,997	
	第23回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	200,000,000	212,600,000	
	第32回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特約付）	200,000,000	209,202,000	
	第510回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,289,000	
	第400回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	98,805,000	
	第447回中国電力株式会社社債（一般担保付）（トランジションボンド）	100,000,000	98,783,000	
	第323回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,648,000	
	第8回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,499,000	
	第28回東京瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	104,160,000	
	第32回大阪瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	103,528,000	

	第47回大阪瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	96,223,000	
	第51回大阪瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	97,335,000	
社債券	合計	2,100,000,000	2,119,922,997	
	合計	56,980,000,000	55,022,831,462	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
預金	160,502,854	120,199,890
コール・ローン	80,759,786	77,304,557
国債証券	153,961,084,481	166,410,220,148
派生商品評価勘定	227,502	-
未収入金	-	86,990,010
未収利息	1,244,838,700	1,490,541,754
前払費用	72,483,897	78,822,223
流動資産合計	155,519,897,220	168,264,078,582
資産合計	155,519,897,220	168,264,078,582
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	24,377	976,977
未払解約金	121,462,048	199,843,016
未払利息	28	-
流動負債合計	121,486,453	200,819,993
負債合計	121,486,453	200,819,993
純資産の部		
元本等		
元本	57,315,428,247	55,035,546,538
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	98,082,982,520	113,027,712,051
元本等合計	155,398,410,767	168,063,258,589
純資産合計	155,398,410,767	168,063,258,589
負債純資産合計	155,519,897,220	168,264,078,582

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2023 年 10 月 26 日現在	2024 年 10 月 28 日現在
1.	期首	2022 年 10 月 27 日	2023 年 10 月 27 日
	期首元本額	57,575,300,165 円	57,315,428,247 円
	期首からの追加設定元本額	3,716,701,373 円	3,580,271,656 円
	期首からの一部解約元本額	3,976,573,291 円	5,860,153,365 円
	元本の内訳 ※		
	インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC 専用）	18,929,458,764 円	20,814,853,738 円
	DC インデックスバランス（株式 20）	426,585,541 円	452,227,508 円
	DC インデックスバランス（株式 40）	595,287,919 円	638,673,399 円
	DC インデックスバランス（株式 60）	843,353,485 円	956,118,454 円
	DC インデックスバランス（株式 80）	757,207,482 円	920,276,496 円
	財産 3 分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	15,280,881,335 円	12,113,261,664 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	2,340,604,123 円	2,116,811,210 円
	日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	12,133,636,705 円	11,190,522,771 円
	財産 3 分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	891,805,816 円	840,966,833 円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	143,812,763 円	134,624,416 円
	財産 3 分法（適格機関投資家専用）	316,658,443 円	367,411,531 円
	N i つみインデックスラップ世界 10 指数（均等型）	493,149 円	1,299,567 円
	N i つみインデックスラップ世界 10 指数（安定成長型）	1,103,924 円	2,195,989 円
	財産 3 分法ファンド（不動産・債券・株式）奇数月分配型	591,254 円	35,721,297 円
	国際分散型ファンド 40（適格機関投資家向け）	501,546,917 円	436,514,279 円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 20）	59,299,022 円	56,348,839 円	
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 40）	86,274,514 円	87,755,143 円	
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 60）	91,903,491 円	95,905,016 円	
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式 80）	69,258,250 円	74,871,387 円	

0)	インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）1年決算型	3,511,904,503円	3,344,135,843円
	海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	333,760,847円	355,051,158円
	計	57,315,428,247円	55,035,546,538円
2.	受益権の総数	57,315,428,247口	55,035,546,538口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

I 金融商品の状況に関する事項

	自 2022年10月27日 至 2023年10月26日	自 2023年10月27日 至 2024年10月28日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

II 金融商品の時価等に関する事項

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

（2023年10月26日現在）

売買目的有価証券

（単位：円）

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

国債証券	△5,555,230,909
合計	△5,555,230,909

(2024年10月28日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	8,673,481,820
合計	8,673,481,820

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2023年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	65,975,344	—	65,772,219	203,125
	ユーロ	24,119,200	—	24,114,803	4,397
	英ポンド	15,865,494	—	15,807,195	58,299
	豪ドル	11,372,724	—	11,212,118	160,606
	中国元	14,617,926	—	14,638,103	△20,177
合計		65,975,344	—	65,772,219	203,125

(2024年10月28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	127,288,703	—	128,265,680	△976,977
	米ドル	34,370,080	—	34,675,180	△305,100
	加ドル	10,101,140	—	10,163,129	△61,989
	ユーロ	43,271,390	—	43,562,083	△290,693
	英ポンド	9,464,880	—	9,546,902	△82,022
	豪ドル	9,461,137	—	9,505,513	△44,376
	中国元	20,620,076	—	20,812,873	△192,797
合計		127,288,703	—	128,265,680	△976,977

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年10月26日現在		2024年10月28日現在	
1口当たり純資産額	2,7113円	1口当たり純資産額	3,0537円
(1万口当たり純資産額)	(27,113円)	(1万口当たり純資産額)	(30,537円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	4,200,000.00	4,150,330.80	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/09/30	1,570,000.00	1,512,487.76	
		US TREASURY N/B-4.25%-25/10/15	170,000.00	169,912.62	
		US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,382,337.60	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	2,110,000.00	2,026,431.34	
		US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	3,440,000.00	3,368,551.20	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,300,663.32	
		US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	3,420,000.00	3,278,925.00	
		US TREASURY N/B-4.875%-25/11/30	4,000,000.00	4,025,156.00	
		US TREASURY N/B-4.0%-25/12/15	1,510,000.00	1,505,870.15	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	1,963,358.00	
		US TREASURY N/B-3.875%-26/01/15	1,150,000.00	1,145,417.25	
		US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	1,814,228.40	
		US TREASURY N/B-0.375%-26/01/31	2,370,000.00	2,259,368.40	
		US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	1,844,155.80	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,310,000.00	3,203,070.45	

US TREASURY N/B-4.0%-26/02/15	3,000,000.00	2,992,500.00	
US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,750,562.72	
US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	3,650,000.00	3,474,770.80	
US TREASURY N/B-4.625%-26/02/28	2,820,000.00	2,834,759.88	
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	4,490,000.00	4,370,732.13	
US TREASURY N/B-0.75%-26/03/31	2,400,000.00	2,286,842.40	
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	1,050,000.00	1,022,724.15	
US TREASURY N/B-0.75%-26/04/30	2,740,000.00	2,604,389.18	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	4,840,000.00	4,658,500.00	
US TREASURY N/B-3.625%-26/05/15	6,750,000.00	6,696,999.00	
US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	2,740,000.00	2,655,657.32	
US TREASURY N/B-0.75%-26/05/31	2,800,000.00	2,654,419.60	
US TREASURY N/B-4.125%-26/06/15	3,000,000.00	2,998,827.00	
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	1,927,812.00	
US TREASURY N/B-4.5%-26/07/15	3,600,000.00	3,621,794.40	
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	960,000.00	923,662.08	
US TREASURY N/B-0.625%-26/07/31	1,760,000.00	1,656,392.32	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,820,700.00	
US TREASURY N/B-0.75%-26/08/31	3,000,000.00	2,822,694.00	
US TREASURY N/B-3.75%-26/08/31	3,400,000.00	3,377,818.40	
US TREASURY N/B-4.625%-26/09/15	2,600,000.00	2,624,221.60	
US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,547,320.32	
US TREASURY N/B-0.875%-26/09/30	2,000,000.00	1,881,952.00	
US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	250,000.00	238,251.75	
US TREASURY N/B-1.125%-26/10/31	3,950,000.00	3,725,959.95	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,040,000.00	2,917,329.92	
US TREASURY N/B-4.625%-26/11/15	3,200,000.00	3,233,622.40	
US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,400,000.00	2,282,904.00	
US TREASURY N/B-1.25%-26/11/30	2,210,000.00	2,085,773.69	
US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	1,904,530.00	
US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	4,000,000.00	3,779,684.00	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	2,680,000.00	2,573,531.64	
US TREASURY N/B-4.125%-27/02/15	1,880,000.00	1,881,981.52	
US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,390,000.00	1,299,650.00	
US TREASURY N/B-4.25%-27/03/15	2,300,000.00	2,309,880.80	
US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	670,000.00	617,420.41	

US TREASURY N/B-4.5%-27/04/15	3,190,000.00	3,222,273.23	
US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	1,380,000.00	1,263,939.24	
US TREASURY N/B-2.75%-27/04/30	1,430,000.00	1,385,843.03	
US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,386,731.42	
US TREASURY N/B-4.5%-27/05/15	4,700,000.00	4,749,199.60	
US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	1,600,000.00	1,461,000.00	
US TREASURY N/B-2.625%-27/05/31	1,750,000.00	1,689,091.25	
US TREASURY N/B-4.625%-27/06/15	8,450,000.00	8,570,801.20	
US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	2,600,000.00	2,367,674.40	
US TREASURY N/B-3.25%-27/06/30	5,000,000.00	4,900,195.00	
US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	4,450,000.00	4,026,551.35	
US TREASURY N/B-2.75%-27/07/31	930,000.00	898,502.76	
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	2,819,281.60	
US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	1,900,000.00	1,720,241.00	
US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	4,090,000.00	3,678,603.26	
US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	3,640,000.00	3,276,567.84	
US TREASURY N/B-4.125%-27/10/31	800,000.00	801,733.60	
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	1,400,000.00	1,483,944.00	
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	2,864,279.74	
US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	220,000.00	198,223.30	
US TREASURY N/B-3.875%-27/11/30	2,320,000.00	2,307,991.68	
US TREASURY N/B-0.625%-27/12/31	2,410,000.00	2,165,515.14	
US TREASURY N/B-0.75%-28/01/31	2,850,000.00	2,564,107.95	
US TREASURY N/B-3.5%-28/01/31	1,450,000.00	1,425,416.70	
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	3,838,436.00	
US TREASURY N/B-1.125%-28/02/29	3,830,000.00	3,481,408.72	
US TREASURY N/B-4.0%-28/02/29	2,650,000.00	2,645,031.25	
US TREASURY N/B-1.25%-28/03/31	960,000.00	874,424.64	
US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	3,370,000.00	3,061,826.98	
US TREASURY N/B-3.5%-28/04/30	3,000,000.00	2,945,505.00	
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	2,440,000.00	2,344,305.64	
US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	4,300,000.00	3,898,302.60	
US TREASURY N/B-3.625%-28/05/31	1,020,000.00	1,005,097.80	
US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	3,300,000.00	2,985,015.00	
US TREASURY N/B-4.0%-28/06/30	200,000.00	199,578.00	
US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	2,920,000.00	2,609,977.76	

US TREASURY N/B-4.125%-28/07/31	5,950,000.00	5,960,918.25	
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	4,024,780.20	
US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	2,960,000.00	2,652,319.84	
US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	3,700,000.00	3,324,361.20	
US TREASURY N/B-4.625%-28/09/30	2,400,000.00	2,447,529.60	
US TREASURY N/B-1.375%-28/10/31	3,800,000.00	3,424,229.40	
US TREASURY N/B-4.875%-28/10/31	2,100,000.00	2,161,933.20	
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,117,648.17	
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	2,610,000.00	2,518,138.44	
US TREASURY N/B-1.5%-28/11/30	4,930,000.00	4,455,581.17	
US TREASURY N/B-4.375%-28/11/30	1,050,000.00	1,061,688.60	
US TREASURY N/B-1.375%-28/12/31	870,000.00	780,705.81	
US TREASURY N/B-4.0%-29/01/31	2,700,000.00	2,692,035.00	
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,590,000.00	4,329,926.01	
US TREASURY N/B-4.25%-29/02/28	5,000,000.00	5,035,835.00	
US TREASURY N/B-2.375%-29/03/31	4,630,000.00	4,313,673.77	
US TREASURY N/B-2.875%-29/04/30	2,000,000.00	1,901,522.00	
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	4,810,000.00	4,475,175.90	
US TREASURY N/B-4.5%-29/05/31	620,000.00	631,273.46	
US TREASURY N/B-3.25%-29/06/30	4,980,000.00	4,805,112.36	
US TREASURY N/B-4.25%-29/06/30	3,000,000.00	3,022,617.00	
US TREASURY N/B-4.0%-29/07/31	3,500,000.00	3,490,154.50	
US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	1,670,000.00	1,495,496.69	
US TREASURY N/B-3.875%-29/09/30	325,000.00	322,041.85	
US TREASURY N/B-4.0%-29/10/31	2,520,000.00	2,511,827.64	
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	6,940,000.00	6,221,869.62	
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	3,808,176.40	
US TREASURY N/B-4.0%-30/02/28	1,650,000.00	1,643,231.70	
US TREASURY N/B-3.625%-30/03/31	2,550,000.00	2,492,423.55	
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,172,749.02	
US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	3,870,000.00	3,208,168.08	
US TREASURY N/B-3.75%-30/05/31	710,000.00	697,713.45	
US TREASURY N/B-3.75%-30/06/30	380,000.00	373,231.06	
US TREASURY N/B-4.0%-30/07/31	4,900,000.00	4,873,966.30	
US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	5,090,000.00	4,181,949.09	
US TREASURY N/B-4.625%-30/09/30	800,000.00	821,468.00	

US TREASURY N/B-4.875%-30/10/31	3,000,000.00	3,120,642.00	
US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	5,910,000.00	4,901,369.85	
US TREASURY N/B-4.375%-30/11/30	3,000,000.00	3,040,545.00	
US TREASURY N/B-4.0%-31/01/31	670,000.00	665,197.44	
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	560,000.00	600,227.60	
US TREASURY N/B-1.125%-31/02/15	3,300,000.00	2,762,459.70	
US TREASURY N/B-4.25%-31/02/28	1,000,000.00	1,006,484.00	
US TREASURY N/B-4.625%-31/04/30	255,000.00	261,997.45	
US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	6,020,000.00	5,158,857.06	
US TREASURY N/B-4.625%-31/05/31	1,450,000.00	1,489,619.80	
US TREASURY N/B-4.25%-31/06/30	2,420,000.00	2,434,604.70	
US TREASURY N/B-4.125%-31/07/31	3,000,000.00	2,996,250.00	
US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	4,790,000.00	3,972,893.06	
US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	5,830,000.00	4,845,726.93	
US TREASURY N/B-1.875%-32/02/15	5,870,000.00	5,027,672.61	
US TREASURY N/B-2.875%-32/05/15	4,800,000.00	4,397,904.00	
US TREASURY N/B-2.75%-32/08/15	5,100,000.00	4,617,687.90	
US TREASURY N/B-4.125%-32/11/15	6,110,000.00	6,090,069.18	
US TREASURY N/B-3.5%-33/02/15	2,610,000.00	2,483,629.02	
US TREASURY N/B-3.375%-33/05/15	1,680,000.00	1,580,675.04	
US TREASURY N/B-3.875%-33/08/15	3,330,000.00	3,247,269.48	
US TREASURY N/B-4.5%-33/11/15	5,540,000.00	5,655,232.00	
US TREASURY N/B-4.0%-34/02/15	2,000,000.00	1,964,686.00	
US TREASURY N/B-4.375%-34/05/15	4,810,000.00	4,862,606.97	
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	823,812.00	
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	803,261.25	
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	674,684.64	
US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	720,000.00	733,050.00	
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	727,436.80	
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	1,428,419.65	
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	1,435,087.50	
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	746,967.75	
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	695,272.80	
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	1,580,992.65	
US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	2,310,909.00	
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,348,312.32	

US TREASURY N/B-1.125%-40/08/15	3,000,000.00	1,856,484.00	
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	988,063.81	
US TREASURY N/B-1.375%-40/11/15	3,100,000.00	1,989,325.80	
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	1,553,788.50	
US TREASURY N/B-1.875%-41/02/15	4,200,000.00	2,918,013.00	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	862,523.22	
US TREASURY N/B-2.25%-41/05/15	4,900,000.00	3,603,219.90	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	878,174.40	
US TREASURY N/B-1.75%-41/08/15	3,190,000.00	2,141,348.11	
US TREASURY N/B-2.0%-41/11/15	3,000,000.00	2,089,218.00	
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	416,660.00	
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	623,749.60	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	1,551,250.00	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	1,765,000.00	1,448,126.02	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	1,611,010.95	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	1,950,000.00	1,712,495.85	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	1,865,732.55	
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	1,080,000.00	944,535.60	
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,000,000.00	1,683,046.00	
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	1,700,000.00	1,370,092.90	
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	1,900,000.00	1,497,287.40	
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	2,120,000.00	1,527,226.80	
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	1,400,000.00	1,098,889.40	
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	1,390,000.00	1,065,900.65	
US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	1,190,000.00	930,848.94	
US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	1,300,000.00	925,334.80	
US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	900,000.00	638,366.40	
US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	1,650,000.00	1,110,397.20	
US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	540,000.00	408,859.92	
US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	1,720,000.00	1,329,102.48	
US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	1,530,000.00	1,180,339.92	
US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	1,700,000.00	1,248,933.90	
US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,740,000.00	1,276,622.34	
US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	2,109,013.50	
US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	1,880,529.60	
US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	3,134,175.30	

		US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	2,411,335.90	
		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	2,513,798.10	
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	2,228,436.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,250,000.00	1,462,146.75	
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	2,068,763.30	
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	2,260,248.60	
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	2,450,000.00	1,224,233.15	
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,920,000.00	1,502,316.64	
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	3,000,000.00	1,649,880.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	4,750,000.00	2,786,540.00	
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	4,100,000.00	2,714,007.30	
		US TREASURY N/B-2.0%-51/08/15	2,000,000.00	1,205,390.00	
		US TREASURY N/B-1.875%-51/11/15	1,400,000.00	815,199.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-52/02/15	2,000,000.00	1,278,476.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-52/05/15	600,000.00	441,550.20	
		US TREASURY N/B-3.0%-52/08/15	1,100,000.00	830,865.20	
		US TREASURY N/B-4.0%-52/11/15	1,500,000.00	1,372,821.00	
		US TREASURY N/B-3.625%-53/02/15	2,900,000.00	2,479,839.30	
		US TREASURY N/B-3.625%-53/05/15	2,150,000.00	1,839,172.35	
		US TREASURY N/B-4.125%-53/08/15	1,500,000.00	1,404,375.00	
		US TREASURY N/B-4.75%-53/11/15	1,500,000.00	1,558,387.50	
		US TREASURY N/B-4.25%-54/02/15	1,000,000.00	957,500.00	
		US TREASURY N/B-4.625%-54/05/15	1,500,000.00	1,529,296.50	
米ドル小計			561,425,000.00	507,070,702.18 (77,809,999,249)	
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-25/10/01	430,000.00	428,843.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-25/11/01	540,000.00	546,604.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-26/02/01	620,000.00	629,827.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	995,000.00	957,229.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-26/04/01	700,000.00	698,341.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-26/05/01	870,000.00	880,266.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	670,000.00	653,765.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-26/08/01	460,000.00	466,637.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-26/09/01	990,000.00	953,617.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-26/11/01	220,000.00	220,701.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	520,000.00	499,314.40	

		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	650,000.00	618,884.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-27/09/01	620,000.00	615,523.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-28/03/01	580,000.00	589,222.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	697,000.00	674,256.89	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-28/09/01	930,000.00	938,295.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-29/03/01	1,000,000.00	1,039,930.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	410,000.00	458,851.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	364,000.00	353,476.76	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-29/09/01	940,000.00	959,956.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/12/01	120,000.00	115,729.20	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	1,748,000.00	1,585,523.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-30/12/01	1,205,000.00	1,033,408.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	1,746,000.00	1,577,528.46	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/12/01	1,520,000.00	1,360,749.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-32/06/01	1,070,000.00	985,245.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-32/12/01	890,000.00	845,900.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	710,000.00	842,443.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-33/06/01	500,000.00	482,760.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-33/12/01	800,000.00	800,936.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-34/03/01	145,000.00	148,023.25	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-34/06/01	650,000.00	636,415.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	290,000.00	339,836.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	460,000.00	497,973.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	520,000.00	529,256.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	610,000.00	545,645.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	2,073,000.00	1,559,248.41	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-53/12/01	1,241,000.00	866,230.41	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-55/12/01	600,000.00	526,422.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	285,000.00	249,782.55	
			30,389,000.00	28,712,601.73	
				(3,172,168,239)	
加ドル小計					
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	23,150,000.00	21,855,046.87	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.0%-26/09/03	5,200,000.00	4,922,125.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	15,550,000.00	14,131,062.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	20,500,000.00	19,385,312.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/03/01	4,900,000.00	4,639,687.50	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	14,120,000.00	13,365,462.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	19,900,000.00	17,822,937.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-33/05/26	12,800,000.00	10,920,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-34/11/23	6,000,000.00	5,118,750.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%-36/11/20	4,400,000.00	4,372,500.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	11,170,000.00	9,770,259.37	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	14,100,000.00	11,090,531.25	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	13,570,000.00	10,754,225.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-53/07/31	12,200,000.00	9,550,312.49	
		メキシコペソ小計	177,560,000.00	157,698,212.48 (1,212,651,944)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	270,000.00	112,106.70	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	505,000.00	520,294.43	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	742,000.00	727,016.05	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	780,000.00	751,284.30	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	375,000.00	350,602.50	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	880,000.00	970,286.24	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	795,000.00	753,313.38	
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	840,000.00	784,539.00	
		BELGIUM KINGDOM-2.7%-29/10/22	152,000.00	153,751.64	
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	730,000.00	639,101.13	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	855,000.00	773,309.88	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-31/10/22	610,000.00	508,836.38	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	475,000.00	516,882.65	
		BELGIUM KINGDOM-0.35%-32/06/22	675,000.00	566,290.57	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	525,000.00	468,362.47	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-33/06/22	476,000.00	484,895.48	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	543,000.00	551,273.69	
		BELGIUM KINGDOM-2.85%-34/10/22	240,000.00	239,470.80	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	974,000.00	1,154,421.81	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	340,000.00	283,214.22	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	415,000.00	359,250.14	
		BELGIUM KINGDOM-2.75%-39/04/22	160,000.00	152,684.96	
		BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	345,000.00	226,255.48	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	992,000.00	1,117,604.06	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	435,000.00	460,453.15	

BELGIUM KINGDOM-1. 6%-47/06/22	493,000.00	355,577.23	
BELGIUM KINGDOM-1. 7%-50/06/22	461,000.00	326,059.30	
BELGIUM KINGDOM-1. 4%-53/06/22	485,000.00	304,359.32	
BELGIUM KINGDOM-3. 3%-54/06/22	433,000.00	415,936.33	
BELGIUM KINGDOM-3. 5%-55/06/22	235,000.00	233,515.97	
BELGIUM KINGDOM-2. 25%-57/06/22	412,000.00	313,404.28	
BELGIUM KINGDOM-2. 15%-66/06/22	446,000.00	326,211.98	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 45%-71/10/31	345,000.00	176,410.92	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2. 15%-25/10/31	1,455,000.00	1,449,831.84	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 0%-26/01/31	1,045,000.00	1,013,848.55	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 95%-26/04/30	1,055,000.00	1,048,741.74	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2. 8%-26/05/31	485,000.00	487,949.77	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5. 9%-26/07/30	1,360,000.00	1,441,772.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 3%-26/10/31	1,640,000.00	1,607,749.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 0%-27/01/31	755,000.00	716,220.93	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 5%-27/04/30	1,275,000.00	1,249,055.02	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2. 5%-27/05/31	120,000.00	120,300.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 8%-27/07/30	860,000.00	824,328.06	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 45%-27/10/31	1,170,000.00	1,138,851.09	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 0%-28/01/31	1,125,000.00	1,040,827.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 4%-28/04/30	1,270,000.00	1,227,754.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 4%-28/07/30	1,275,000.00	1,229,216.02	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5. 15%-28/10/31	1,020,000.00	1,124,148.12	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6. 0%-29/01/31	1,355,000.00	1,548,494.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 45%-29/04/30	1,025,000.00	980,501.67	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3. 5%-29/05/31	430,000.00	448,175.24	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 8%-29/07/30	1,035,000.00	956,081.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 6%-29/10/31	1,210,000.00	1,101,844.15	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 5%-30/04/30	1,205,000.00	1,079,435.38	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 95%-30/07/30	1,180,000.00	1,141,172.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 25%-30/10/31	1,230,000.00	1,137,934.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 1%-31/04/30	1,175,000.00	998,932.12	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%-31/10/31	1,090,000.00	940,024.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.7%-32/04/30	1,270,000.00	1,097,633.06	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	1,050,000.00	1,268,967.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.55%-32/10/31	985,000.00	969,191.73	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-33/04/30	1,082,000.00	1,107,773.24	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%-33/07/30	1,165,000.00	1,121,080.66	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.55%-33/10/31	1,030,000.00	1,083,538.36	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.25%-34/04/30	738,000.00	756,991.69	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-34/10/31	252,000.00	262,132.92	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%-35/07/30	995,000.00	888,649.42	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	995,000.00	1,100,917.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.85%-37/07/30	670,000.00	505,350.85	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.9%-39/07/30	340,000.00	361,672.96	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	945,000.00	1,118,209.05	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%-40/10/31	1,000,000.00	730,753.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	1,265,000.00	1,471,856.59	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-42/07/30	390,000.00	265,306.47	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-43/07/30	300,000.00	297,093.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	710,000.00	876,908.93	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	980,000.00	886,870.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	785,000.00	676,294.77	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-50/10/31	1,170,000.00	665,719.47	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.9%-52/10/31	743,000.00	518,166.71	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-54/10/31	400,000.00	420,006.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	798,000.00	750,047.38	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-25/10/10	1,650,000.00	1,614,386.40	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-26/04/10	1,600,000.00	1,551,579.20	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-26/10/09	800,000.00	768,886.40	
BUNDESOBLIGATION-0.0%-27/04/16	1,050,000.00	999,374.25	
BUNDESOBLIGATION-1.3%-27/10/15	1,130,000.00	1,107,729.96	

BUNDESOBLIGATION-2. 2%-28/04/13	750,000.00	754,352.25	
BUNDESOBLIGATION-2. 4%-28/10/19	685,000.00	694,105.70	
BUNDESOBLIGATION-2. 1%-29/04/12	297,000.00	297,231.66	
BUNDESOBLIGATION-2. 1%-29/04/12	500,000.00	500,500.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 5%-26/02/15	1,820,000.00	1,781,028.34	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-26/08/15	1,910,000.00	1,841,121.58	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 25%-27/02/15	1,315,000.00	1,264,005.61	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6. 5%-27/07/04	910,000.00	1,014,554.45	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 5%-27/08/15	1,120,000.00	1,075,740.96	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-27/11/15	1,095,000.00	1,030,823.14	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5. 625%-28/01/04	650,000.00	721,818.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 5%-28/02/15	1,690,000.00	1,612,251.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4. 75%-28/07/04	970,000.00	1,063,274.23	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 25%-28/08/15	1,090,000.00	1,022,543.17	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-28/11/15	1,180,000.00	1,089,923.52	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 25%-29/02/15	1,705,000.00	1,584,674.74	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-29/08/15	1,760,000.00	1,598,835.04	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2. 1%-29/11/15	620,000.00	620,012.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6. 25%-30/01/04	660,000.00	792,646.14	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-30/02/15	1,290,000.00	1,159,068.87	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-30/08/15	1,800,000.00	1,600,979.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-30/08/15	740,000.00	658,376.52	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2. 4%-30/11/15	450,000.00	456,741.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5. 5%-31/01/04	1,180,000.00	1,408,180.14	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-31/02/15	1,310,000.00	1,151,796.54	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-31/08/15	1,565,000.00	1,360,069.51	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-31/08/15	160,000.00	139,080.96	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0. 0%-32/02/15	1,323,000.00	1,135,221.31	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1. 7%-32/08/15	1,390,000.00	1,346,221.95	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2. 3%-33/02/15	1,770,000.00	1,784,997.21	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2. 3%-33/02/15	170,000.00	171,487.84	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2. 6%-33/08/15	1,310,000.00	1,349,888.19	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2. 2%-34/02/15	1,080,000.00	1,075,831.20	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	1,300,000.00	1,577,855.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.6%-34/08/15	155,000.00	159,301.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-35/05/15	920,000.00	721,520.12	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-36/05/15	1,000,000.00	761,198.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	1,740,000.00	2,026,821.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%-38/05/15	115,000.00	95,523.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	1,135,000.00	1,373,079.87	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	1,165,000.00	1,494,647.23	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.6%-41/05/15	125,000.00	125,537.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	955,000.00	1,046,762.13	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-44/07/04	1,635,000.00	1,613,720.47	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-46/08/15	1,587,000.00	1,566,991.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%-48/08/15	1,940,000.00	1,487,987.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	1,630,000.00	849,994.47	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	640,000.00	334,312.32	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-52/08/15	900,000.00	446,518.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%-53/08/15	1,040,000.00	876,525.52	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%-53/08/15	500,000.00	422,037.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-54/08/15	425,000.00	417,432.87	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-3.1%-25/12/12	420,000.00	423,493.98	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.5%-26/03/19	280,000.00	281,021.16	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.9%-26/06/18	560,000.00	566,347.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-72/03/01	220,000.00	138,869.06	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-25/11/15	1,100,000.00	1,099,778.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-25/12/01	1,085,000.00	1,079,065.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-26/01/15	810,000.00	818,561.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.2%-26/01/28	215,000.00	216,538.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%-26/02/01	850,000.00	828,469.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-26/03/01	1,130,000.00	1,158,655.67	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-26/04/01	1,020,000.00	984,258.18	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%-26/04/15	950,000.00	966,681.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%-26/06/01	970,000.00	956,929.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%-26/07/15	950,000.00	944,338.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%-26/08/01	375,000.00	359,263.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-26/09/15	540,000.00	553,025.34
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	720,000.00	787,626.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%-26/12/01	1,080,000.00	1,053,859.68
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%-27/01/15	1,005,000.00	970,160.67
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%-27/02/15	90,000.00	90,808.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.1%-27/04/01	410,000.00	396,680.33
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%-27/06/01	1,160,000.00	1,152,047.04
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%-27/07/15	85,000.00	86,953.64
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%-27/08/01	995,000.00	983,292.83
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-27/09/15	775,000.00	741,462.65
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	1,440,000.00	1,605,047.04
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.65%-27/12/01	950,000.00	952,865.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-28/02/01	865,000.00	850,295.86
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%-28/03/15	840,000.00	776,726.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.4%-28/04/01	150,000.00	153,771.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%-28/07/15	1,050,000.00	971,863.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%-28/08/01	650,000.00	675,916.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-28/09/01	1,330,000.00	1,431,054.73
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-28/12/01	1,030,000.00	1,036,002.84
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.1%-29/02/01	735,000.00	774,711.31
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%-29/02/15	605,000.00	550,246.89
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-29/06/15	305,000.00	305,355.93
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%-29/07/01	75,000.00	76,773.67
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%-29/08/01	1,945,000.00	1,965,871.79
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	1,750,000.00	1,952,987.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-29/12/15	535,000.00	560,219.36
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-30/03/01	1,500,000.00	1,550,491.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%-30/04/01	955,000.00	882,696.95

BUONI POLIENNALI DEL TES-3.7%-30/06/15	540,000.00	560,893.68
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-30/08/01	827,000.00	740,838.17
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-30/11/15	585,000.00	617,276.79
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-30/12/01	1,287,000.00	1,192,624.29
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-31/02/15	295,000.00	302,841.39
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%-31/04/01	1,295,000.00	1,136,543.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	1,515,000.00	1,785,898.66
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%-31/08/01	1,120,000.00	954,914.24
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-31/10/30	290,000.00	307,874.15
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-31/12/01	1,010,000.00	874,718.58
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-32/03/01	1,250,000.00	1,133,588.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-32/06/01	990,000.00	845,985.69
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-32/12/01	600,000.00	571,620.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	1,125,000.00	1,329,316.87
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.4%-33/05/01	865,000.00	940,471.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-33/09/01	1,195,000.00	1,123,733.78
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.35%-33/11/01	700,000.00	757,582.70
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.2%-34/03/01	755,000.00	806,777.14
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-34/07/01	390,000.00	404,774.76
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	1,460,000.00	1,657,403.68
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-35/02/01	130,000.00	134,281.55
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%-35/03/01	780,000.00	775,011.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-35/04/30	400,000.00	421,024.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%-36/03/01	770,000.00	622,248.55
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%-36/09/01	965,000.00	845,152.79
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	1,825,000.00	1,908,988.32
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-37/03/01	400,000.00	295,451.60
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.05%-37/10/30	290,000.00	302,355.16
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-38/03/01	200,000.00	190,510.40

BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%-38/09/01	785,000.00	721,101.78	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	1,200,000.00	1,362,916.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.15%-39/10/01	350,000.00	363,315.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%-40/03/01	810,000.00	743,507.91	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	1,070,000.00	1,214,088.34	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%-41/03/01	730,000.00	549,620.65	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.45%-43/09/01	610,000.00	648,917.39	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01	935,000.00	1,038,077.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%-45/04/30	440,000.00	293,409.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-46/09/01	820,000.00	737,011.08	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%-47/03/01	715,000.00	584,793.49	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%-48/03/01	915,000.00	841,929.01	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%-49/09/01	650,000.00	633,473.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%-50/09/01	870,000.00	657,594.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%-51/09/01	640,000.00	407,296.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-52/09/01	280,000.00	194,120.64	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-53/10/01	735,000.00	783,620.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.3%-54/10/01	245,000.00	250,413.76	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	500,000.00	382,070.00	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	245,000.00	238,852.21	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-26/09/15	180,000.00	172,662.84	
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-27/04/15	170,000.00	166,538.97	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	315,000.00	300,183.34	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	330,000.00	335,511.00	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	251,869.77	
FINNISH GOVERNMENT-2.875%-29/04/15	270,000.00	275,492.60	
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	375,000.00	342,165.75	
FINNISH GOVERNMENT-2.5%-30/04/15	87,000.00	87,198.26	
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-30/09/15	292,000.00	252,723.37	
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	365,000.00	326,682.66	
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-31/09/15	200,000.00	169,692.60	
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-32/09/15	230,000.00	211,628.75	

FINNISH GOVERNMENT-3.0%-33/09/15	110,000.00	112,580.93
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	325,000.00	281,847.47
FINNISH GOVERNMENT-3.0%-34/09/15	140,000.00	142,853.48
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	278,000.00	203,798.46
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-38/04/15	210,000.00	204,851.01
FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15	145,000.00	94,822.89
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	252,000.00	238,373.10
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-43/04/15	235,000.00	151,210.51
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	190,422.18
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-52/04/15	230,000.00	107,829.75
FINNISH GOVERNMENT-2.95%-55/04/15	133,000.00	128,992.31
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	515,000.00	184,749.04
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	1,350,000.00	1,396,180.80
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	2,000,000.00	1,970,622.00
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-26/02/25	1,640,000.00	1,590,945.96
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	1,970,000.00	2,003,909.61
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,450,000.00	2,382,651.95
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-26/09/24	1,360,000.00	1,364,114.00
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,520,000.00	2,415,462.84
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-27/02/25	2,005,000.00	1,899,933.99
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	1,775,000.00	1,715,718.55
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-27/09/24	180,000.00	180,478.80
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,020,000.00	3,050,272.48
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/02/25	1,275,000.00	1,206,750.52
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	3,450,000.00	3,249,827.55
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	2,930,000.00	2,731,987.67
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-29/02/25	305,000.00	307,365.58
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	2,105,000.00	2,363,218.24
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	2,980,000.00	2,718,034.16
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-29/11/25	2,510,000.00	2,205,082.69
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	2,935,000.00	2,916,444.93
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-30/11/25	2,839,000.00	2,420,224.78
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	2,940,000.00	2,731,430.52
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-31/11/25	2,605,000.00	2,149,242.22
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-32/05/25	1,833,000.00	1,487,607.81
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	1,655,000.00	1,995,961.44

FRANCE (GOVT OF)-2.0%-32/11/25	2,075,000.00	1,948,134.50	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-33/05/25	1,385,000.00	1,395,330.71	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-33/11/25	2,013,000.00	2,101,036.54	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	2,385,000.00	2,046,155.89	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	1,425,000.00	1,643,188.87	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	2,395,000.00	1,963,756.30	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-38/05/25	290,000.00	226,646.31	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	1,500,000.00	1,627,767.00	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	1,890,000.00	1,563,597.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	2,780,000.00	3,186,233.06	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-43/05/25	165,000.00	144,112.15	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-44/06/25	1,050,000.00	618,613.80	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	1,230,000.00	1,196,150.40	
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	1,380,000.00	1,053,004.86	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-49/06/25	348,000.00	320,246.30	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-50/05/25	1,840,000.00	1,219,244.72	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-52/05/25	1,500,000.00	775,345.50	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-53/05/25	1,320,000.00	664,696.56	
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-54/05/25	850,000.00	757,078.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,130,000.00	1,210,321.53	
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-55/05/25	400,000.00	372,364.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	970,000.00	1,045,577.55	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	945,000.00	591,008.67	
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	505,000.00	495,804.96	
IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15	327,000.00	311,611.70	
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	355,000.00	339,883.03	
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	463,000.00	439,757.40	
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	424,000.00	425,509.86	
IRISH TREASURY-0.2%-30/10/18	282,000.00	248,618.81	
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	335,000.00	314,653.77	
IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	405,000.00	342,693.18	
IRISH TREASURY-0.35%-32/10/18	205,000.00	173,914.00	
IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	238,000.00	216,075.67	
IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	250,000.00	198,121.50	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	365,000.00	323,896.62	
IRISH TREASURY-0.55%-41/04/22	185,000.00	129,709.05	

IRISH TREASURY-3.0%-43/10/18	170,000.00	172,885.92
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	475,000.00	408,504.27
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	411,000.00	307,537.73
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-26/01/15	455,000.00	442,769.14
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	760,000.00	739,142.56
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	635,000.00	606,270.06
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	760,000.00	732,440.12
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	550,000.00	606,307.90
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	841,000.00	798,335.22
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	590,000.00	537,854.03
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	595,000.00	542,528.14
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-30/01/15	395,000.00	398,931.04
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-30/07/15	670,000.00	588,223.82
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-31/07/15	650,000.00	556,041.20
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-32/07/15	560,000.00	485,544.64
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	697,000.00	699,890.45
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/07/15	465,000.00	465,345.03
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-34/07/15	290,000.00	288,780.84
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	905,000.00	1,028,571.41
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-38/01/15	395,000.00	276,262.21
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	763,000.00	552,307.46
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	902,000.00	1,020,601.27
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-44/01/15	220,000.00	235,117.74
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	874,000.00	871,880.55
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	907,000.00	438,294.14
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-54/01/15	539,000.00	456,727.04
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.7%-71/04/20	180,000.00	82,242.00
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	173,000.00	104,854.60
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	343,000.00	262,481.77
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.85%-99/99/99	192,000.00	85,470.72
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	570,000.00	563,615.43
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	550,000.00	569,191.15
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.0%-26/07/15	170,000.00	169,333.94
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	773,000.00	751,572.44
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	656,991.72
REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	487,000.00	538,174.44

		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	660,000.00	627,927.96	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-28/10/20	382,000.00	348,508.15	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	715,000.00	661,111.88	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-29/05/23	225,000.00	229,927.27	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	680,000.00	597,594.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.45%-30/10/20	155,000.00	162,940.65	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-31/02/20	745,000.00	635,648.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.9%-32/02/20	610,000.00	541,096.84	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-33/02/20	715,000.00	726,310.58	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-34/02/20	30,000.00	30,367.23	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	455,000.00	442,356.46	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-36/10/20	270,000.00	198,267.21	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	650,000.00	732,810.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-39/07/15	128,000.00	130,961.53	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	255,000.00	158,814.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	394,000.00	399,296.54	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	503,000.00	377,554.81	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.85%-49/05/23	288,000.00	228,337.05	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	455,000.00	267,146.88	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-53/10/20	206,000.00	206,492.34	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	180,000.00	207,553.50	
			318,100,000.00	301,796,380.56	
				(49,992,570,439)	
	ユーロ小計				
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	760,000.00	342,570.00	
		UK TREASURY-1.125%-73/10/22	513,000.00	186,205.66	
		UK TREASURY-3.5%-25/10/22	1,490,000.00	1,477,324.57	
		UK TREASURY-0.125%-26/01/30	710,000.00	679,480.65	
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	820,000.00	786,650.60	
		UK TREASURY-0.375%-26/10/22	1,260,000.00	1,176,677.46	
		UK TREASURY-4.125%-27/01/29	1,495,000.00	1,494,402.00	
		UK TREASURY-3.75%-27/03/07	1,198,000.00	1,187,737.93	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	755,000.00	704,171.89	
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	850,000.00	857,876.10	
		UK TREASURY-0.125%-28/01/31	745,000.00	662,334.05	
		UK TREASURY-4.5%-28/06/07	1,385,000.00	1,404,514.65	
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	720,000.00	660,978.00	

UK TREASURY-6.0%-28/12/07	710,000.00	765,424.02	
UK TREASURY-0.5%-29/01/31	1,180,000.00	1,023,563.86	
UK TREASURY-4.125%-29/07/22	850,000.00	851,530.00	
UK TREASURY-0.875%-29/10/22	736,000.00	636,727.58	
UK TREASURY-0.375%-30/10/22	870,000.00	707,477.04	
UK TREASURY-4.75%-30/12/07	945,000.00	983,556.00	
UK TREASURY-0.25%-31/07/31	1,045,000.00	816,667.50	
UK TREASURY-4.0%-31/10/22	275,000.00	273,172.62	
UK TREASURY-1.0%-32/01/31	1,645,000.00	1,332,790.51	
UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,030,000.00	1,043,570.25	
UK TREASURY-3.25%-33/01/31	1,490,000.00	1,398,433.54	
UK TREASURY-0.875%-33/07/31	1,270,000.00	967,686.66	
UK TREASURY-4.625%-34/01/31	1,123,000.00	1,159,379.58	
UK TREASURY-4.25%-34/07/31	345,000.00	345,905.97	
UK TREASURY-4.5%-34/09/07	789,000.00	808,356.53	
UK TREASURY-0.625%-35/07/31	967,000.00	667,999.73	
UK TREASURY-4.25%-36/03/07	970,000.00	966,019.12	
UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,220,000.00	909,655.18	
UK TREASURY-3.75%-38/01/29	710,000.00	664,573.49	
UK TREASURY-4.75%-38/12/07	985,000.00	1,017,873.39	
UK TREASURY-1.125%-39/01/31	747,000.00	488,850.99	
UK TREASURY-4.25%-39/09/07	850,000.00	828,623.35	
UK TREASURY-4.25%-40/12/07	815,000.00	788,398.40	
UK TREASURY-1.25%-41/10/22	1,280,000.00	787,161.60	
UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,040,000.00	1,027,000.00	
UK TREASURY-4.75%-43/10/22	260,000.00	263,469.70	
UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,115,000.00	917,873.57	
UK TREASURY-3.5%-45/01/22	980,000.00	830,868.50	
UK TREASURY-0.875%-46/01/31	435,000.00	215,507.70	
UK TREASURY-4.25%-46/12/07	720,000.00	676,481.76	
UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,005,000.00	563,101.50	
UK TREASURY-1.75%-49/01/22	675,000.00	391,556.02	
UK TREASURY-4.25%-49/12/07	895,000.00	836,388.24	
UK TREASURY-0.625%-50/10/22	770,000.00	308,940.94	
UK TREASURY-1.25%-51/07/31	600,000.00	288,824.40	
UK TREASURY-3.75%-52/07/22	872,000.00	744,679.28	

		UK TREASURY-1.5%-53/07/31	580,000.00	290,671.64	
		UK TREASURY-3.75%-53/10/22	1,170,000.00	993,876.39	
		UK TREASURY-4.375%-54/07/31	270,000.00	255,317.13	
		UK TREASURY-1.625%-54/10/22	925,000.00	475,270.55	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	962,000.00	893,260.29	
		UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	559,086.00	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	751,000.00	667,038.20	
		UK TREASURY-0.5%-61/10/22	1,050,000.00	314,119.05	
		UK TREASURY-4.0%-63/10/22	440,000.00	389,145.68	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	830,000.00	662,076.89	
		UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	742,000.00	458,524.83	
英ポンド小計			53,710,000.00	44,877,398.73 (8,927,012,155)	
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	3,680,000.00	3,624,855.20	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,300,000.00	3,182,998.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	3,180,000.00	3,009,758.70	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	2,700,000.00	2,400,529.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,800,000.00	1,832,652.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.75%-33/11/11	1,730,000.00	1,686,464.55	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	2,220,000.00	2,552,877.90	
スウェーデンクローナ小計			18,610,000.00	18,290,136.35 (264,109,568)	
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,400,000.00	2,328,902.40	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,200,000.00	2,110,130.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	1,820,000.00	1,728,526.80	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	1,930,000.00	1,776,910.47	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	2,685,000.00	2,380,521.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.25%-31/09/17	2,040,000.00	1,752,972.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.125%-32/05/18	2,030,000.00	1,833,496.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-33/08/15	2,350,000.00	2,236,713.55	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.625%-34/04/13	1,100,000.00	1,095,094.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.5%-42/10/06	990,000.00	966,721.14	
ノルウェークローネ小計			19,545,000.00	18,209,987.36 (254,029,323)	
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	3,125,000.00	3,117,112.50	
		KINGDOM OF DENMARK-2.25%-26/11/15	950,000.00	957,704.50	

		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	2,380,000.00	2,287,658.38	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	2,290,000.00	2,136,792.13	
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-31/11/15	1,350,000.00	1,176,508.80	
		KINGDOM OF DENMARK-2.25%-33/11/15	700,000.00	708,082.90	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	6,705,000.00	8,485,358.53	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	1,750,000.00	992,517.75	
デンマーククローネ小計			19,250,000.00	19,861,735.49	(440,930,527)
ポーランド ドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-25/10/25	400,000.00	384,920.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-26/04/25	670,000.00	625,981.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,190,000.00	2,105,137.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,600,000.00	1,461,072.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	1,310,000.00	1,269,769.90	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,140,000.00	2,002,333.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,160,000.00	1,995,256.80	
		POLAND GOVERNMENT BOND-7.5%-28/07/25	1,720,000.00	1,847,761.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	2,075,000.00	2,103,022.87	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-29/07/25	1,060,000.00	1,028,730.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	2,565,000.00	2,271,923.10	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	2,025,000.00	1,594,606.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-32/04/25	1,890,000.00	1,452,729.60	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.0%-33/10/25	2,145,000.00	2,184,789.75	
POLAND GOVERNMENT BOND-5.0%-34/10/25	580,000.00	546,162.80			
ポーランドドズロチ小計			24,530,000.00	22,874,197.22	(871,966,685)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	855,000.00	821,107.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	900,000.00	903,654.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,090,000.00	1,022,245.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	980,000.00	999,257.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	830,000.00	802,527.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	795,000.00	751,394.25	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	765,000.00	731,493.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	960,000.00	932,131.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	890,000.00	839,127.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,005,000.00	927,444.15	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	930,000.00	773,536.80	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,083,000.00	916,033.89	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,385,000.00	1,114,357.15	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,250,000.00	1,007,900.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	1,195,000.00	988,217.20	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,130,000.00	1,143,887.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-33/11/21	1,010,000.00	907,586.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-34/05/21	960,000.00	913,056.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-34/06/21	200,000.00	197,846.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.5%-34/12/21	855,000.00	791,815.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	700,000.00	600,460.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-35/12/21	260,000.00	255,530.60	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	550,000.00	510,691.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	522,000.00	447,171.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	710,000.00	551,705.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	675,000.00	504,643.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	870,000.00	464,031.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-54/06/21	325,000.00	318,006.00	
豪ドル小計			23,680,000.00	21,136,858.14 (2,142,220,572)	
ニュージーランドドル	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.5%-26/05/15	335,000.00	318,723.35	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-27/04/15	700,000.00	712,379.50	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.25%-28/05/15	370,000.00	326,571.25	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.0%-29/04/20	680,000.00	654,171.56	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-30/05/15	430,000.00	439,394.64	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.5%-31/05/15	350,000.00	296,693.60	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.0%-32/05/15	225,000.00	192,164.40	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.5%-33/04/14	430,000.00	403,931.25	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.25%-34/05/15	220,000.00	217,064.10	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-35/05/15	280,000.00	279,793.08	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-37/04/15	430,000.00	353,427.32	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.75%-41/05/15	225,000.00	146,899.80	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-51/05/15	500,000.00	339,832.50	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-5.0%-54/05/15	170,000.00	171,368.67	
ニュージーランドドル小計			5,345,000.00	4,852,415.02 (444,917,933)	
シンガポ	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-72/08/01	219,000.00	235,972.50	

ールドル		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-25/11/01	314,000.00	307,217.60	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	420,000.00	416,346.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-26/11/01	365,000.00	354,812.85	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	498,000.00	506,964.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-27/09/01	150,000.00	150,855.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	347,000.00	346,479.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-28/08/01	100,000.00	100,670.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-29/04/01	131,000.00	132,729.20	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	365,000.00	367,381.62	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	440,000.00	443,300.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-31/07/01	300,000.00	279,090.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-32/08/01	170,000.00	167,841.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	335,000.00	349,472.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	391,000.00	368,126.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	206,000.00	193,675.02	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	280,000.00	275,520.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	387,000.00	381,599.41	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	342,000.00	284,886.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-51/10/01	222,000.00	184,038.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.25%-54/06/01	97,000.00	106,827.55	
シンガポールドル小計			6,079,000.00	5,953,803.75 (690,224,468)	
マレーシア アリンギ ット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	830,000.00	837,179.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	920,000.00	929,200.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,200,000.00	1,213,440.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.519%-28/04/20	350,000.00	349,440.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.504%-29/04/30	350,000.00	362,547.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,320,000.00	1,334,520.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	985,000.00	917,527.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.582%-32/07/15	100,000.00	98,347.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	738,885.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,000,000.00	996,510.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	760,000.00	780,900.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,320,000.00	1,418,722.80	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	1,080,000.00	1,178,550.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	1,490,000.00	1,440,755.50	

		MALAYSIA GOVERNMENT-4.696%-42/10/15	750,000.00	810,750.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	660,000.00	732,797.34	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	620,000.00	670,940.44	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	510,000.00	565,707.30	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	1,410,000.00	1,382,857.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.457%-53/03/31	760,000.00	788,880.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	650,000.00	659,816.95	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	950,190.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,410,000.00	1,416,909.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,150,000.00	1,194,502.70	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,058,443.78	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	1,010,000.00	1,006,629.63	
			23,320,000.00	23,834,949.44	
		マレーシアリングット小計		(839,335,827)	
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	32,000,000.00	32,505,942.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-25/11/25	20,000,000.00	20,167,257.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.22%-25/12/06	18,800,000.00	19,183,275.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.46%-26/02/15	10,900,000.00	11,029,126.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	17,000,000.00	17,364,888.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.3%-26/05/15	16,000,000.00	16,192,173.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-26/06/06	11,000,000.00	11,311,157.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	16,000,000.00	16,324,552.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-26/08/15	32,000,000.00	32,367,870.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.39%-26/11/15	6,000,000.00	6,093,544.20	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-26/12/05	23,000,000.00	23,752,008.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-27/01/20	10,000,000.00	10,167,001.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.04%-27/02/25	14,000,000.00	14,135,965.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.85%-27/05/15	11,000,000.00	11,063,550.85	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	24,000,000.00	24,740,472.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	16,000,000.00	16,364,000.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.62%-27/08/15	4,100,000.00	4,099,913.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.44%-27/10/15	9,100,000.00	9,300,960.76	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.28%-27/12/03	19,500,000.00	20,498,819.25	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.64%-28/01/15	10,000,000.00	10,278,740.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-28/04/15	11,000,000.00	11,307,040.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	13,000,000.00	13,576,550.00	

CHINA GOVERNMENT BOND-2.4%-28/07/15	10,900,000.00	11,127,530.41	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.48%-28/09/25	3,000,000.00	3,072,804.90	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	22,000,000.00	22,927,388.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.55%-28/10/15	10,000,000.00	10,282,496.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-28/11/22	10,000,000.00	10,618,905.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-29/01/15	7,500,000.00	7,662,620.25	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-29/03/24	15,000,000.00	15,604,365.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.05%-29/04/15	10,000,000.00	10,090,866.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-29/05/23	14,000,000.00	14,966,728.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-29/06/15	5,200,000.00	5,404,373.52	
CHINA GOVERNMENT BOND-1.91%-29/07/15	9,500,000.00	9,529,061.92	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-29/09/25	20,200,000.00	20,913,605.40	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.13%-29/11/21	2,700,000.00	2,872,654.20	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.79%-29/12/15	5,000,000.00	5,223,557.50	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-30/03/25	15,000,000.00	15,679,513.50	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	17,900,000.00	18,618,300.15	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-30/06/25	9,800,000.00	10,149,284.74	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-30/09/15	24,100,000.00	24,931,196.95	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	11,000,000.00	11,887,029.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.54%-30/12/25	8,400,000.00	8,665,023.36	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-31/03/25	13,000,000.00	13,192,661.30	
CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	10,000,000.00	10,648,246.50	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.12%-31/06/25	16,000,000.00	16,087,166.40	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.89%-31/11/18	8,000,000.00	8,439,378.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	10,000,000.00	10,448,229.50	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.76%-32/05/15	9,000,000.00	9,414,759.15	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-32/08/15	9,000,000.00	9,366,276.60	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-32/09/01	7,400,000.00	7,658,948.20	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-32/11/15	6,000,000.00	6,300,408.30	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-33/02/25	11,000,000.00	11,661,684.65	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/05/25	12,000,000.00	12,479,052.00	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.52%-33/08/25	12,800,000.00	13,167,249.28	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/11/25	19,700,000.00	20,512,281.23	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.35%-34/02/25	15,000,000.00	15,238,292.25	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.27%-34/05/25	13,000,000.00	13,148,346.90	
CHINA GOVERNMENT BOND-2.11%-34/08/25	11,000,000.00	10,961,395.50	

		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	21,000,000.00	26,825,463.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	10,000,000.00	12,641,000.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.53%-51/10/18	10,000,000.00	12,303,370.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.32%-52/04/15	10,000,000.00	11,932,170.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-52/10/25	8,000,000.00	9,227,228.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-53/04/15	9,000,000.00	10,541,983.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.0%-53/10/15	9,900,000.00	11,291,998.90	
中国元小計			836,400,000.00	875,539,703.22 (18,856,848,804)	
イスラエル シュケ ル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-0.5%-26/02/27	1,080,000.00	1,024,556.22	
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	950,000.00	980,626.56	
		ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,270,000.00	1,195,317.68	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-27/09/30	670,000.00	653,829.89	
		ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,160,000.00	1,060,278.47	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-29/02/28	1,110,000.00	1,068,834.12	
		ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	1,645,000.00	1,355,023.03	
		ISRAEL FIXED BOND-1.3%-32/04/30	1,360,000.00	1,060,530.15	
		ISRAEL FIXED BOND-4.0%-35/03/30	380,000.00	350,473.74	
		ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	1,150,000.00	769,503.61	
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,160,000.00	1,195,509.36	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,300,000.00	1,028,515.64	
		ISRAEL FIXED BOND-2.8%-52/11/29	640,000.00	398,957.94	
イスラエルシュケル小計			13,875,000.00	12,141,956.41 (491,234,415)	
合計				166,410,220,148 (166,410,220,148)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 219 銘柄	100.0%	46.7%
加ドル	国債証券 40 銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 14 銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 372 銘柄	100.0%	30.0%
英ポンド	国債証券 60 銘柄	100.0%	5.4%
スウェーデンクローナ	国債証券 7 銘柄	100.0%	0.2%

ノルウェークローネ	国債証券	10 銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	8 銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券	15 銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券	28 銘柄	100.0%	1.3%
ニュージーランドドル	国債証券	14 銘柄	100.0%	0.3%
シンガポールドル	国債証券	21 銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券	26 銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券	65 銘柄	100.0%	11.3%
イスラエルシェケル	国債証券	13 銘柄	100.0%	0.3%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
資産の部		
流動資産		
預金	123,122,262	137,391,198
コール・ローン	110,947,468	591,207,755
国債証券	21,787,959,645	24,371,023,462
派生商品評価勘定	18,312,655	46,904
未収利息	209,470,586	225,921,613
前払費用	8,852,572	20,849,114
流動資産合計	22,258,665,188	25,346,440,046
資産合計	22,258,665,188	25,346,440,046
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	460,728,964	1,695,364,468
未払解約金	67,101,831	1,471,983
未払利息	39	-
流動負債合計	527,830,834	1,696,836,451
負債合計	527,830,834	1,696,836,451
純資産の部		
元本等		
元本	17,138,690,473	18,061,047,708
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	4,592,143,881	5,588,555,887
元本等合計	21,730,834,354	23,649,603,595
純資産合計	21,730,834,354	23,649,603,595
負債純資産合計	22,258,665,188	25,346,440,046

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

		2023 年 10 月 26 日現在	2024 年 10 月 28 日現在
1.	期首	2022 年 10 月 27 日	2023 年 10 月 27 日
	期首元本額	15,845,617,925 円	17,138,690,473 円
	期首からの追加設定元本額	2,354,550,563 円	2,604,536,861 円
	期首からの一部解約元本額	1,061,478,015 円	1,682,179,626 円
	元本の内訳 ※		
	インデックスファンド海外債券ヘッジあり (DC 専用)	5,910,698,702 円	7,117,475,880 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)	1,472,658,217 円	1,518,073,694 円
	Tracers グローバル 3 分法 (おとなのバランス)	100,476,621 円	365,623,052 円
	Ni つみインデックススラップ世界 10 指数 (均等型)	1,048,129 円	2,954,815 円
	Ni つみインデックススラップ世界 10 指数 (安定成長型)	2,939,011 円	6,248,483 円
	国際分散型ファンド 40 (適格機関投資家向け)	8,565,178,549 円	7,913,834,030 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 20)	125,965,523 円	129,062,711 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 40)	182,207,848 円	195,561,367 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 60)	193,562,007 円	217,222,207 円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド (株式 80)	147,415,694 円	166,638,873 円
	インデックスファンド海外債券 (ヘッジあり) 1 年決算型	436,540,172 円	428,352,596 円
	計	17,138,690,473 円	18,061,047,708 円
2.	受益権の総数	17,138,690,473 口	18,061,047,708 口

※ 当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

	自 2022 年 10 月 27 日 至 2023 年 10 月 26 日	自 2023 年 10 月 27 日 至 2024 年 10 月 28 日
--	--	--

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

II 金融商品の時価等に関する事項

	2023年10月26日現在	2024年10月28日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2023年10月26日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△877,607,372
合計	△877,607,372

(2024年10月28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	1,129,636,041

合計	1,129,636,041
----	---------------

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2023年10月26日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	21,742,315,495	—	22,184,731,804	△442,416,309
	米ドル	10,371,147,639	—	10,725,625,335	△354,477,696
	加ドル	426,742,920	—	432,879,477	△6,136,557
	メキシコペソ	198,524,765	—	194,702,730	3,822,035
	ユーロ	7,052,149,077	—	7,112,715,743	△60,566,666
	英ポンド	1,093,975,070	—	1,085,477,507	8,497,563
	スウェーデンクローナ	54,263,605	—	55,149,799	△886,194
	ノルウェークローネ	42,920,883	—	42,013,685	907,198
	デンマーククローネ	68,400,217	—	68,881,019	△480,802
	ポーランドズロチ	118,128,388	—	119,818,243	△1,689,855
	豪ドル	303,959,331	—	303,872,085	87,246
	ニュージーランドドル	35,337,141	—	35,766,625	△429,484
	シンガポールドル	89,378,337	—	90,461,010	△1,082,673
	マレーシアリンギット	315,893,920	—	316,518,941	△625,021
	中国元	1,496,360,965	—	1,528,579,892	△32,218,927
	イスラエルシェケル	75,133,237	—	72,269,713	2,863,524
合計	21,742,315,495	—	22,184,731,804	△442,416,309	

(2024年10月28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	23,269,245,529	—	24,964,563,093	△1,695,317,564
	米ドル	10,740,851,251	—	11,708,435,156	△967,583,905
	加ドル	449,777,865	—	479,151,459	△29,373,594
	メキシコペソ	166,671,185	—	172,787,085	△6,115,900

ユーロ	6,908,063,342	—	7,327,846,415	△419,783,073
英ポンド	1,238,702,078	—	1,328,517,514	△89,815,436
スウェーデンクローナ	57,318,537	—	59,919,402	△2,600,865
ノルウェークローネ	43,888,237	—	45,986,542	△2,098,305
デンマーククローネ	77,975,188	—	80,557,294	△2,582,106
ポーランドズロチ	113,495,932	—	117,305,592	△3,809,660
豪ドル	284,824,879	—	292,012,278	△7,187,399
ニュージーランドドル	40,508,137	—	41,853,887	△1,345,750
シンガポールドル	99,911,134	—	104,245,768	△4,334,634
マレーシアリンギット	345,199,053	—	371,823,372	△26,624,319
中国元	2,654,011,762	—	2,784,521,484	△130,509,722
イスラエルシケル	48,046,949	—	49,599,845	△1,552,896
合計	23,269,245,529	—	24,964,563,093	△1,695,317,564

(注) 1. 時価の算定方法

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

- ① 同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
- ② 同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年10月26日現在		2024年10月28日現在	
1口当たり純資産額	1.2679円	1口当たり純資産額	1.3094円
(1万口当たり純資産額)	(12,679円)	(1万口当たり純資産額)	(13,094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-2.25%-25/11/15	3,200,000.00	3,133,536.00	
		US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	1,500,000.00	1,438,125.00	
		US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	1,500,000.00	1,472,518.50	
		US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	550,000.00	539,365.20	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	1,600,000.00	1,548,312.00	
		US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	1,000,000.00	951,992.00	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	2,100,000.00	2,021,250.00	
		US TREASURY N/B-0.625%-26/07/31	1,200,000.00	1,129,358.40	
		US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	900,000.00	859,657.50	
		US TREASURY N/B-4.375%-26/08/15	200,000.00	200,890.60	
		US TREASURY N/B-1.375%-26/08/31	500,000.00	476,054.50	
		US TREASURY N/B-4.625%-26/09/15	850,000.00	857,918.60	
		US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,200,000.00	3,070,873.60	
		US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	500,000.00	475,605.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	1,100,000.00	1,056,300.30	
		US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,000,000.00	935,000.00	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	2,200,000.00	2,014,975.60	
		US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	1,500,000.00	1,439,121.00	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	1,100,000.00	1,047,706.00	
		US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	500,000.00	449,707.00	
		US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	1,100,000.00	990,171.60	
		US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	530,000.00	561,778.80	
		US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	600,000.00	569,062.20	
		US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	1,740,000.00	1,567,766.10	
		US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	900,000.00	863,648.10	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	1,000,000.00	908,554.00	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	900,000.00	815,923.80	
		US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	1,150,000.00	1,040,232.50	
		US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	1,200,000.00	1,072,593.60	
		US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	1,500,000.00	1,437,421.50	
		US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	500,000.00	448,027.00	
		US TREASURY N/B-4.375%-28/08/31	300,000.00	303,140.40	

US TREASURY N/B-1. 25%-28/09/30	500,000.00	449,238.00	
US TREASURY N/B-5. 25%-28/11/15	210,000.00	219,351.51	
US TREASURY N/B-1. 375%-28/12/31	650,000.00	583,285.95	
US TREASURY N/B-2. 625%-29/02/15	900,000.00	849,005.10	
US TREASURY N/B-1. 875%-29/02/28	1,000,000.00	913,203.00	
US TREASURY N/B-2. 375%-29/03/31	500,000.00	465,839.50	
US TREASURY N/B-2. 375%-29/05/15	1,600,000.00	1,488,624.00	
US TREASURY N/B-4. 25%-29/06/30	800,000.00	806,031.20	
US TREASURY N/B-2. 625%-29/07/31	900,000.00	843,907.50	
US TREASURY N/B-1. 75%-29/11/15	850,000.00	762,044.55	
US TREASURY N/B-1. 5%-30/02/15	2,100,000.00	1,842,666.00	
US TREASURY N/B-4. 0%-30/02/28	950,000.00	946,103.10	
US TREASURY N/B-0. 625%-30/05/15	1,700,000.00	1,409,272.80	
US TREASURY N/B-3. 75%-30/05/31	500,000.00	491,347.50	
US TREASURY N/B-4. 125%-30/08/31	500,000.00	500,332.00	
US TREASURY N/B-0. 875%-30/11/15	950,000.00	787,868.25	
US TREASURY N/B-5. 375%-31/02/15	900,000.00	964,651.50	
US TREASURY N/B-1. 625%-31/05/15	600,000.00	514,171.80	
US TREASURY N/B-4. 125%-31/07/31	1,100,000.00	1,098,625.00	
US TREASURY N/B-1. 25%-31/08/15	900,000.00	746,472.60	
US TREASURY N/B-1. 375%-31/11/15	800,000.00	664,936.80	
US TREASURY N/B-1. 875%-32/02/15	1,000,000.00	856,503.00	
US TREASURY N/B-2. 875%-32/05/15	900,000.00	824,607.00	
US TREASURY N/B-2. 75%-32/08/15	300,000.00	271,628.70	
US TREASURY N/B-4. 125%-32/11/15	750,000.00	747,553.50	
US TREASURY N/B-3. 5%-33/02/15	800,000.00	761,265.60	
US TREASURY N/B-3. 375%-33/05/15	500,000.00	470,439.00	
US TREASURY N/B-3. 875%-33/08/15	900,000.00	877,640.40	
US TREASURY N/B-4. 5%-33/11/15	650,000.00	663,520.00	
US TREASURY N/B-4. 0%-34/02/15	700,000.00	687,640.10	
US TREASURY N/B-4. 375%-34/05/15	1,200,000.00	1,213,124.40	
US TREASURY N/B-4. 5%-36/02/15	390,000.00	401,608.35	
US TREASURY N/B-4. 375%-38/02/15	170,000.00	171,188.64	
US TREASURY N/B-3. 5%-39/02/15	390,000.00	354,625.44	
US TREASURY N/B-4. 375%-39/11/15	100,000.00	99,595.70	
US TREASURY N/B-4. 375%-40/05/15	230,000.00	228,697.05	

US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	220,000.00	205,992.16	
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	200,000.00	198,281.20	
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	200,000.00	182,953.00	
US TREASURY N/B-3.125%-41/11/15	350,000.00	293,138.65	
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	300,000.00	232,687.50	
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	100,000.00	82,046.80	
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	250,000.00	196,464.75	
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	140,000.00	122,948.42	
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	200,000.00	178,539.00	
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	450,000.00	393,556.50	
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	420,000.00	353,439.66	
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	450,000.00	354,620.70	
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	350,000.00	252,136.50	
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	450,000.00	353,214.45	
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	700,000.00	536,784.50	
US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	200,000.00	156,445.20	
US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	650,000.00	462,667.40	
US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	150,000.00	106,394.40	
US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	750,000.00	504,726.00	
US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	300,000.00	227,144.40	
US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	750,000.00	551,000.25	
US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	550,000.00	403,530.05	
US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	650,000.00	496,881.45	
US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	1,000,000.00	649,843.00	
US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	350,000.00	213,807.30	
US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	1,550,000.00	774,514.85	
US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	1,600,000.00	823,187.20	
US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	400,000.00	219,984.00	
US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	1,000,000.00	586,640.00	
US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	400,000.00	264,781.20	
US TREASURY N/B-2.875%-52/05/15	1,270,000.00	934,614.59	
US TREASURY N/B-3.625%-53/02/15	300,000.00	256,535.10	
US TREASURY N/B-4.125%-53/08/15	200,000.00	187,250.00	
US TREASURY N/B-4.25%-54/02/15	450,000.00	430,875.00	
US TREASURY N/B-4.625%-54/05/15	300,000.00	305,859.30	
US TREASURY N/B-4.25%-54/08/15	300,000.00	287,531.10	

米ドル小計			83,410,000.00	74,454,216.52 (11,424,999,524)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-25/10/01	500,000.00	498,655.00
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	400,000.00	384,816.00
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-26/08/01	200,000.00	202,886.00
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	250,000.00	240,055.00
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-28/03/01	300,000.00	304,770.00
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	280,000.00	313,362.00
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	400,000.00	388,436.00
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	100,000.00	90,705.00
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	410,000.00	370,439.10
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-32/12/01	200,000.00	190,090.00
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-34/06/01	300,000.00	293,730.00
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	210,000.00	246,088.50
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	200,000.00	203,560.00
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	550,000.00	413,693.50
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	100,000.00	87,643.00
加ドル小計			4,400,000.00	4,228,929.10 (467,212,086)
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%-26/03/05	4,000,000.00	3,776,250.00
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	3,000,000.00	2,726,250.00
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	2,000,000.00	1,891,250.00
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	4,000,000.00	3,786,250.00
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-31/05/29	2,500,000.00	2,239,062.50
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	4,500,000.00	3,936,093.75
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	3,000,000.00	2,359,687.50
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	980,000.00	776,650.00
メキシコペソ小計			23,980,000.00	21,491,493.75 (165,263,139)
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	60,000.00	24,912.60
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	150,000.00	154,542.90
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	100,000.00	96,318.50
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	130,000.00	143,337.74
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	200,000.00	189,512.80
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	250,000.00	218,870.25
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	300,000.00	271,336.80

BELGIUM KINGDOM-4. 0%-32/03/28	170,000.00	184,989.58	
BELGIUM KINGDOM-5. 0%-35/03/28	260,000.00	308,161.88	
BELGIUM KINGDOM-4. 25%-41/03/28	150,000.00	168,992.55	
BELGIUM KINGDOM-3. 75%-45/06/22	120,000.00	127,021.56	
BELGIUM KINGDOM-1. 7%-50/06/22	200,000.00	141,457.40	
BELGIUM KINGDOM-1. 4%-53/06/22	50,000.00	31,377.25	
BELGIUM KINGDOM-3. 5%-55/06/22	100,000.00	99,368.50	
BELGIUM KINGDOM-2. 25%-57/06/22	50,000.00	38,034.50	
BELGIUM KINGDOM-2. 15%-66/06/22	110,000.00	80,455.87	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 45%-71/10/31	100,000.00	51,133.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 95%-26/04/30	350,000.00	347,923.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5. 9%-26/07/30	400,000.00	424,050.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 3%-26/10/31	200,000.00	196,067.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 5%-27/04/30	350,000.00	342,877.85	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 4%-28/04/30	300,000.00	290,020.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 4%-28/07/30	100,000.00	96,409.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5. 15%-28/10/31	300,000.00	330,631.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6. 0%-29/01/31	430,000.00	491,404.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3. 5%-29/05/31	300,000.00	312,680.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 6%-29/10/31	150,000.00	136,592.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 95%-30/07/30	150,000.00	145,064.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1. 25%-30/10/31	300,000.00	277,545.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 1%-31/04/30	150,000.00	127,523.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0. 7%-32/04/30	200,000.00	172,855.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5. 75%-32/07/30	200,000.00	241,708.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3. 15%-33/04/30	200,000.00	204,764.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2. 35%-33/07/30	300,000.00	288,690.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3. 55%-33/10/31	350,000.00	368,192.65	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4. 2%-37/01/31	430,000.00	475,773.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4. 7%-41/07/30	300,000.00	349,056.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5. 15%-44/10/31	150,000.00	185,262.45	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	300,000.00	271,491.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	250,000.00	215,380.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.9%-52/10/31	80,000.00	55,791.84	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	100,000.00	93,990.90	
BUNDESOBLIGATION-2.4%-28/10/19	150,000.00	151,993.95	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-26/02/15	750,000.00	733,940.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-27/02/15	400,000.00	384,488.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-27/08/15	450,000.00	432,217.35	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%-28/01/04	260,000.00	288,727.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%-28/02/15	500,000.00	476,997.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-28/07/04	200,000.00	219,231.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%-29/02/15	200,000.00	185,885.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.1%-29/11/15	450,000.00	450,009.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%-30/01/04	430,000.00	516,420.97	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.4%-30/11/15	100,000.00	101,498.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%-31/01/04	420,000.00	501,216.66	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.7%-32/08/15	650,000.00	629,528.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.3%-33/02/15	500,000.00	504,236.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.6%-33/08/15	350,000.00	360,657.15	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-34/07/04	300,000.00	364,120.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%-37/01/04	260,000.00	302,858.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%-39/07/04	250,000.00	302,440.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%-40/07/04	270,000.00	346,398.93	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%-42/07/04	200,000.00	219,217.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-44/07/04	150,000.00	148,047.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-46/08/15	230,000.00	227,100.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-50/08/15	200,000.00	104,293.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%-52/08/15	200,000.00	99,226.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%-53/08/15	250,000.00	210,703.25	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%-53/08/15	100,000.00	84,407.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%-54/08/15	150,000.00	147,329.25	

BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.7%-26/09/17	200,000.00	202,050.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%-25/11/15	300,000.00	299,939.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-26/03/01	550,000.00	563,947.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%-26/04/15	400,000.00	407,023.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%-26/11/01	550,000.00	601,658.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%-26/12/01	300,000.00	292,738.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.1%-27/04/01	300,000.00	290,253.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%-27/08/01	150,000.00	148,235.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%-27/11/01	250,000.00	278,654.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%-28/02/01	150,000.00	147,450.15	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%-28/03/15	150,000.00	138,701.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%-28/08/01	380,000.00	395,151.36	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-28/09/01	300,000.00	322,794.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%-29/11/01	450,000.00	502,196.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%-30/03/01	350,000.00	361,781.35	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-30/08/01	150,000.00	134,372.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%-31/04/01	350,000.00	307,174.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%-31/05/01	350,000.00	412,583.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%-32/03/01	300,000.00	272,061.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%-32/06/01	100,000.00	85,453.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%-33/02/01	250,000.00	295,403.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.4%-33/05/01	650,000.00	706,712.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.35%-33/11/01	200,000.00	216,452.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-34/08/01	350,000.00	397,322.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-35/04/30	400,000.00	421,024.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%-37/02/01	260,000.00	271,965.46	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-39/08/01	150,000.00	170,364.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%-40/09/01	300,000.00	340,398.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%-44/09/01	150,000.00	166,536.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%-46/09/01	450,000.00	404,457.30	

BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%-48/03/01	400,000.00	368,056.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%-52/09/01	140,000.00	97,060.32	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.3%-54/10/01	150,000.00	153,314.55	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	250,000.00	191,035.00	
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	200,000.00	203,340.00	
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	100,000.00	89,502.10	
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	150,000.00	130,083.45	
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	100,000.00	94,592.50	
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	100,000.00	73,239.30	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	270,000.00	96,858.72	
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	450,000.00	465,393.60	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	450,000.00	443,389.95	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	400,000.00	406,885.20	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	250,000.00	243,127.75	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-26/09/24	300,000.00	300,907.50	
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	600,000.00	579,961.20	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	500,000.00	505,012.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/02/25	150,000.00	141,970.65	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	250,000.00	235,494.75	
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	400,000.00	372,967.60	
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-29/02/25	150,000.00	151,163.40	
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	490,000.00	550,107.81	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	200,000.00	182,418.40	
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	750,000.00	745,258.50	
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-30/11/25	100,000.00	85,249.20	
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	950,000.00	882,605.10	
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	600,000.00	723,611.40	
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-32/11/25	400,000.00	375,544.00	
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-33/11/25	300,000.00	313,120.20	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	300,000.00	257,378.10	
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	280,000.00	322,872.20	
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	300,000.00	245,982.00	
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	460,000.00	499,181.88	
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	150,000.00	124,095.00	
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-40/05/25	270,000.00	178,184.61	

		FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	250,000.00	286,531.75	
		FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	370,000.00	359,817.60	
		FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	200,000.00	152,609.40	
		FRANCE (GOVT OF)-0.75%-52/05/25	300,000.00	155,069.10	
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	320,000.00	342,745.92	
		FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	350,000.00	377,270.25	
		IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	300,000.00	301,068.30	
		IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	300,000.00	253,846.80	
		IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	100,000.00	88,738.80	
		IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	100,000.00	86,000.90	
		IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	50,000.00	37,413.35	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	250,000.00	243,139.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	270,000.00	297,642.06	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	200,000.00	182,323.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-32/07/15	150,000.00	130,056.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	230,000.00	230,953.81	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	300,000.00	340,962.90	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	200,000.00	144,772.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	50,000.00	56,574.35	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	200,000.00	199,515.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-54/01/15	100,000.00	84,736.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	130,000.00	99,482.89	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	150,000.00	148,319.85	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	100,000.00	103,489.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	200,000.00	221,016.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	370,000.00	342,113.84	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	200,000.00	194,442.40	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	200,000.00	225,480.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	100,000.00	101,344.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	50,000.00	29,356.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	80,000.00	92,246.00	
			43,880,000.00	43,557,667.47	
				(7,215,327,616)	
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.5%-26/07/22	350,000.00	335,765.50	
		UK TREASURY-4.125%-27/01/29	150,000.00	149,940.00	
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	250,000.00	233,169.50	

		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	150,000.00	151,389.90	
		UK TREASURY-4.5%-28/06/07	100,000.00	101,409.00	
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	320,000.00	344,979.84	
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	350,000.00	302,791.65	
		UK TREASURY-0.375%-30/10/22	200,000.00	162,638.40	
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	200,000.00	208,160.00	
		UK TREASURY-4.0%-31/10/22	150,000.00	149,003.25	
		UK TREASURY-1.0%-32/01/31	100,000.00	81,020.70	
		UK TREASURY-4.25%-32/06/07	280,000.00	283,689.00	
		UK TREASURY-3.25%-33/01/31	200,000.00	187,709.20	
		UK TREASURY-0.875%-33/07/31	280,000.00	213,348.24	
		UK TREASURY-4.25%-34/07/31	150,000.00	150,393.90	
		UK TREASURY-4.5%-34/09/07	300,000.00	307,359.90	
		UK TREASURY-0.625%-35/07/31	220,000.00	151,975.12	
		UK TREASURY-4.25%-36/03/07	200,000.00	199,179.20	
		UK TREASURY-1.75%-37/09/07	250,000.00	186,404.75	
		UK TREASURY-3.75%-38/01/29	200,000.00	187,203.80	
		UK TREASURY-4.75%-38/12/07	170,000.00	175,673.58	
		UK TREASURY-4.25%-40/12/07	250,000.00	241,840.00	
		UK TREASURY-4.5%-42/12/07	120,000.00	118,500.00	
		UK TREASURY-3.25%-44/01/22	350,000.00	288,121.75	
		UK TREASURY-3.5%-45/01/22	50,000.00	42,391.25	
		UK TREASURY-4.25%-46/12/07	350,000.00	328,845.30	
		UK TREASURY-1.5%-47/07/22	100,000.00	56,030.00	
		UK TREASURY-1.75%-49/01/22	100,000.00	58,008.30	
		UK TREASURY-4.25%-55/12/07	560,000.00	519,985.20	
		UK TREASURY-4.0%-60/01/22	400,000.00	355,280.00	
		UK TREASURY-3.5%-68/07/22	300,000.00	239,304.90	
英bond小計			7,150,000.00	6,511,511.13 (1,295,269,793)	
スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	1,500,000.00	1,477,522.50	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,750,000.00	1,781,745.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	700,000.00	804,961.50	
スウェーデンクローナ小計			3,950,000.00	4,064,229.00 (58,687,466)	
ノルウェー	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	1,000,000.00	970,376.00	

ークローネ		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	1,300,000.00	1,234,662.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-33/08/15	1,000,000.00	951,793.00	
ノルウェークローネ小計			3,300,000.00	3,156,831.00	(44,037,792)
デンマーククローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	500,000.00	498,738.00	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	2,300,000.00	2,910,712.10	
デンマーククローネ小計			2,800,000.00	3,409,450.10	(75,689,792)
ポーランドズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,200,000.00	1,095,804.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	500,000.00	484,645.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	1,000,000.00	885,740.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.0%-33/10/25	500,000.00	509,275.00	
ポーランドズロチ小計			3,200,000.00	2,975,464.00	(113,424,985)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	150,000.00	144,054.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	280,000.00	281,136.80	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	150,000.00	152,947.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	200,000.00	193,380.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	350,000.00	339,839.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	300,000.00	276,849.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	300,000.00	249,528.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	150,000.00	126,874.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	250,000.00	206,740.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-33/11/21	200,000.00	179,720.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	300,000.00	278,559.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	370,000.00	276,619.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-54/06/21	100,000.00	97,848.00	
豪ドル小計			3,100,000.00	2,804,095.70	(284,195,099)
ニュージーランドドル	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.0%-29/04/20	150,000.00	144,302.55	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.5%-33/04/14	190,000.00	178,481.25	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-37/04/15	150,000.00	123,288.60	
ニュージーランドドル小計			490,000.00	446,072.40	(40,900,378)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	400,000.00	407,200.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	100,000.00	104,320.00	

		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	150,000.00	147,600.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	190,000.00	187,348.55	
シンガポールドル小計			840,000.00	846,468.55	(98,131,099)
マレーシア リング ット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	1,000,000.00	1,010,000.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,400,000.00	1,415,680.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,000,000.00	1,011,000.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,000,000.00	996,510.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	500,000.00	555,149.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	2,250,000.00	2,283,981.75	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,000,000.00	1,004,900.00	
マレーシアリングット小計			8,150,000.00	8,277,221.25	(291,478,207)
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	2,000,000.00	2,031,621.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-25/11/25	3,000,000.00	3,025,088.55	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.33%-25/12/15	2,000,000.00	2,018,202.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.46%-26/02/15	3,000,000.00	3,035,539.35	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	1,000,000.00	1,021,464.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.3%-26/05/15	3,000,000.00	3,036,032.55	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.67%-26/06/15	2,000,000.00	2,007,316.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	1,000,000.00	1,020,284.55	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-26/08/15	3,000,000.00	3,034,487.85	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.39%-26/11/15	5,000,000.00	5,077,953.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-27/01/20	2,000,000.00	2,033,400.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.04%-27/02/25	4,000,000.00	4,038,847.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.48%-27/04/15	3,000,000.00	3,060,027.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.85%-27/05/15	2,000,000.00	2,011,554.70	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	3,000,000.00	3,068,250.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.62%-27/08/15	2,000,000.00	1,999,958.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.64%-28/01/15	2,000,000.00	2,055,748.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-28/04/15	3,000,000.00	3,083,738.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	4,000,000.00	4,177,400.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.48%-28/09/25	3,000,000.00	3,072,804.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	1,000,000.00	1,042,154.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-29/01/15	5,000,000.00	5,108,413.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-29/03/24	4,000,000.00	4,161,164.00	

		CHINA GOVERNMENT BOND-2.05%-29/04/15	1,000,000.00	1,009,086.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-29/06/15	3,000,000.00	3,117,907.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.91%-29/07/15	2,000,000.00	2,006,118.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.79%-29/12/15	4,000,000.00	4,178,846.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-30/03/25	2,000,000.00	2,090,601.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-30/06/25	1,000,000.00	1,035,641.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-30/09/15	3,000,000.00	3,103,468.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.54%-30/12/25	3,000,000.00	3,094,651.20	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-31/03/25	4,000,000.00	4,059,280.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	2,000,000.00	2,129,649.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-1.87%-31/09/15	3,000,000.00	2,969,121.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.89%-31/11/18	1,000,000.00	1,054,922.25	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	3,000,000.00	3,134,468.85	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-32/09/01	1,000,000.00	1,034,993.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-33/02/25	3,000,000.00	3,180,459.45	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/05/25	3,000,000.00	3,119,763.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.52%-33/08/25	1,000,000.00	1,028,691.35	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/11/25	2,000,000.00	2,082,465.10	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.35%-34/02/25	3,000,000.00	3,047,658.45	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.27%-34/05/25	1,000,000.00	1,011,411.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.11%-34/08/25	3,000,000.00	2,989,471.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	2,000,000.00	2,554,806.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	1,000,000.00	1,264,100.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.32%-52/04/15	4,000,000.00	4,772,868.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-52/10/25	1,000,000.00	1,153,403.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-53/04/15	1,000,000.00	1,171,331.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.0%-53/10/15	1,800,000.00	2,053,090.71	
中国元小計			122,800,000.00	127,669,727.01 (2,749,673,978)	
イスラエル シュケ ル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	500,000.00	516,119.24	
		ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	620,000.00	638,979.14	
イスラエルシュケル小計			1,120,000.00	1,155,098.38 (46,732,508)	
合計				24,371,023,462 (24,371,023,462)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 104 銘柄	100.0%	46.8%
加ドル	国債証券 15 銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 8 銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 165 銘柄	100.0%	29.6%
英ポンド	国債証券 31 銘柄	100.0%	5.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 3 銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 3 銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 2 銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 4 銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券 13 銘柄	100.0%	1.2%
ニュージーランドドル	国債証券 3 銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 4 銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 7 銘柄	100.0%	1.2%
中国元	国債証券 50 銘柄	100.0%	11.3%
イスラエルシェケル	国債証券 2 銘柄	100.0%	0.2%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表 (デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2 【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2024年10月31日現在です。

【年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）】

【純資産額計算書】

I 資産総額	3,413,323,100円
II 負債総額	1,044,600円
III 純資産総額（I－II）	3,412,278,500円
IV 発行済口数	2,178,265,264口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.5665円

（参考）

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	63,455,401,811円
II 負債総額	1,372,397,308円
III 純資産総額（I－II）	62,083,004,503円
IV 発行済口数	21,986,338,710口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.8237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	452,793,645,455円
II 負債総額	111,172,854円
III 純資産総額（I－II）	452,682,472,601円
IV 発行済口数	65,052,020,732口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	6.9588円

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	28,182,757,020円
II 負債総額	1,192,256,445円
III 純資産総額（I－II）	26,990,500,575円
IV 発行済口数	9,194,623,212口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.9355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	55,713,154,904円
II 負債総額	196,495,657円
III 純資産総額 (I - II)	55,516,659,247円
IV 発行済口数	42,104,972,640口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.3185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	168,569,163,734円
II 負債総額	349,109,283円
III 純資産総額 (I - II)	168,220,054,451円
IV 発行済口数	55,106,452,878口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	3.0526円

海外債券インデックス (ヘッジあり) マザーファンド

純資産額計算書

I 資産総額	25,371,205,801円
II 負債総額	1,765,448,346円
III 純資産総額 (I - II)	23,605,757,455円
IV 発行済口数	18,084,527,335口
V 1口当たり純資産額 (III/IV)	1.3053円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

① 譲渡制限はありません。

② 受益権の譲渡

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

③ 受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2024年10月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

●過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2024年10月末現在）

・株主総会

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

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

・取締役会

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

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

・監査等委員会

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

(3) 運用の意思決定プロセス（2024年10月末現在）

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

2【事業の内容及び営業の概況】

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2024年10月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	768	305,208
株式投資信託	721	267,206
単位型	266	7,163
追加型	455	260,043
公社債投資信託	47	38,001
単位型	34	999
追加型	13	37,002

3 【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和 38 年大蔵省令第 59 号）並びに同規則第 2 条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成 19 年 8 月 6 日内閣府令第 52 号）に基づいて作成しております。
また、当社の中間財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」並びに同規則第 282 条及び第 306 条に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 65 期事業年度（2023 年 4 月 1 日から 2024 年 3 月 31 日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。
また、金融商品取引法第 193 条の 2 第 1 項の規定に基づき、第 66 期中間会計期間（2024 年 4 月 1 日から 2024 年 9 月 30 日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2024年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 三 上 和 彦
業務執行社員

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

記事項の妥当性を評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

独立監査人の中間監査報告書

2024年12月5日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2024年4月1日から2025年3月31日までの第66期事業年度の中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2024年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

(単位：百万円)

	第 64 期 (2023 年 3 月 31 日)	第 65 期 (2024 年 3 月 31 日)
負債の部		
流動負債		
預り金	433	451
未払金	7,557	9,211
未払収益分配金	7	7
未払償還金	71	71
未払手数料	6,586	8,330
その他未払金	892	803
未払費用	※ 3 4,227	※ 3 4,082
未払法人税等	—	1,644
未払消費税等	—	※ 4 620
賞与引当金	2,563	2,619
役員賞与引当金	218	232
その他	647	683
流動負債合計	15,648	19,547
固定負債		
退職給付引当金	1,424	1,448
賞与引当金	437	565
役員賞与引当金	16	56
繰延税金負債	—	295
その他	181	251
固定負債合計	2,059	2,617
負債合計	17,708	22,165
純資産の部		
株主資本		
資本金	17,363	17,363
資本剰余金		
資本準備金	5,220	5,220
資本剰余金合計	5,220	5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	79,307	82,591
利益剰余金合計	79,307	82,591
自己株式	△2,067	△2,067
株主資本合計	99,823	103,107
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	2,056	4,523
繰延ヘッジ損益	△488	△1,155
評価・換算差額等合計	1,567	3,367
純資産合計	101,391	106,475
負債純資産合計	119,099	128,640

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第 64 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)		第 65 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)
営業収益			
委託者報酬	73,998		75,874
その他営業収益	3,479	※1	3,714
営業収益合計	<u>77,477</u>		<u>79,588</u>
営業費用			
支払手数料	30,699		32,917
広告宣伝費	755		711
公告費	3		3
調査費	17,479		17,736
調査費	1,170		1,266
委託調査費	16,282		16,445
図書費	26		23
委託計算費	581		610
営業雑経費	948		881
通信費	139		135
印刷費	309		308
協会費	56		48
諸会費	16		11
その他	427		375
営業費用計	<u>50,469</u>		<u>52,860</u>
一般管理費			
給料	9,818		10,550
役員報酬	314		459
役員賞与引当金繰入額	234		273
給料・手当	6,544		6,791
賞与	147		277
賞与引当金繰入額	2,577		2,747
交際費	56		71
寄付金	24		22
旅費交通費	205		260
租税公課	433		389
不動産賃借料	938		906
退職給付費用	383		388
退職金	155		36
固定資産減価償却費	183		199
福利費	1,097		1,208
諸経費	4,291		4,661
一般管理費計	<u>17,588</u>		<u>18,694</u>
営業利益	<u>9,420</u>		<u>8,033</u>

(単位：百万円)

	第 64 期		第 65 期	
	(自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)		(自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)	
営業外収益				
受取利息		107		4
受取配当金	※2	9,255	※2	4,946
有価証券評価益		—	※3	1,113
金銭の信託運用益		—		399
時効成立分配金・償還金		1		2
その他		236		50
営業外収益合計		9,601		6,517
営業外費用				
支払利息		407		569
デリバティブ費用		389		3,494
有価証券償還損		6		—
時効成立後支払分配金・償還金		1		1
為替差損		342		165
その他		15		0
営業外費用合計		1,163		4,231
経常利益		17,858		10,319
特別利益				
投資有価証券売却益		427		815
訴訟損失引当金戻入額	※4	4,481		—
特別利益合計		4,909		815
特別損失				
投資有価証券売却損		347		174
固定資産処分損		0		52
損害賠償損失		—		167
特別損失合計		347		394
税引前当期純利益		22,420		10,740
法人税、住民税及び事業税		1,340		2,415
法人税等調整額		3,252		△51
法人税等合計		4,593		2,364
当期純利益		17,826		8,376

(3) 【株主資本等変動計算書】

第64期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

第 65 期（自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日）

（単位：百万円）

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

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

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第 65 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)				
1 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>① 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法</p> <p>② その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 市場価格のない株式等 総平均法による原価法</p> <p>(2) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) デリバティブ 時価法</p>				
2 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016 年 4 月 1 日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table border="0" data-bbox="502 884 1021 952"> <tr> <td>建物</td> <td>3 年～15 年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3 年～20 年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5 年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	3 年～15 年	器具備品	3 年～20 年
建物	3 年～15 年				
器具備品	3 年～20 年				
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>② 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10 年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生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義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。</p> <p>(1) 投資信託委託業務 当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高(以下「AUM」)に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドの AUM に固定料率を乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問業務 当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドの AUM に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドの AUM に投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。</p>				

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

(重要な会計上の見積り)

第 64 期(自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)
該当事項はありません。

第 65 期(自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)
該当事項はありません。

(貸借対照表関係)

第 64 期 (2023 年 3 月 31 日)	第 65 期 (2024 年 3 月 31 日)
※ 1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,437 百万円 器具備品 879 百万円	※ 1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 1,482 百万円 器具備品 920 百万円
※ 2 信託資産 流動資産のその他のうち 2 百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。	※ 2 信託資産 流動資産のその他のうち 2 百万円は、「直販顧客 分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に 信託しております。
※ 3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりで あります。 (流動資産) 未収収益 263 百万円 (流動負債) 未払費用 1,778 百万円	※ 3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりで あります。 (流動資産) 未収収益 248 百万円 (流動負債) 未払費用 1,873 百万円
※ 4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 「未収入金」に含めて表示しております。	※ 4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、 「未払消費税等」として表示しております。
※ 5 保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピ ーティーワイ・リミテッド (旧社名「日興AMエク イティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リ ミテッド」) が発行する買戻し条件付株式の買戻請 求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネ ジメント・リミテッドは最大 448 百万円 (5 百万豪 ドル) を提供する義務を負っています。当社はヤ ラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う 当該資金提供義務を保証しております。	※ 5 保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピ ーティーワイ・リミテッド (旧社名「日興AMエク イティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リ ミテッド」) が発行する買戻し条件付株式の買戻請 求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネ ジメント・リミテッドは最大 493 百万円 (5 百万豪 ドル) を提供する義務を負っています。当社はヤ ラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う 当該資金提供義務を保証しております。

(損益計算書関係)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

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

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第 65 期（自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

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

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

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

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(リース取引関係)

第 64 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)		第 65 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)	
オペレーティング・リース取引 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	899 百万円	1 年内	891 百万円
1 年超	3,425 百万円	1 年超	2,613 百万円
合計	4,324 百万円	合計	3,505 百万円

(金融商品関係)

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

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

② 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

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

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

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

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

資産

有価証券

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

デリバティブ取引

株式関連

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

通貨関連

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位：百万円)

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

3 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

① 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

② 市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

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

③ 流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	—	3,899	—	3,899
有価証券				
その他有価証券				
投資信託	7,785	18,141	—	25,927
資産計	7,785	22,041	—	29,827
デリバティブ取引(*1)				
株式関連 (*2)	△309	—	—	△309
通貨関連 (*3)	—	△367	—	△367
デリバティブ取引計	△309	△367	—	△677

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

(※2) 株式関連のデリバティブ取引の△309百万円は、貸借対照表上流動資産及び流動負債のその他に含まれております。

(※3) 通貨関連のデリバティブ取引の△367百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

資産

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買取請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限が無い場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

有価証券

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

デリバティブ取引

株式関連

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

通貨関連

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

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額
非上場株式	2,540
子会社株式	19,011
関連会社株式	18,635

3 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,198			
未収委託者報酬	21,592			
未収収益	647			
有価証券及び投資有価証券				
投資信託	1	169	2,483	—
合計	53,440	169	2,483	—

(有価証券関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

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

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

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

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

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

第 65 期(自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	19,011
関連会社株式	18,635

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	投資信託	24,313	17,701	6,611
	小計	24,313	17,701	6,611
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	1,613	1,769	△156
	小計	1,613	1,769	△156
合計		25,927	19,471	6,455

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

2 非上場株式等（貸借対照表計上額 2,540 百万円）については、市場価格のない株式等であることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	8,145	1,057	△167
合計	8,145	1,057	△167

4 保有目的を変更した有価証券

注記事項「(損益計算書関係) ※3 有価証券評価益」をご参照ください。

(金銭の信託関係)

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

該当事項はありません。

第 65 期(自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)

運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	当事業年度の損益に含まれた 評価差額
運用目的の金銭の信託	3,899	399

(デリバティブ取引関係)

第64期(2023年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

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

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

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

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第 65 期(2024 年 3 月 31 日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	15,077	—	△ 309	△ 309
合計		15,077	—	△ 309	△ 309

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

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

該当事項はありません。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		6,465	—	△268
	豪ドル		84	—	△2
	香港ドル		542	—	△17
	人民元		2,979	—	△17
	ユーロ		2,172	—	△60
合計			12,243	—	△367

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第 64 期 (自 2022 年 4 月 1 日 至 2023 年 3 月 31 日)		第 65 期 (自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)		関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	
(1) 関連会社に対する投資の金額	5,326	(1) 関連会社に対する投資の金額	5,342
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	16,722	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	17,691
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	2,185	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	2,474

(退職給付関係)

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

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,352
勤務費用	133
利息費用	4
数理計算上の差異の発生額	△16
退職給付の支払額	△107
<u>退職給付債務の期末残高</u>	<u>1,366</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	1,366
未積立退職給付債務	1,366
未認識数理計算上の差異	58
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,424</u>
退職給付引当金	1,424
<u>貸借対照表に計上された負債の額</u>	<u>1,424</u>

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	133
利息費用	4
数理計算上の差異の費用処理額	△1
<u>確定給付制度に係る退職給付費用</u>	<u>136</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 0.6%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、247 百万円でありました。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

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

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,366
勤務費用	134
利息費用	8
数理計算上の差異の発生額	9
退職給付の支払額	△110
退職給付債務の期末残高	1,407

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

退職給付債務	1,407
未積立退職給付債務	1,407
未認識数理計算上の差異	40
貸借対照表に計上された負債の額	1,448
退職給付引当金	1,448
貸借対照表に計上された負債の額	1,448

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	134
利息費用	8
数理計算上の差異の費用処理額	△7
確定給付制度に係る退職給付費用	134

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

割引率 0.7%

3 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、253百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 ス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

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

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

① ストックオプション(新株予約権)の数

	2016年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2016年7月15日	2017年4月27日
権利確定前(株)		
期首	88,000	816,000
付与	0	0
失効	88,000	599,000
権利確定	0	0
権利未確定残	—	217,000
権利確定後(株)		
期首	—	—
権利確定	—	—
権利行使	—	—
失効	—	—
権利未行使残	—	—

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

② 単価情報

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

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

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

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

第 65 期(自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)

1 ストックオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) ストックオプション(新株予約権)の内容

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況

① ストックオプション(新株予約権)の数

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

(注) 株式数に換算して記載しております。

② 単価情報

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

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

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

(税効果会計関係)

第 64 期 (2023 年 3 月 31 日)		第 65 期 (2024 年 3 月 31 日)	
1	繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 of 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 of 主な原因別の内訳 (単位：百万円)
	繰延税金資産		繰延税金資産
	賞与引当金		賞与引当金
	投資有価証券評価損		投資有価証券評価損
	関係会社株式評価損		関係会社株式評価損
	退職給付引当金		退職給付引当金
	固定資産減価償却費		固定資産減価償却費
	繰延ヘッジ損益		繰延ヘッジ損益
	その他		その他
	繰延税金資産小計		繰延税金資産小計
	評価性引当金		評価性引当金
	繰延税金資産合計		繰延税金資産合計
	繰延税金負債		繰延税金負債
	その他有価証券評価差額金		その他有価証券評価差額金
	その他		その他
	繰延税金負債合計		繰延税金負債合計
	繰延税金資産の純額		繰延税金負債の純額
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		その他
	税効果会計適用後の法人税等の負担率		税効果会計適用後の法人税等の負担率

(関連当事者情報)

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

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 融資枠 55 百万シンガポールドル、返済期間 1 年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
- 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あります (決定方針等を 2022 年 8 月 26 日付にて上記 1 に変更してあります)。
- 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(ロンドン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は 2022 年 12 月 31 日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

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

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

第 65 期(自 2023 年 4 月 1 日 至 2024 年 3 月 31 日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

1. 融資枠 55 百万シンガポールドル、返済期間 1 年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しておりました。
2. Nikko Asset Management International Limited が保有する関連会社 AHAM Asset Management Berhad の 20%の株式を、2023 年 4 月 19 日に 13,412 百万円で取得しました。
3. Nikko AM Americas Holding Co., Inc. の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。
4. Nikko AM Global Holdings Limited の行った 1,828,000,000 株の新株発行増資を、1 株につき 1 円で当社が引受けたものであります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は 2023 年 12 月 31 日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	41,322 百万円
負債合計	8,314 百万円
純資産合計	33,008 百万円

営業収益	18,682 百万円
税引前当期純利益	6,005 百万円
当期純利益	4,538 百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

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

関連情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当事項はありません。

(収益認識関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

(1株当たり情報)

項目	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	522円22銭	548円41銭
1株当たり当期純利益金額	91円81銭	43円14銭

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

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益 (百万円)	17,826	8,376
普通株主に帰属しない金額 (百万円)	—	—
普通株式に係る当期純利益 (百万円)	17,826	8,376
普通株式の期中平均株式数 (千株)	194,152	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2016年度ストックオプション(2) 217,000株、2017年度ストックオプション(1) 752,000株	2016年度ストックオプション(2) 121,000株、2017年度ストックオプション(1) 346,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第64期 (2023年3月31日)	第65期 (2024年3月31日)
純資産の部の合計額 (百万円)	101,391	106,475
純資産の部の合計額から控除する金額 (百万円)	—	—
普通株式に係る期末の純資産額 (百万円)	101,391	106,475
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数 (千株)	194,152	194,152

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表等

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第 66 期中間会計期間
(2024 年 9 月 30 日)

資産の部		
流動資産		
現金・預金		21,631
金銭の信託		13,876
有価証券		10
未収委託者報酬		17,767
未収収益		1,082
その他	※ 2	5,804
流動資産合計		60,173
固定資産		
有形固定資産	※ 1	335
無形固定資産		470
投資その他の資産		
投資有価証券		20,253
関係会社株式		44,647
長期差入保証金		244
繰延税金資産		50
投資その他の資産合計		65,195
固定資産合計		66,001
資産合計		126,174

(単位：百万円)

第 66 期中間会計期間
(2024 年 9 月 30 日)

負債の部		
流動負債		
未払金		8,826
未払費用		3,471
未払法人税等		2,272
未払消費税等	※ 3	625
関係会社短期借入金		6,688
賞与引当金		1,764
役員賞与引当金		120
その他		700
流動負債合計		24,470
固定負債		
退職給付引当金		1,489
賞与引当金		358
役員賞与引当金		72
その他		158
固定負債合計		2,079
負債合計		26,549
純資産の部		
株主資本		
資本金		17,363
資本剰余金		
資本準備金		5,220
資本剰余金合計		5,220
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		76,524
利益剰余金合計		76,524
自己株式		△2,067
株主資本合計		97,040
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		3,213
繰延ヘッジ損益		△629
評価・換算差額等合計		2,583
純資産合計		99,624
負債純資産合計		126,174

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

第 66 期中間会計期間
(自 2024 年 4 月 1 日
至 2024 年 9 月 30 日)

営業収益		
委託者報酬		40,928
その他営業収益		2,050
営業収益合計		42,979
営業費用及び一般管理費	※ 1	38,534
営業利益		4,444
営業外収益	※ 2	3,213
営業外費用	※ 3	445
経常利益		7,212
特別利益	※ 4	172
特別損失	※ 5	50
税引前中間純利益		7,333
法人税等	※ 6	2,217
中間純利益		5,116

(3) 中間株主資本等変動計算書

第 66 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)

(単位: 百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	株主資本 合計
		資本 準備金	資本 剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	82,591	82,591	△ 2,067	103,107
当中間期変動額							
剰余金の配当				△ 11,183	△ 11,183		△ 11,183
中間純利益				5,116	5,116		5,116
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)							
当中間期変動額合計	—	—	—	△ 6,066	△ 6,066	—	△ 6,066
当中間期末残高	17,363	5,220	5,220	76,524	76,524	△ 2,067	97,040

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	4,523	△ 1,155	3,367	106,475
当中間期変動額				
剰余金の配当				△ 11,183
中間純利益				5,116
株主資本以外の項目の 当中間期変動額 (純額)	△ 1,310	525	△ 784	△ 784
当中間期変動額合計	△ 1,310	525	△ 784	△ 6,851
当中間期末残高	3,213	△ 629	2,583	99,624

注記事項

(重要な会計方針)

項目	第 66 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)
1 資産の評価基準及び評価方法	<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) 金銭の信託 時価法</p> <p>(3) 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については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法により償却しております。なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>② 数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p>
4 収益の計上基準	<p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行业務の内容及び当該履行业務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。</p> <p>(1) 投資信託委託業務 当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高(以下「AUM」)に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドの AUM に固定料率を乗じて毎日計算さ</p>

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

(中間貸借対照表関係)

第 66 期中間会計期間 (2024 年 9 月 30 日)	
※ 1	有形固定資産の減価償却累計額 2,372 百万円
※ 2	信託資産 流動資産のその他のうち 2 百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託しております。
※ 3	消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。
※ 4	保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド(旧社名「日興 AM エクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」)が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大 493 百万円(5 百万豪ドル)を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。

(中間損益計算書関係)

第 66 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)	
※ 1	減価償却実施額 有形固定資産 46 百万円 無形固定資産 48 百万円
※ 2	営業外収益のうち主要なもの 有価証券評価益 1,788 百万円 受取配当金 1,170 百万円 為替差益 132 百万円 デリバティブ収益 100 百万円 有価証券評価益について、保有している一部の有価証券の区分を、運用方針の変更のためその他有価証券から売買目的有価証券に振り替え、金銭の信託に移管したことに伴い、振替時の評価差額を営業外収益に計上しております。
※ 3	営業外費用のうち主要なもの 支払利息 420 百万円
※ 4	特別利益のうち主要なもの 投資有価証券売却益 172 百万円
※ 5	特別損失のうち主要なもの 投資有価証券売却損 42 百万円
※ 6	中間会計期間における税金費用につきましては、簡便法により計算しているため、法人税等調整額は「法人税等」に含めて表示しております。

(中間株主資本等変動計算書関係)

第 66 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の 目的となる 株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当中間会 計期間末 残高 (百万円)
		当事業 年度期首	当中間 会計期間 増加	当中間 会計期間 減少	当中間 会計期間末	
2016 年度 ストックオプション (2)	普通株式	121,000	—	121,000	—	—
2017 年度 ストックオプション (1)	普通株式	346,000	—	154,000	192,000	—
合計		467,000	—	275,000	192,000	—

(注) 1 当中間会計期間の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

2 2017 年度ストックオプション(1) 192,000 株は、当中間会計期間末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間末後となるもの
該当事項はありません。

(リース取引関係)

第 66 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)	
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	
1 年内	862 百万円
1 年超	2,187 百万円
合計	3,049 百万円

(金融商品関係)

第 66 期中間会計期間(2024 年 9 月 30 日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額			
	レベル 1	レベル 2	レベル 3	合計
金銭の信託	—	13,876	—	13,876
有価証券				
その他有価証券				
投資信託	6,989	10,736	—	17,725
資産計	6,989	24,613	—	31,602
デリバティブ取引(※ 1、2)				
株式関連	△257	—	—	△257
通貨関連	—	845	—	845
デリバティブ取引計	△257	845	—	587

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

(※ 2) 株式関連のデリバティブ取引のうち 257 百万円は、中間貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。また通貨関連のデリバティブ取引のうち 890 百万円は、流動資産のその他に、△45 百万円は流動負債のその他に含まれております。

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注 1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

資 産

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買取請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限が無い場合には基準価額等を時価としており、レベル 2 の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル 2 の時価に分類しております。

有価証券

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

デリバティブ取引

株式関連

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

通貨関連

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

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

(単位：百万円)

区分	中間貸借対照表計上額
非上場株式	2,538
子会社株式	26,011
関連会社株式	18,635

(有価証券関係)

第66期中間会計期間(2024年9月30日)

1 子会社株式及び関連会社株式

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

2 その他有価証券

(単位：百万円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	16,629	11,861	4,767
	小計	16,629	11,861	4,767
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	1,096	1,294	△198
	小計	1,096	1,294	△198
合計		17,725	13,156	4,568

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

2 非上場株式(中間貸借対照表計上額2,538百万円)については、市場価格のない株式等であることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(金銭の信託関係)

第66期中間会計期間(2024年9月30日)

運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	当事業年度の損益に含まれた評価差額
運用目的の金銭の信託	13,876	△22

(デリバティブ取引関係)

第 66 期中間会計期間 (2024 年 9 月 30 日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引	株価指数先物取引 売建	17,372	-	△257	△257
合計		17,372	-	△257	△257

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

(2) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建 シンガポールドル	6,688	-	△45	△45
合計		6,688	-	△45	△45

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

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計 の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		6,664	-	641
	豪ドル		186	-	9
	ユーロ		2,374	-	171
	香港ドル		769	-	61
	人民元		1,456	-	6
合計			11,450	-	890

(持分法損益等)

第 66 期中間会計期間 (自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)	
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等	
(1) 関連会社に対する投資の金額	5,341 百万円
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額	17,354 百万円
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額	1,083 百万円

(収益認識関係)

第 66 期中間会計期間(2024 年 9 月 30 日)

1 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

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

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(ストックオプション等関係)

第 66 期中間会計期間(自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

セグメント情報

第 66 期中間会計期間(自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載していません。

関連情報

第 66 期中間会計期間(自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)

1 製品及びサービスごとの情報

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

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 66 期中間会計期間(自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第 66 期中間会計期間(自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第 66 期中間会計期間(自 2024 年 4 月 1 日 至 2024 年 9 月 30 日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

項目	第66期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
1株当たり純資産額	513円12銭
1株当たり中間純利益金額	26円35銭

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

2 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第66期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
中間純利益(百万円)	5,116
普通株主に帰属しない金額(百万円)	—
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,116
普通株式の期中平均株式数(千株)	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2017年度ストックオプション(1)192,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第66期中間会計期間 (2024年9月30日)
中間貸借対照表の純資産の部の合計額(百万円)	99,624
純資産の部の合計額から控除する金額(百万円)	—
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額(百万円)	99,624
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数(千株)	194,152

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

5 【その他】

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

<約款>

<追加型証券投資信託 年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)>

運用の基本方針

約款第17条の規定に基づき、委託者が別に定める運用の基本方針は次のものとします。

基本方針

この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。

運用方法

(1)投資対象

以下に掲げる各証券投資信託の受益証券を主要投資対象とします。

証券投資信託 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

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

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

証券投資信託 日本債券インデックスマザーファンド

証券投資信託 海外債券インデックス (ヘッジなし) マザーファンド

証券投資信託 海外債券インデックス (ヘッジあり) マザーファンド

(2)投資態度

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

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

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

株式の標準実質組入率 20%

公社債および短期金融資産の標準実質組入率 80%

また、資金動向等によっては組入率を引き下げることもあります。

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

運用制限

(1)株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の総額の30%以下とします。

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

(3)外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。

(4)外国為替の売買の予約取引の指図は、約款第28条の範囲で行ないます。

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

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

①分配対象額の範囲

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

②分配対象額についての分配方針

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

③留保益の運用方針

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

(信託の種類、委託者および受託者)

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

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

(信託の目的、金額および追加信託の限度額)

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

② 委託者は、受託者と合意の上、金1兆円を限度として信託金を追加できるものとし、追加信託を行なったときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 委託者は、受託者と合意の上、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第3条 この信託の期間は、信託契約締結日から第50条、第51条第1項、第52条第1項および第54条第2項の規定による解約の日までとします。

(受益権の取得申込の勧誘の種類)

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

(当初の受益者)

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

(受益権の分割および再分割)

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

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

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

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

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および第25条に規定する借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。））、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則としてわが国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

③ 第28条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

(追加日時の異なる受益権の内容)

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

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

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

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

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

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

（受益権の設定に係る受託者の通知）

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

（受益権の申込単位および価額）

第11条 委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関は、第6条第1項の規定により分割される受益権を、別に定める年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）自動けいぞく投資約款に従って契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結んだ取得申込者に対し、1口の整数倍をもって取得の申込に応ずることができるものとします。

- ② 前項の取得申込者は、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関は、当該取得申込の代金（第3項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。
- ③ 第1項の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、手数料および当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込に係る受益証券の価額は、1口につき1円とします。
- ④ 前項の手料は、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関がそれぞれ独自に定めるものとします。
- ⑤ 第3項の規定にかかわらず、受益者が別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第39条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込の受付を中止することおよび既に受け付けた取得申込の受付を取消することができます。

（受益権の譲渡に係る記載または記録）

第11条の2 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

- ② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ③ 委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合

等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(受益権の譲渡の対抗要件)

第11条の3 受益権の譲渡は、前条の規定による振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

(受益証券の再交付)

第12条 (削 除)

(毀損した場合等の再交付)

第13条 (削 除)

(受益証券の再交付の費用)

第14条 (削 除)

(投資の対象とする資産の種類)

第15条 この信託において投資の対象とする資産の種類（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条各号で定める特定資産の種類をいいます。）は、次に掲げるものとします。

1. 有価証券
2. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、第20条、第21条および第22条に定めるものに限りません。）
3. 金銭債権
4. 約束手形

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

1. 為替手形

(運用の指図範囲および株式への投資制限等)

第16条 委託者は、信託金を、主として日興アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者として締結された次の証券投資信託（その受益権を他の証券投資信託の信託財産に取得させることを目的とした証券投資信託であり、以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 証券投資信託 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド 受益証券
2. 証券投資信託 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド 受益証券
3. 証券投資信託 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド 受益証券
4. 証券投資信託 日本債券インデックスマザーファンド 受益証券
5. 証券投資信託 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド 受益証券
6. 証券投資信託 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド 受益証券
7. 株券または新株引受権証書
8. 国債証券
9. 地方債証券
10. 特別の法律により法人の発行する債券
11. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
12. 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
13. コマーシャル・ペーパー
14. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
15. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第7号から第14号までの証券または証書の性質を有するもの
16. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。）
17. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下次号において同じ。）で次号に定めるもの以外のもの
18. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下本号において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
19. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
20. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをい

い、有価証券に係るものに限りま。

21. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
22. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
23. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りま。）
24. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
25. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

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

- ② 前項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することの指図ができます。
 1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きま。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
- ③ 委託者は、信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしません。
- ④ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- ⑤ 前2項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

（受託者の自己または利害関係人等との取引）

第16条の2 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本条および第29条において同じ。）、第29条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第15条ならびに第16条第1項および第2項に定める資産への投資を行なうことができます。

- ② 前項の取扱いは、第18条から第26条まで、第28条および第34条から第36条までにおける委託者の指図による取引についても同様とします。

（運用の基本方針）

第17条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行ないま。

（投資する株式等の範囲）

第18条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

（信用取引の指図範囲）

第19条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図を

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

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

(先物取引等の運用指図)

- 第20条 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
- ② 委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
 - ③ 委託者は、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

(スワップ取引の運用指図)

- 第21条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。
- ② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第3条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - ③ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算定した価額で評価するものとします。
 - ④ 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図)

- 第22条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ② 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、第3条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - ③ 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
 - ④ 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

- 第23条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- ② 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
 - ③ 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

(公社債の空売りの指図範囲)

- 第24条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公

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

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

（公社債の借入れ）

第25条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認められた時は、担保の提供の指図を行なうものとします。

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

（外貨建資産への投資制限）

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

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

（特別の場合の外貨建有価証券への投資制限）

第27条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

（外国為替予約の指図および範囲）

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

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

（デリバティブ取引等に係る投資制限）

第28条の2 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

（信託業務の委託等）

第29条 受託者は、委託者と協議の上、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みません。）を委託先として選定します。

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

- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限り、）を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。
 1. 信託財産の保存に係る業務
 2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
 3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
 4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

（有価証券の保管）

第30条 （削除）

（混蔵寄託）

第31条 金融機関または金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または金融商品取引業者の名義で混蔵寄託することができるものとします。

（一括登録）

第32条 （削除）

（信託財産の登記等および記載等の留保等）

第33条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

- ② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をすることとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。
- ④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

（一部解約の請求および有価証券の売却等の指図）

第34条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券に係る信託契約の一部解約の請求ならびに信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第35条 委託者は、前条の規定による一部解約の代金および売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金ならびにその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第36条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

- ② 前項の資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
 1. 一部解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、一部解約金の支払資金の手当てのために行なった有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内
 2. 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
 3. 借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- ③ 一部解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託

財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。

- ④ 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。
- ⑤ 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

(損益の帰属)

第37条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。(受託者による資金の立替え)

第38条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は、資金の立替えをすることができます。

- ② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第39条 この信託の計算期間は、毎年10月27日から翌年10月26日までとするを原則とします。ただし、第1計算期間は2001年10月17日から2002年10月26日までとします。

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

(信託財産に関する報告)

第40条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

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

(信託事務等の諸費用)

第41条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託者の立替えた立替金の利息、信託財産の財務諸表の監査に要する費用ならびに当該費用に係る消費税等相当額(以下「諸経費」といいます。)は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の額)

第42条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第39条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の53.5の率を乗じて得た額とします。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。)および毎計算期末、または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。
- ③ 第1項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁の時に信託財産中から支弁します。

(収益分配)

第43条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

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

- ② 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

(収益分配金の再投資等)

第44条 受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌

営業日に、収益分配金が委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関に交付されます。

- ② 委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関は、別に定める契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の取得の申込に応じたものとします。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。
- ③ 第49条第3項により信託の一部解約が行なわれた場合に、当該受益権に帰属する収益分配金があるときは、前項の規定にかかわらず、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から受益者に支払います。
- ④ 収益分配金に係る収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

(記名式受益証券への変更ならびに受益証券の返還請求の取扱い)

第45条 (削除)

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

第46条 受託者は、収益分配金については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金(信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。)については第47条第1項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第47条第2項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

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

(償還金および一部解約金の支払い)

第47条 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権に係る受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として扱います。)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。

- ② 一部解約金は、第49条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として5営業日目から当該受益者に支払います。
- ③ 前2項に規定する償還金および一部解約金の支払いは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関の営業所等において行なうものとします。
- ④ 第44条第3項に規定する信託の一部解約に係る受益権に帰属する収益分配金は、原則として、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託者の指定する日から委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関の営業所等において受益者に支払います。
- ⑤ 償還金および一部解約金に係る収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

(償還金の時効)

第48条 受益者が、信託終了による償還金について第47条第1項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(一部解約)

第49条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

- ② 平成19年1月4日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするときは、委託者の指定する第一種金融商品取引業者または委託者の指定する登録金融機関に対し、振替受益権をもって行なうものとします。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日以前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることと確実な受益証券をもって行なうものとします。
- ③ 委託者は、第1項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、第1項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等

に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

- ④ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額から当該基準価額に0.15%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。
- ⑤ 委託者は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受付を中止することおよび既に受け付けた一部解約の実行の請求の受付を取消することができます。
- ⑥ 前項により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日を一部解約の実行の請求日として、第4項の規定に準じて算定した価額とします。

(質権口記載または記録の受益権の取り扱い)

第49条の2 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受け付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

(信託契約の解約)

第50条 委託者は、信託期間中において、受託者と合意の上、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出るものとします。

- ② 委託者は、前項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合は、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- ④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、第1項の信託契約の解約を行いません。
- ⑤ 委託者は、この信託契約の解約を行わないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- ⑥ 前3項の規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第3項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合は、適用しないものとします。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第51条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第55条の規定に従うものとします。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第52条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第55条第4項に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第53条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

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

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第54条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた

場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第55条の規定に従い新受託者を選任します。

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

(信託約款の変更)

第55条 委託者は、受託者と合意の上、この信託約款を変更することができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出るものとします。

② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更を行いません。

⑤ 委託者は、前項の規定により信託約款の変更を行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、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第56条 第50条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行なう場合において、第50条第3項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

(公告)

第57条 委託者が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

(運用報告書の交付省略)

第57条の2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項で定める運用報告書の交付に代えて、当該運用報告書を次のアドレスに掲載するものとします。

www.nikkoam.com/

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

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第58条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

附 則

- 第1条 この約款において、「年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）自動けいぞく投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と委託者の指定する第一種金融商品取引業者および委託者の指定する登録金融機関が締結する「年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）自動けいぞく投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとします。この場合、「年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）自動けいぞく投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。
- 第2条 第44条第4項および第47条第5項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。
- 第3条 平成18年12月29日現在の信託約款第9条、第10条、第12条から第14条までおよび第45条の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合には、なおその効力を有するものとします。
- 第4条 第22条に規定する「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- ② 第22条に規定する「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。）を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 2001年10月17日

東京都港区赤坂九丁目7番1号
委託者 日興アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区大手町二丁目2番2号
受託者 野村信託銀行株式会社

