

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年3月10日提出
【発行者名】	三井住友トラスト・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 菱田 賀夫
【本店の所在の場所】	東京都港区芝公園一丁目1番1号
【事務連絡者氏名】	投資業務推進部長 民野 誠
【電話番号】	03-6453-3610
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	グローバル・インデックス・バランス・ファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

グローバル・インデックス・バランス・ファンド

ただし、愛称として“投資生活”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の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」又は「委託者」ということがあります。）の依頼により、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又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。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、下記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関及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又は記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載又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、やむを得ない事情等がある場合を除き、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】

10兆円を上限とします。

### （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」とは、ファンド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。基準価額につきましては、販売会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「（８）申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

### （５）【申込手数料】

ありません。

### （６）【申込単位】

販売会社が定める単位とします。詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）で再投資する場合は1口単位です。

### （７）【申込期間】

2021年 3月11日から2021年 9月10日までとします。

継続申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することにより更新されます。

**( 8 ) 【申込取扱場所】**

下記の照会先にお問い合わせください。

( 照会先 )

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ : <https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル : 0120-668001

( 受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。 )

**( 9 ) 【払込期日】**

取得申込者は、販売会社が定める期日までに、お申込みに係る金額を販売会社に支払うものとします。継続申込みに係る発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、委託会社の指定する口座を経由して、三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」又は「受託者」ということがあります。）の指定する当ファンド口座に払い込まれます。

**( 10 ) 【払込取扱場所】**

取得申込みを受け付けた販売会社とします。販売会社の詳細につきましては、上記「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。

**( 11 ) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**( 12 ) 【その他】**

< 振替受益権について >

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。

当ファンドの収益分配金、償還金、一部解約金は、社振法及び上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

< 受益権の取得申込みの方法 >

販売会社所定の方法でお申込みください。

取得申込みの取扱いは、営業日の午後3時までとさせていただきます。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

< 申込みコース >

「分配金受取りコース」（税金を差し引いた後に現金でお受取りになるコース）と「分配金再投資コース」（税金を差し引いた後に自動的に当ファンドの受益権に無手数料で再投資されるコース）の2つの申込方法があります。

販売会社により取扱いコースが異なる場合がありますので、詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

< 受益権の取得申込みの受付の中止等 >

収益分配金の再投資をする場合を除き、金融商品取引所等（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）で、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場で、有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受け付けを中止すること、及びすでに受け付けた取得申込みを取り消すことができます。

## 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】

## &lt;ファンドの目的&gt;

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

## &lt;信託金限度額&gt;

上限 1兆円

ただし、委託会社は受託会社と合意の上、限度額を変更することができます。

## &lt;基本的性格&gt;

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法における、当ファンドの商品分類及び属性区分は下記の通りです。

## 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
追加型	海外	債券	MRF	特殊型
	内外	不動産投信	ETF	
		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。

## 属性区分表

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	対象 インデックス	特殊型

株式	年1回	グローバル	ファミ	あり	日経225	ブル・ベア型
一般		(日本を含む)	リーファ	( )		
大型株	年2回		ンド		TOPIX	条件付運用型
中小型株				なし		
債券	年4回	日本	ファン		その他	ロング・
一般	年6回	北米	ド・オ		( )	ショート型 /
公債	(隔月)	欧州	ブ・ファ			絶対収益追求
社債			ンズ			型
その他債券	年12回					その他
クレジット属性	(毎月)	アジア				( )
( )	日々	オセアニア				
不動産投信	その他	中南米				
その他資産	( )	アフリカ				
(投資信託証券						
(資産複合(株						
式、債券)資産配		中近東				
分固定型))		(中東)				
資産複合		エマージン				
( )		グ				
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。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。属性区分表に記載している「為替ヘッジ」は、対円で為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記商品分類表及び属性区分表に係る用語の定義は下記の通りです。

なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) でもご覧いただけます。

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。

< 商品分類表定義 >

[ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

- (1) 単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
- (2) 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われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

#### [ 投資対象地域による区分 ]

- (1) 国内...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 海外...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及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う。

#### [ 投資対象資産(収益の源泉)による区分 ]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち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う。

#### [ 独立した区分 ]

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) ETF...投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

#### [ 補足分類 ]

- (1) インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

#### < 属性区分表定義 >

#### [ 投資対象資産による属性区分 ]

- (1) 株式  
一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

大型株...目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

中小型株...目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

## (2)債券

一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

公債...目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

社債...目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

その他債券...目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

格付等クレジットによる属性...目論見書又は投資信託約款において、上記 から の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合...以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

資産配分固定型...目論見書又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う。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

資産配分変更型...目論見書又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、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

## [ 決算頻度による属性区分 ]

(1)年1回...目論見書又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う。

(2)年2回...目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。

(3)年4回...目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。

(4)年6回(隔月)...目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。

(5)年12回(毎月)...目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

(6)日々...目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

(7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

(1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

(2)日本...目論見書又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の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

- (5)アジア...目論見書又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除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

#### [ 投資形態による属性区分 ]

- (1)ファミリーファンド...目論見書又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く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2)ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

- (1)為替ヘッジあり...目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
- (2)為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

- (1)日経225
- (2)TOPIX
- (3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

#### [ 特殊型 ]

- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

#### < ファンドの特色 >

## ● 国内外の株式及び外国の公社債に分散投資します。

日本株式マザーファンド、外国株式マザーファンド、外国債券マザーファンド(以下これらを「マザーファンド」といいます。)の各受益証券への投資を通じて、国内外の株式及び外国の公社債に分散投資します。

各マザーファンドは、それぞれの資産の市場全体の動きと連動することを目指すインデックス運用を行います。

実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

### <投資対象とするマザーファンド>

国内株式	日本株式マザーファンド	「TOPIX(東証株価指数、配当込み)」に連動する投資成果を目標とします。
外国株式	外国株式マザーファンド	「MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)」に連動する投資成果を目標とします。
外国債券	外国債券マザーファンド	「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」に連動する投資成果を目標とします。

## ● 3つの資産への均等配分を基本配分比率とします。

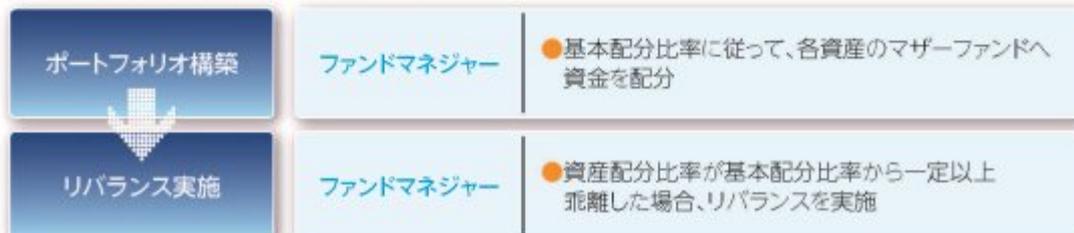
### 基本配分比率



基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設け、一定以上乖離した場合には、リバランスを行います。また、市況動向等の変化に応じて、当該基本配分比率の見直しを行う場合があります。

### ポートフォリオ構築プロセス

ファンドマネジャーは基本配分比率に基づき、各資産のマザーファンドへ資金を配分し、値動き等によって一定以上乖離した場合は、リバランスを行います。



※上記プロセスは、今後変更となる場合があります。

## ● ファンドの仕組み

ファミリーファンド方式で運用します。ファミリーファンド方式とは、投資者の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用はマザーファンドで行う仕組みです。



## ● 主な投資制限

- 株式への投資割合 …………… 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。
- 外貨建資産への投資割合 …… 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

## ● 分配方針

年1回、毎決算時(決算日は6月10日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。)に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。

ただし、分配を行わないことがあります。

分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

※将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

### ◆各マザーファンドが対象とする指数は次のとおりです。

#### 日本株式マザーファンド: [TOPIX(東証株価指数、配当込み)]

[TOPIX(東証株価指数)]とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

#### 外国株式マザーファンド: [MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)]

[MSCIコクサイ・インデックス]とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。

同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

#### 外国債券マザーファンド: [FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)]

[FTSE世界国債インデックス]は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。

FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。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等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

資金動向、市況動向、信託財産の規模等によっては、前記の運用ができない場合があります。

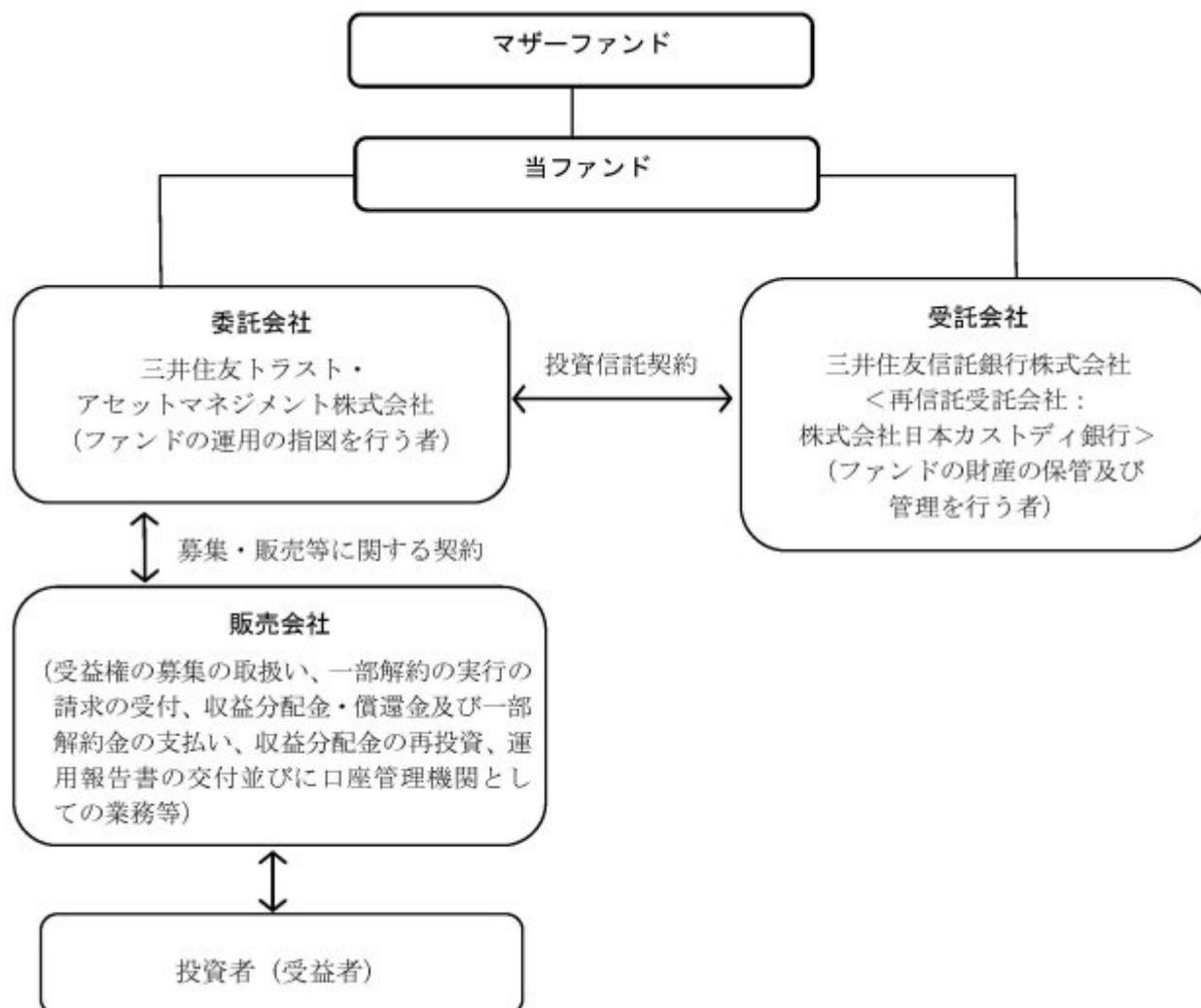
## (2) 【ファンドの沿革】

2008年3月3日	信託契約締結、当ファンドの設定、当ファンドの運用開始
2010年9月11日	ファンドの名称を「ジョインベスト・グローバル・バランス・ファンド」から、「グローバル・インデックス・バランス・ファンド」に変更

2012年4月1日 当ファンドの委託会社としての業務を中央三井アセットマネジメント株式会社から三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に承継  
当ファンドの主要投資対象である中央三井日本株式マザーファンドの名称を日本株式マザーファンド、中央三井外国株式マザーファンドの名称を外国株式マザーファンド、中央三井外国債券マザーファンドの名称を外国債券マザーファンドに変更

### (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組み及び関係法人



委託会社の概況（2020年12月30日現在）

イ．資本金の額：20億円

ロ．委託会社の沿革

1986年11月1日： 住信キャピタルマネジメント株式会社設立  
1987年2月20日： 投資顧問業の登録  
1987年9月9日： 投資一任契約に係る業務の認可  
1990年10月1日： 住信投資顧問株式会社に商号変更  
1999年2月15日： 住信アセットマネジメント株式会社に商号変更  
1999年3月25日： 証券投資信託委託業の認可  
2007年9月30日： 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）

2012年4月1日： 中央三井アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社に商号変更

2018年10月1日： 三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継

#### 八．大株主の状況

株主名	住所	持株数	持株比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	3,000株	100%

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### 運用方針

当ファンドは、日本株式マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンドの各受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指して、ファミリーファンド方式で運用を行います。

従って当ファンドでは、基本的に各マザーファンドを通じて、国内外の株式及び外国の公社債に分散投資することになります。このほか、国内外の株式や外国の公社債等に直接投資することもあります。

#### 投資態度

- A．主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の株式及び外国の公社債に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
- B．各資産への配分は、3つの資産への均等配分を基本とします。
- C．上記の基本配分比率には各資産毎に一定の変動許容幅を設け、一定以上乖離した場合にはリバランスを行います。また、市況動向等の変化に応じて、当該基本配分比率の見直しを行う場合があります。
- D．実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上を図るため、為替予約取引等を活用する場合があります。
- E．運用の効率化を図るため、株価指数先物取引及び債券先物取引等を活用することがあります。このため、株式及び債券の組入総額と株価指数先物取引及び債券先物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。
- F．株式以外の資産への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- G．ただし、資金動向、市況動向に急激な変化が生じたとき及びこれに準ずる事態が生じたとき、あるいは信託財産の規模が上記の運用をするに適さないものとなったときは、上記の運用ができない場合があります。
- H．国内において行われ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。）、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。）、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- I．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、異なった受取金利又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。）を行うことができます。
- J．信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

## （２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンドにおいて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。

A．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）

- 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、後記（５）投資制限＜約款に定める投資制限＞J．、K．及びL．に定めるものに限りません。）
- ３．金銭債権（上記１．、２．及び下記４．に掲げるものに該当するものを除きます。）
- ４．約束手形（上記１．に掲げるものに該当するものを除きます。）

B．次に掲げる特定資産以外の資産

- １．為替手形

運用指図できる投資対象である有価証券

委託会社は、信託金を、主として三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託「日本株式マザーファンド」、  
「外国株式マザーファンド」及び「外国債券マザーファンド」の各受益証券並びに次に掲げる有価証券（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．株券又は新株引受権証券
- 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．資産の流動化に関する法律に定める特定社債券（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．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
- ８．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に定める優先出資証券又は優先出資引受権を表示する証券
- ９．資産の流動化に関する法律に定める優先出資証券又は新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
- １０．コマーシャル・ペーパー
- １１．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。）及び新株予約権証券
- １２．外国又は外国の者の発行する証券又は証書で、上記１．から11．までの証券又は証書の性質を有するもの
- １３．投資信託又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、振替受益権を含みます。）
- １４．投資証券又は外国投資証券（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。）
- １５．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。）
- １６．オプションを表示する証券又は証書（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。）
- １７．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。）
- １８．外国法人が発行する譲渡性預金証券

19. 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。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 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
22. 外国の者に対する権利で上記21.の有価証券の性質を有するもの

なお、上記1.の証券又は証書並びに上記12.及び17.の証券又は証書のうち上記1.の証券又は証書の性質を有するものを以下「株式」といい、上記2.から6.までの証券並びに上記12.及び17.の証券又は証書のうち上記2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、上記13.の証券及び上記14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 運用指図できる金融商品

A. 委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、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を指図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上記5.の権利の性質を有するもの

B. 金融商品による運用の特例

上記 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を上記A. に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

#### (参考)マザーファンドの概要

##### 「日本株式マザーファンド」の概要

#### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

わが国の金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

株式への投資は、原則として東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

運用の効率化を図るため、株価指数先物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並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。

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場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、有価証券オプション取引、わが国の金利に係る先物取引及びわが国の

金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利又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を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。

### 3. 投資制限

株式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、行いません。

新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の新株予約権付社債のうち会社法第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（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号及び第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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。

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及びデリバティブ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10%、合計で20%以内とすることとし、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したがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める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ることとなる投資の指図をしません。

## 「外国株式マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

MSCIコクサイ・インデックスに採用されている国の株式に投資を行い、同インデックス（配当込み、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として高位（90%以上）とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

運用の効率化を図るため、株価指数先物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並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。

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金

利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

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、異なった受取金利又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を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

### 3. 投資制限

外貨建資産への投資には、制限を設けません。

株式への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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。

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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及びデリバティブ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10%、合計で20%以内とすることとし、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したがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める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ることとなる投資の指図をしません。

## 「外国債券マザーファンド」の概要

### 1. 基本方針

この投資信託は、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、エクスポージャーの調整等を目的として為替予約取引等を活用する場合があります。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等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並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。

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引並びに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引及び金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引を行うことができます。

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、異なった受取金利又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を行うことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことができます。

### 3. 投資制限

株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）を行使したものに限ることとし、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、取得時において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。

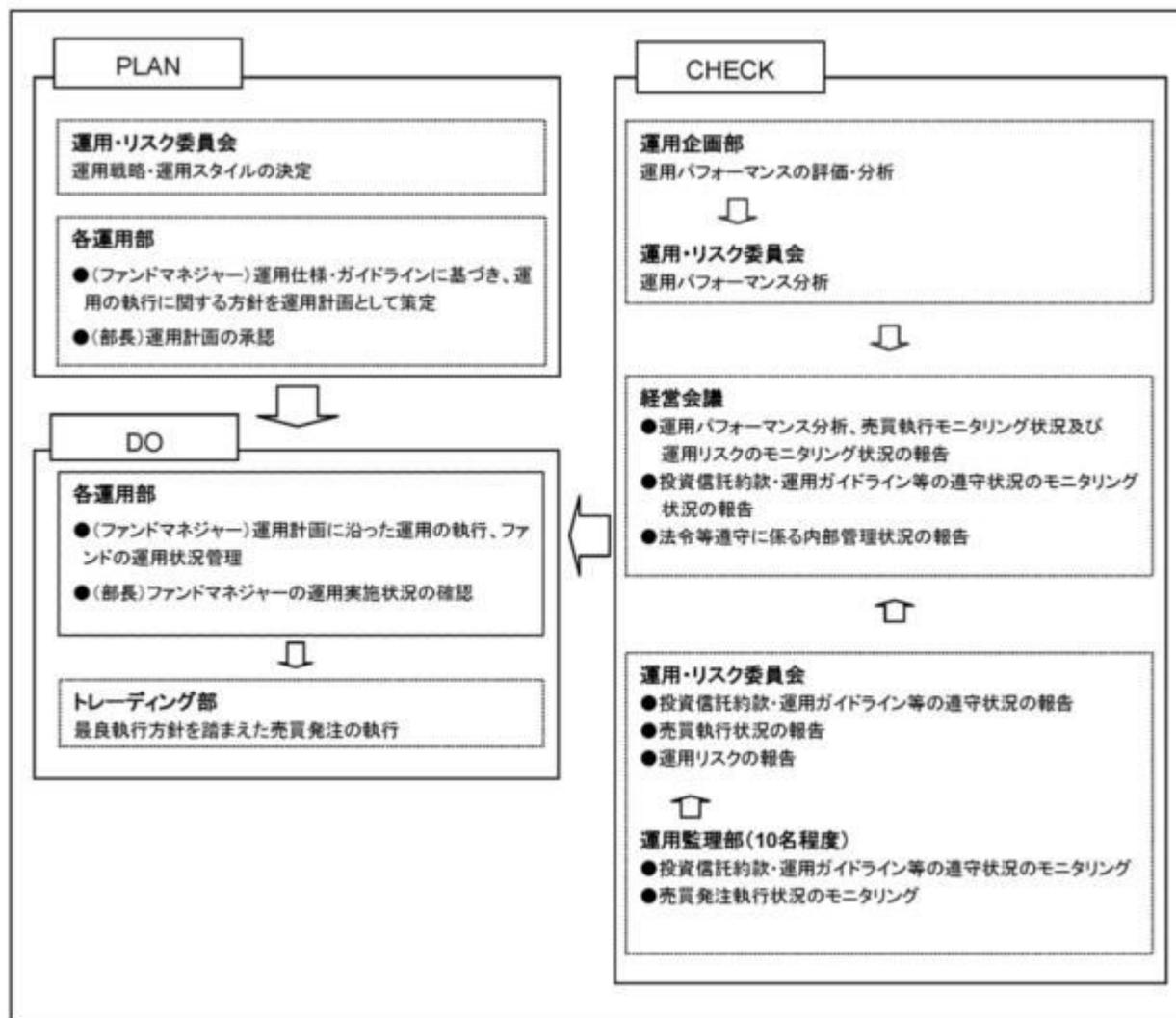
投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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及びデリバティブ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10%、合計で20%以内とすることとし、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したがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、オプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める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ることとなる投資の指図をしません。

#### （3）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、委員会等の名称、人員等は、今後変更されることがあります。



委託会社では社内規定を定めて運用に係る組織及びその権限と責任を明示するとともに、運用を行うに当たって遵守すべき基本的な事項を含め、運用とリスク管理を適正に行うことを目的とした運用等に係る業務規則を定めています。

委託会社は、受託会社又は再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備及び運用状況の報告書を再信託受託会社より受け取っております。

#### (4) 【分配方針】

- ・年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。
- ・分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ・留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

将来の分配金の支払い及びその金額について保証するものではありません。

## （５）【投資制限】

<約款に定める投資制限>

### A．株式への投資割合

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

### B．外貨建資産への投資割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

### C．新株引受権証券等への投資割合

新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

### D．同一銘柄の株式への投資割合

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

### E．同一銘柄の転換社債等への投資割合

同一銘柄の転換社債、並びに同一銘柄の転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

### F．同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合

同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。

### G．投資信託証券への投資割合

投資信託証券（マザーファンドを除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

### H．投資する株式等の範囲

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券は、金融商品取引所等（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所有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第3号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）及び外国金融商品市場（金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場所有価証券の売買又は金融商品取引法第28条第8項第5号の取引を行う市場及び当該市場を開設するものをいいます。）をいいます。以下同じ。）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所等に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当又は社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券及び新株予約権証券については、この限りではありません。

ロ．上記イ．の規定にかかわらず、上場予定又は登録予定の株式、新株引受権証券及び新株予約権証券で目論見書等において上場又は登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

### I．信用取引の指図範囲

イ．委託会社は、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付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

ロ．上記イ．の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けに係る建玉のうち信託財産に属するとみなした額（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売付けに係る建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計額が、信託財産の純資産総額の範囲内とします。

ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売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、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

### J．先物取引等の運用指図

- イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引及び有価証券オプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行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。）。
- ロ．委託会社は、わが国の取引所における通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引並びに外国の取引所における通貨に係る先物取引及びオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利に係る先物取引及びオプション取引並びに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- K．スワップ取引の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図に当たっては、当該取引の契約期限が、原則として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。
- ハ．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出した価額で評価するものとします。
- ニ．委託会社は、スワップ取引を行うに当たり、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うものとします。
- L．金利先渡取引及び為替先渡取引の運用指図
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引及び為替先渡取引の指図に当たっては、当該取引の決済日が、原則として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。
- ハ．金利先渡取引及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。
- ニ．委託会社は、金利先渡取引及び為替先渡取引を行うに当たり、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うものとします。
- M．有価証券の貸付の指図及び範囲
- イ．委託会社は、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及び公社債を次の a．及び b．の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
- a．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を超えないものとします。
- b．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を超えないものとします。
- ロ．信託財産の一部解約等の事由により、上記イ． a．及び b．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、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。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付に当たり、担保の受入れが必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- N．公社債の空売りの指図及び範囲
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない公社債又は下記 O．の規定により借入れた公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売付けた公社債の引渡し又は買戻しにより行うことの指図をすることができますものとしてします。
- ロ．上記イ．の売付けの指図は、当該売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。

- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の売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、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。
- 〇．公社債の借入れの指図及び範囲
- イ．委託会社は、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うに当たり、担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- ロ．上記イ．の借入れの指図は、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。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．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、委託会社は速やかに、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。
- ニ．上記イ．の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。
- Ｐ．特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
- 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。
- Ｑ．外国為替予約取引の指図
- イ．委託会社は、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。
- ロ．上記イ．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（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。）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。
- ハ．信託財産の一部解約等の事由により、上記ロ．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、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。
- Ｒ．一部解約の請求及び有価証券の売却等の指図
- 委託会社は、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及び信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。
- Ｓ．再投資の指図
- 委託会社は、上記Ｒ．の規定による一部解約代金、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、株式の配当金及びその他の収入金を再投資することの指図ができます。
- Ｔ．資金の借入れ
- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用並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、又は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わないものとします。
- ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、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又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、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金、解約代金及び有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

- ハ．収益分配金の再投資に係る借入期間は、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、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 二．借入金の利息は信託財産中から支弁します。
- ウ．受託会社による資金の立替え
- イ．信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行又は株式割当がある場合で、委託会社の申出があるときは、受託会社は資金の立替えをすることができます。
- ロ．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、株式の配当金及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、受託会社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。
- ハ．上記イ．及びロ．の立替金の決済及び利息については、受託会社と委託会社との協議によりそのつど別にこれを定めます。
- ヴ．利害関係人等との取引等
- イ．受託会社は、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並びに関連法令に反しない場合には、委託会社の指図により、信託財産と、受託会社（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託会社が当該第三者の代理人となって行うものを含みます。）及び受託会社の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項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。以下イ．及び下記ロ．において同じ。））、信託業務の委託先及びその利害関係人又は受託会社における他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記イ．からロ．まで及びQ．からT．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことができます。
- ロ．受託会社は、受託会社がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行うことができる取引その他の行為について、受託会社又は受託会社の利害関係人の計算で行うことができるものとします。なお、受託会社の利害関係人が当該利害関係人の計算で行う場合も同様とします。
- ハ．委託会社は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律並びに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託会社、その取締役、執行役及び委託会社の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4に規定する親法人等又は子法人等をいいます。）又は委託会社が運用の指図を行う他の信託財産との間で、前記（2）に掲げる資産への投資等並びに上記イ．からロ．まで及びQ．からT．までに掲げる取引その他これらに類する行為を行うことの指図をすることができます。受託会社は、委託会社の指図により、当該投資等並びに当該取引、当該行為を行うことができます。
- 二．上記イ．からハ．までの場合、委託会社及び受託会社は、受益者に対して信託法第31条第3項及び同法第32条第3項の通知は行いません。
- W．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及びデリバティブ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10%、合計で20%以内とすることとし、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したがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- X．デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券又はオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引及び選択権付債券売買を含みます。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める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ることとなる投資の指図をしません。
- < 関連法令に基づく投資制限 >
- イ．同一の法人の発行する株式への投資制限  
（投資信託及び投資法人に関する法律、同法施行規則）  
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数

に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。従って、投資者の皆様は投資元本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、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益及び損失は、全て投資者の皆様には帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

##### 株価変動リスク

株価は、発行者の業績、経営・財務状況の変化及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。株価が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

##### 為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

##### 金利変動リスク

債券の価格は、一般的に金利低下（上昇）した場合は値上がり（値下がり）します。また、発行者の財務状況の変化等及びそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動します。債券価格が下落した場合は、基準価額の下落要因となります。

##### 信用リスク

有価証券の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利払い、償還金、借入金等をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなった場合、又はそれが予想される場合には、有価証券の価格は下落し、基準価額の下落要因となる可能性があります。

##### 流動性リスク

時価総額が小さい、取引量が少ない等流動性が低い市場、あるいは取引規制等の理由から流動性が低下している市場で有価証券等を売買する場合、市場の実勢と大きく乖離した水準で取引されることがあり、その結果、基準価額の下落要因となる可能性があります。

##### カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化、外国為替規制、資本規制、税制の変更等の事態が生じた場合、又はそれが予想される場合には、方針に沿った運用が困難になり、基準価額の下落要因となる可能性があります。

当ファンドのリスクは、上記に限定されるものではありません。

#### < その他の留意点 >

同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドの資金変動等に伴いマザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

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

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益及び評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落すること

になります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

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

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

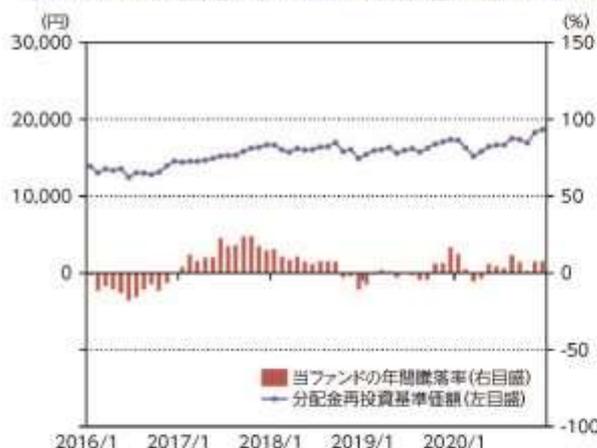
## （２）リスクの管理体制

委託会社におけるリスク管理体制

- ・運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告します。

## 【参考情報】

当ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



\*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、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。

\*当ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

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



\*2016年1月～2020年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンド及び他の代表的な資産クラスについて表示し、当ファンドと他の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。他の代表的な資産クラス全てが当ファンドの投資対象とは限りません。

\*当ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、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について

日本株 TOPIX (東証株価指数, 配当込み)	TOPIX (東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの約定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
先進国株 MSCIコフサイインデックス (配当込み, 円ベース)	MSCIコフサイインデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
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)	MSCI エマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。また「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債とは、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募固定利率国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本, 円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより開発されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推薦、販売あるいは販売促進を行っておりません。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及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等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債 J.P. Morgan カム・アンド・ゴード・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)	本指数は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性、正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なくに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベース指数を使用しております。

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

ありません。

## (2) 【換金（解約）手数料】

## &lt; 解約手数料 &gt;

ありません。

## &lt; 信託財産留保額 &gt;

ご解約時には、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.2%の率を乗じて得た額を信託財産留保額（ ）として当該基準価額から控除します。また、当ファンドが保有するマザーファンドの受益証券の解約に伴う信託財産留保額を、当ファンドが負担します。

「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられます。

## ( 3 ) 【信託報酬等】

## 信託報酬等の額及び支弁の方法

信託報酬の総額は、当ファンドの計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に以下の率を乗じて得た額とします（信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率）。

その配分及び当該信託報酬を対価とする役務の内容は下記の通りです。

支払先		純資産総額		主な役務
		100億円以下の部分	100億円超の部分	
合計		年率0.66% ( 税抜0.6% ) ( )	年率0.55% ( 税抜0.5% )	
内訳 ( 純資産総額に対して )	委託会社	年率0.33% ( 税抜0.3% )	年率0.275% ( 税抜0.25% )	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
	販売会社	年率0.275% ( 税抜0.25% )	年率0.22% ( 税抜0.2% )	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
	受託会社	年率0.055% ( 税抜0.05% )	年率0.055% ( 税抜0.05% )	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

「税抜」における「税」とは、消費税及び地方消費税（以下「消費税等」といいます。）をいいます。

信託報酬は、毎日計上され、ファンドの基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。

信託報酬に係る消費税等相当額を、信託報酬支弁のときに投資信託財産中から支弁します。

## ( 4 ) 【その他の手数料等】

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用及び受託会社の立て替えた立替金の利息（「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、そのつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

借入金の利息は、受益者の負担とし、原則として借入金返済時に投資信託財産中から支弁します。当ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料（ ）、先物取引・オプション取引に要する費用（ ）、組入資産の保管に要する費用（ ）等は、受益者の負担とし、取引のつど投資信託財産中から支弁します（マザーファンドにおいて負担する場合があります。）。

投資信託財産の財務諸表の監査に要する費用（ ）は、受益者の負担とし、日々計上のうえ毎計算期間の最初の6ヶ月終了日及び毎計算期末又は信託終了のときに投資信託財産中から支弁します。これらの手数料等は、運用状況等により変動するなどの理由により、事前に料率、上限額等を示すことができません。

上記における役務提供の内容は以下の通りです。

組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料は、売買仲介人に支払う手数料

先物取引・オプション取引に要する費用は、売買仲介人に支払う手数料

組入資産の保管に要する費用は、保管機関に支払う手数料

財務諸表の監査に要する費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用

上記の費用にはそれぞれ消費税等相当額が含まれます。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、上限額等を事前に示すことができません。

#### （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。

個人の受益者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われます。

なお原則として確定申告不要ですが、確定申告により、申告分離課税又は総合課税（原則として配当控除の適用が可能です。）のいずれかを選択することもできます。

	税 率（内 訳）
2037年12月31日まで	20.315%（所得税15.315%、住民税5%）
2038年1月1日以降	20%（所得税15%、住民税5%）

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

ロ．一部解約金及び償還金に対する課税

一部解約時及び償還時の譲渡益は譲渡所得として課税対象となり、申告分離課税が適用されま  
ず（特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。）。その税率は、上記イ．の表の通りで  
す。

ハ．損益通算について

一部解約時及び償還時の譲渡損益については、確定申告により、特定公社債等の利子所得及び  
譲渡所得等の所得間並びに上場株式等（公募株式投資信託を含みます。）の配当所得（申告分離  
課税を選択したものに限りま  
す。）及び譲渡所得等との損益通算が可能です。

ニ．少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

NISA及びジュニアNISAは、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。ご利用の場  
合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡

所得が一定期間非課税となります。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、以下の税率による源泉徴収が行われます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税額から控除できます。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

	税 率（所得税のみ）
2037年12月31日まで	15.315%
2038年1月1日以降	15%

（2037年12月31日までの間は、復興特別所得税の税率が含まれます。）

#### 個別元本について

- イ．追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料及び当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）に当たります。
- ロ．受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ハ．ただし個別元本は、複数支店で同一ファンドの受益権を取得する場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。
- ニ．受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の「普通分配金と元本払戻金（特別分配金）」についてをご参照ください。）

#### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）について

追加型株式投資信託の収益分配金には、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）」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

- イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を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、
- ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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、2020年12月30日現在のものですので、税法等が改正された場合等には、上記の内容が変更される場合があります。

税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

以下は、2020年12月30日現在の状況について記載してあります。

### 【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

#### （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	3,390,686,103	99.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,625,001	0.37
合計(純資産総額)		3,403,311,104	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、本ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## (2)【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 評価額上位銘柄明細

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額(円)単価	帳簿価額(円)金額	評価額(円)単価	評価額(円)金額	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式マザーファンド	342,999,237	2.9316	1,005,536,564	3.3488	1,148,635,844	33.75
日本	親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	574,087,372	1.7764	1,019,808,808	1.9986	1,147,371,021	33.71
日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	422,966,361	2.5300	1,070,104,894	2.5881	1,094,679,238	32.17

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.63
合計	99.63

(注)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3)【運用実績】

### 【純資産の推移】

	純資産総額(円)		1万口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第4期計算期間末 (2011年 6月10日)	1,894,852,177	1,894,852,177	7,723	7,723

第5期計算期間末	(2012年 6月11日)	1,957,886,772	1,957,886,772	7,323	7,323
第6期計算期間末	(2013年 6月10日)	2,447,708,994	2,452,312,536	10,634	10,654
第7期計算期間末	(2014年 6月10日)	2,498,609,731	2,502,660,953	12,335	12,355
第8期計算期間末	(2015年 6月10日)	3,184,301,741	3,188,483,833	15,228	15,248
第9期計算期間末	(2016年 6月10日)	2,877,411,328	2,877,411,328	13,131	13,131
第10期計算期間末	(2017年 6月12日)	3,275,045,188	3,275,045,188	14,905	14,905
第11期計算期間末	(2018年 6月11日)	3,448,836,583	3,448,836,583	16,204	16,204
第12期計算期間末	(2019年 6月10日)	3,163,412,591	3,163,412,591	15,823	15,823
第13期計算期間末	(2020年 6月10日)	3,240,366,584	3,240,366,584	17,000	17,000
	2019年12月末日	3,361,809,211		17,266	
	2020年 1月末日	3,325,701,279		17,182	
	2月末日	3,125,014,218		16,209	
	3月末日	2,854,199,450		15,113	
	4月末日	2,979,413,727		15,729	
	5月末日	3,110,173,866		16,377	
	6月末日	3,153,293,222		16,570	
	7月末日	3,157,527,876		16,578	
	8月末日	3,293,028,307		17,419	
	9月末日	3,257,123,944		17,276	
	10月末日	3,182,003,726		16,860	
	11月末日	3,353,144,549		18,180	
	12月末日	3,403,311,104		18,577	

## 【分配の推移】

	期 間	1万口当たりの分配金（円）
第4期計算期間	2010年 6月11日～2011年 6月10日	0
第5期計算期間	2011年 6月11日～2012年 6月11日	0
第6期計算期間	2012年 6月12日～2013年 6月10日	20
第7期計算期間	2013年 6月11日～2014年 6月10日	20
第8期計算期間	2014年 6月11日～2015年 6月10日	20
第9期計算期間	2015年 6月11日～2016年 6月10日	0
第10期計算期間	2016年 6月11日～2017年 6月12日	0
第11期計算期間	2017年 6月13日～2018年 6月11日	0
第12期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	0
第13期計算期間	2019年 6月11日～2020年 6月10日	0

## 【収益率の推移】

	期 間	収益率（％）
第4期計算期間	2010年 6月11日～2011年 6月10日	3.4

第5期計算期間	2011年 6月11日～2012年 6月11日	5.2
第6期計算期間	2012年 6月12日～2013年 6月10日	45.5
第7期計算期間	2013年 6月11日～2014年 6月10日	16.2
第8期計算期間	2014年 6月11日～2015年 6月10日	23.6
第9期計算期間	2015年 6月11日～2016年 6月10日	13.8
第10期計算期間	2016年 6月11日～2017年 6月12日	13.5
第11期計算期間	2017年 6月13日～2018年 6月11日	8.7
第12期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	2.4
第13期計算期間	2019年 6月11日～2020年 6月10日	7.4
第14期中間計算期間	2020年 6月11日～2020年12月10日	8.1

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

(注2)小数第2位を四捨五入しております。

#### (4)【設定及び解約の実績】

	期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第4期計算期間	2010年 6月11日～2011年 6月10日	586,983,066	272,034,617	2,453,664,633
第5期計算期間	2011年 6月11日～2012年 6月11日	487,758,083	267,858,897	2,673,563,819
第6期計算期間	2012年 6月12日～2013年 6月10日	407,062,229	778,854,935	2,301,771,113
第7期計算期間	2013年 6月11日～2014年 6月10日	366,034,410	642,194,197	2,025,611,326
第8期計算期間	2014年 6月11日～2015年 6月10日	355,749,941	290,314,770	2,091,046,497
第9期計算期間	2015年 6月11日～2016年 6月10日	331,285,768	230,971,419	2,191,360,846
第10期計算期間	2016年 6月11日～2017年 6月12日	259,687,608	253,825,441	2,197,223,013
第11期計算期間	2017年 6月13日～2018年 6月11日	217,108,019	285,901,685	2,128,429,347
第12期計算期間	2018年 6月12日～2019年 6月10日	164,740,715	293,882,676	1,999,287,386
第13期計算期間	2019年 6月11日～2020年 6月10日	138,119,120	231,301,778	1,906,104,728
第14期中間計算期間	2020年 6月11日～2020年12月10日	58,130,037	119,389,944	1,844,844,821

(注)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

(参考)

日本株式マザーファンド

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	270,631,456,610	99.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,742,343,327	1.00
合計(純資産総額)		273,373,799,937	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	2,508,255,000	0.92

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、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。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 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	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,207,700	7,733.12	9,339,298,456	7,957.00	9,609,668,900	3.52
日本	株式	ソニー	電気機器	678,100	7,880.50	5,343,769,216	10,285.00	6,974,258,500	2.55
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	842,800	4,871.08	4,105,353,767	8,058.00	6,791,282,400	2.48
日本	株式	キーエンス	電気機器	98,100	39,714.87	3,896,028,784	58,000.00	5,689,800,000	2.08
日本	株式	任天堂	その他製品	66,400	43,228.57	2,870,377,312	65,830.00	4,371,112,000	1.60
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,419,900	2,811.78	3,992,456,310	2,645.50	3,756,345,450	1.37
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	900,600	4,337.71	3,906,548,092	3,755.00	3,381,753,000	1.24
日本	株式	日本電産	電気機器	260,500	7,803.25	2,032,748,282	12,980.00	3,381,290,000	1.24
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,302,900	570.11	4,163,497,592	456.10	3,330,852,690	1.22
日本	株式	第一三共	医薬品	929,200	2,493.84	2,317,284,796	3,535.00	3,284,722,000	1.20
日本	株式	信越化学工業	化学	182,000	12,674.66	2,306,789,100	18,040.00	3,283,280,000	1.20
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	741,000	4,277.89	3,169,921,920	4,321.00	3,201,861,000	1.17
日本	株式	ダイキン工業	機械	137,900	16,234.94	2,238,799,438	22,920.00	3,160,668,000	1.16
日本	株式	HOYA	精密機器	214,700	10,985.28	2,358,541,052	14,270.00	3,063,769,000	1.12
日本	株式	村田製作所	電気機器	318,000	6,671.98	2,121,690,608	9,320.00	2,963,760,000	1.08
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	68,700	24,994.11	1,717,095,953	38,400.00	2,638,080,000	0.97
日本	株式	ファナック	電気機器	101,800	20,426.73	2,079,441,980	25,360.00	2,581,648,000	0.94
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	852,200	2,993.86	2,551,373,060	2,877.50	2,452,205,500	0.90
日本	株式	KDDI	情報・通信業	774,400	3,258.04	2,523,026,586	3,066.00	2,374,310,400	0.87
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	738,300	3,878.09	2,863,196,817	3,188.00	2,353,700,400	0.86
日本	株式	エムスリー	サービス業	228,100	3,327.51	759,005,874	9,743.00	2,222,378,300	0.81
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	745,700	2,570.02	1,916,470,165	2,964.00	2,210,254,800	0.81

日本	株式	S M C	機械	34,000	52,463.66	1,783,764,560	62,950.00	2,140,300,000	0.78
日本	株式	日立製作所	電気機器	520,100	4,442.74	2,310,673,260	4,065.00	2,114,206,500	0.77
日本	株式	花王	化学	259,200	9,095.28	2,357,498,054	7,970.00	2,065,824,000	0.76
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	377,500	6,020.58	2,272,771,112	5,308.00	2,003,770,000	0.73
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,450,700	1,632.03	2,367,595,960	1,307.50	1,896,790,250	0.69
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	110,000	15,297.24	1,682,697,308	17,040.00	1,874,400,000	0.69
日本	株式	中外製薬	医薬品	338,600	3,597.34	1,218,062,350	5,503.00	1,863,315,800	0.68
日本	株式	三菱商事	卸売業	699,000	2,856.97	1,997,027,134	2,541.00	1,776,159,000	0.65

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.14
		建設業	2.33
		食料品	3.49
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.22
		化学	7.50
		医薬品	5.87
		石油・石炭製品	0.36
		ゴム製品	0.50
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.61
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.60
		機械	5.71
		電気機器	17.14
		輸送用機器	7.32
		精密機器	2.77
		その他製品	2.75
		電気・ガス業	1.28
		陸運業	3.46
		海運業	0.19
空運業	0.38		
倉庫・運輸関連業	0.17		
情報・通信業	9.07		
卸売業	4.52		
小売業	4.75		

	銀行業	4.40
	証券、商品先物取引業	0.76
	保険業	1.89
	その他金融業	1.10
	不動産業	1.92
	サービス業	5.73
	小計	99.00
合計		99.00

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

#### 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	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	139円		2,467,727,250	2,508,255,000	0.92

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、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。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### 外国株式マザーファンド

#### 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	172,973,707,667	65.50
	イギリス	11,811,816,033	4.47
	スイス	9,037,389,980	3.42
	フランス	8,926,629,291	3.38
	カナダ	8,912,966,671	3.37
	ドイツ	8,090,042,875	3.06
	オーストラリア	5,408,111,287	2.05
	オランダ	4,726,571,740	1.79
	アイルランド	4,675,368,459	1.77
	スウェーデン	2,764,547,371	1.05
	デンマーク	2,217,397,225	0.84

	スペイン	2,129,397,372	0.81
	香港	2,014,374,021	0.76
	イタリア	1,610,239,119	0.61
	フィンランド	1,071,546,735	0.41
	バミューダ	816,382,849	0.31
	ベルギー	779,731,400	0.30
	ジャージー	779,222,878	0.30
	シンガポール	764,048,826	0.29
	ノルウェー	512,046,095	0.19
	イスラエル	510,174,156	0.19
	ケイマン	453,430,035	0.17
	ニュージーランド	344,134,850	0.13
	ルクセンブルク	216,464,140	0.08
	キュラソー	167,998,054	0.06
	オーストリア	145,219,759	0.05
	ポルトガル	142,451,944	0.05
	リベリア	70,793,462	0.03
	パナマ	59,327,198	0.02
	マン島	53,939,830	0.02
	パプアニューギニア	31,359,733	0.01
	小計	252,216,831,055	95.50
投資信託受益証券	オーストラリア	121,994,094	0.05
	香港	38,290,470	0.01
	小計	160,284,564	0.06
投資証券	アメリカ	4,484,372,425	1.70
	オーストラリア	394,325,742	0.15
	フランス	155,711,431	0.06
	イギリス	147,956,455	0.06
	シンガポール	138,160,017	0.05
	香港	103,075,483	0.04
	カナダ	32,949,862	0.01
	小計	5,456,551,415	2.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,263,047,250	2.37
合計(純資産総額)		264,096,714,284	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	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	4,485,362,422	1.70
	買建	カナダ	351,911,187	0.13
	買建	ドイツ	942,584,199	0.36
	買建	イギリス	311,854,528	0.12
	買建	オーストラリア	196,193,340	0.07

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、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。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		1,065,034,623	0.40

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の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によって評価しております。発表されていない場合は、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 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	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	902,693	8,665.02	7,821,852,899	13,959.04	12,600,732,208	4.77
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	379,423	19,130.94	7,258,718,648	23,199.52	8,802,433,374	3.33
アメリカ	株式	AMAZON.COM	小売	22,465	223,510.32	5,021,159,339	343,827.00	7,724,073,555	2.92

アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・ 娯楽	126,767	22,293.89	2,826,130,821	28,646.73	3,631,460,022	1.38
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・ 娯楽	15,842	152,500.00	2,415,905,080	181,928.16	2,882,105,911	1.09
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・ 娯楽	15,828	152,766.00	2,417,980,248	182,027.52	2,881,131,587	1.09
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自 動車部品	39,287	17,857.88	701,582,924	68,929.96	2,708,051,535	1.03
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	138,683	15,708.19	2,178,459,608	15,953.49	2,212,477,854	0.84
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	160,495	13,773.77	2,210,622,821	12,938.53	2,076,570,175	0.79
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェ ア・サービ ス	88,768	20,891.47	1,854,494,453	22,187.29	1,969,521,803	0.75
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・ パーソナル 用品	131,069	13,142.42	1,722,565,157	14,326.46	1,877,756,096	0.71
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲 料・タバコ	151,653	12,700.23	1,926,028,207	12,253.88	1,858,339,180	0.70
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サー ビス	50,030	30,272.71	1,514,543,932	35,950.72	1,798,614,772	0.68
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	73,789	23,163.30	1,709,196,744	23,760.49	1,753,263,166	0.66
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO	メディア・ 娯楽	95,064	14,440.31	1,372,754,580	18,350.54	1,744,476,685	0.66
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半 導体製造装 置	32,480	29,422.97	955,658,390	53,585.05	1,740,442,586	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェ ア・サービ ス	47,011	33,843.46	1,591,015,133	35,879.30	1,686,722,242	0.64
アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	56,680	24,836.89	1,407,755,208	27,550.66	1,561,571,692	0.59
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェ ア・サービ ス	58,661	13,114.48	769,308,805	23,911.60	1,402,678,661	0.53
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	36,956	39,190.18	1,448,312,643	35,959.19	1,328,907,918	0.50
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信 サービス	217,854	6,124.09	1,334,158,592	6,086.83	1,326,041,352	0.50
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェ ア・サービ ス	25,211	39,049.51	984,477,322	51,968.38	1,310,174,954	0.50
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・ 娯楽	239,820	4,566.41	1,095,118,844	5,335.42	1,279,541,623	0.48
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・ 娯楽	23,179	39,475.93	915,012,697	54,945.04	1,273,571,198	0.48
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	409,836	3,465.17	1,420,155,510	3,106.03	1,272,964,960	0.48
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲 料・タバコ	214,473	5,938.82	1,273,718,686	5,602.45	1,201,575,331	0.45
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半 導体製造装 置	223,528	6,749.23	1,508,643,001	5,111.86	1,142,644,960	0.43
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	116,807	10,682.90	1,247,838,493	9,662.53	1,128,651,375	0.43
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半 導体製造装 置	22,393	35,836.71	802,491,570	50,310.28	1,126,598,212	0.43

アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	132,932	8,796.46	1,169,331,685	8,426.96	1,120,213,976	0.42
------	----	------------	------------------------	---------	----------	---------------	----------	---------------	------

(注1)国ノ地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	2.84
		素材	4.35
		資本財	6.28
		商業・専門サービス	1.16
		運輸	1.97
		自動車・自動車部品	1.94
		耐久消費財・アパレル	1.95
		消費者サービス	1.57
		メディア・娯楽	6.81
		小売	5.95
		食品・生活必需品小売り	1.40
		食品・飲料・タバコ	4.11
		家庭用品・パーソナル用品	1.96
		ヘルスケア機器・サービス	5.15
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.58
		銀行	5.43
		各種金融	4.23
		保険	3.07
		不動産	0.48
		ソフトウェア・サービス	11.89
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.20		
電気通信サービス	1.83		
公益事業	3.20		
半導体・半導体製造装置	4.17		
		小計	95.50
投資信託受益証券			0.06
投資証券			2.07
合計			97.63

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券または当該業種の時価の比率です。

#### 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	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (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	S&P 500 EMIN	買建	233	アメリカドル	42,589,596	4,408,023,185	43,336,835	4,485,362,422	1.70
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	21	カナダドル	4,362,802.5	352,645,325	4,353,720	351,911,187	0.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	SWISS MKT IX	買建	22	スイスフラン	2,261,974	264,990,254	2,325,180	272,394,837	0.10
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO STOXX	買建	148	ユーロ	5,172,526	656,652,176	5,279,160	670,189,362	0.25
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTU	買建	15	オーストラリアドル	2,471,580	194,859,367	2,488,500	196,193,340	0.07
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	34	イギリスポンド	2,206,172.5	308,467,039	2,230,400	311,854,528	0.12

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、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。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	7,755,050.00	805,702,657	802,347,473	0.30
	ユーロ	買建	1,280,000.00	161,751,280	162,520,000	0.06
	イギリスポンド	買建	716,500.00	99,120,190	100,167,150	0.04

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の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によって評価しております。発表されていない場合は、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 外国債券マザーファンド

## 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	61,082,782,546	42.13
	フランス	15,284,492,013	10.54
	イタリア	13,689,073,178	9.44
	ドイツ	11,177,706,826	7.71
	イギリス	9,606,496,088	6.63
	スペイン	8,715,933,065	6.01

	オーストラリア	3,922,985,108	2.71
	ベルギー	3,646,966,459	2.52
	オランダ	2,831,867,174	1.95
	カナダ	2,813,725,448	1.94
	オーストリア	2,189,108,181	1.51
	アイルランド	1,227,991,135	0.85
	メキシコ	1,221,387,618	0.84
	フィンランド	918,348,518	0.63
	ポーランド	896,781,742	0.62
	デンマーク	744,060,471	0.51
	マレーシア	705,475,118	0.49
	イスラエル	635,227,837	0.44
	シンガポール	628,806,781	0.43
	スウェーデン	480,918,908	0.33
	ノルウェー	314,888,343	0.22
	小計	142,735,022,557	98.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,256,904,918	1.56
合計(純資産総額)		144,991,927,475	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
債券先物取引	買建	アメリカ	575,441,412	0.40
	買建	ドイツ	799,129,938	0.55

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、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。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

資産の種類	買建 / 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		1,171,191,500	0.81

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の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によって評価しております。発表されていない場合は、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

#### 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	帳簿価額(円) 単価	帳簿価額(円) 金額	評価額(円) 単価	評価額(円) 金額	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 0.625% 08/15/30	9,130,000	10,159.96	927,605,048	10,072.65	919,633,163	0.625	2030/8/15	0.63
アメリカ	国債証券	T 1.5% 09/30/24	8,000,000	10,366.17	829,293,750	10,837.58	867,006,567	1.500	2024/9/30	0.60
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/25	7,250,000	10,685.16	774,674,251	11,169.91	809,818,769	2.125	2025/5/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 0.625% 05/15/30	7,400,000	10,312.58	763,131,454	10,101.76	747,530,371	0.625	2030/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/15/24	6,700,000	10,761.97	721,052,562	11,156.57	747,490,343	2.375	2024/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 0.25% 09/30/25	7,000,000	10,300.97	721,068,463	10,302.69	721,188,810	0.250	2025/9/30	0.50
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/23	6,500,000	10,523.84	684,050,101	10,760.76	699,449,766	2.000	2023/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 2% 02/15/25	6,050,000	10,612.38	642,049,512	11,082.18	670,471,990	2.000	2025/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.875% 11/30/23	6,000,000	11,181.26	670,875,609	11,168.29	670,097,813	2.875	2023/11/30	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.625% 12/15/21	6,320,000	10,662.77	673,887,507	10,600.05	669,923,644	2.625	2021/12/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 3% 08/15/48	4,910,000	12,308.22	604,333,602	13,552.03	665,404,734	3.000	2048/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.625% 02/15/29	5,390,000	11,216.00	604,542,613	11,867.73	639,670,674	2.625	2029/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 1.625% 02/15/26	5,750,000	10,407.00	598,402,835	11,002.13	632,622,522	1.625	2026/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/25	5,500,000	10,769.17	592,304,625	11,298.48	621,416,428	2.250	2025/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.625% 04/30/23	5,800,000	10,411.85	603,887,728	10,706.99	621,005,661	1.625	2023/4/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 0.5% 06/30/27	6,000,000	10,373.87	622,432,771	10,298.65	617,919,256	0.500	2027/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/22	5,800,000	10,654.70	617,972,832	10,583.27	613,830,197	1.500	2022/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.25% 11/15/27	5,260,000	10,852.94	570,864,923	11,483.64	604,039,907	2.250	2027/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 2.25% 08/15/49	5,110,000	11,451.46	585,169,614	11,786.87	602,309,115	2.250	2049/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	T 3% 02/15/48	4,400,000	12,278.49	540,253,830	13,524.53	595,079,719	3.000	2048/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 1.625% 05/15/26	5,400,000	10,403.77	561,803,658	11,014.66	594,791,859	1.625	2026/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	T 2% 11/30/22	5,500,000	10,509.69	578,033,351	10,722.15	589,718,539	2.000	2022/11/30	0.41
アメリカ	国債証券	T 2.875% 05/15/49	4,400,000	12,069.07	531,039,094	13,298.94	585,153,424	2.875	2049/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.5% 02/15/46	4,750,000	11,128.32	528,595,200	12,310.03	584,726,484	2.500	2046/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 1.5% 08/15/26	5,300,000	10,316.88	546,794,640	10,952.80	580,498,753	1.500	2026/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.875% 07/31/25	5,000,000	11,646.44	582,322,050	11,551.57	577,578,516	2.875	2025/7/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.75% 08/31/25	5,000,000	11,602.03	580,101,975	11,507.09	575,354,885	2.750	2025/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	T 2.125% 05/15/22	5,400,000	10,724.77	579,137,769	10,635.63	574,324,332	2.125	2022/5/15	0.40
フランス	国債証券	FRTR 4.5% 04/25/41	2,340,000	23,233.30	543,659,338	24,067.05	563,169,065	4.500	2041/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	T 2.25% 01/31/24	5,090,000	10,668.78	543,040,902	11,013.85	560,605,245	2.250	2024/1/31	0.39

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.44
合計	98.44

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

## 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	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価金額 (現地通貨)	帳簿価額 (円)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
債券先 物取引	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 5YR NOTE	買建	17	アメリカ ドル	2,141,805.45	221,676,864	2,143,460.98	221,848,211	0.15
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US 10YR NOTE	買建	11	アメリカ ドル	1,517,905.84	157,103,254	1,517,140.68	157,024,060	0.11
	アメリカ	シカゴ商品 取引所	US LONG BOND	買建	11	アメリカ ドル	1,913,687.05	198,066,610	1,899,218.75	196,569,141	0.14
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-SCHATZ	買建	8	ユーロ	898,741.8	114,095,271	898,240	114,031,568	0.08
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BOBL FU	買建	11	ユーロ	1,487,643.1	188,856,292	1,487,200	188,800,040	0.13
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	EURO-BUND	買建	22	ユーロ	3,904,576.2	495,685,949	3,909,400	496,298,330	0.34

(注1)評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段また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、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。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	アメリカドル	買建	4,770,000.00	494,728,396	493,504,200	0.34
	カナダドル	買建	950,000.00	77,274,247	76,769,500	0.05
	ユーロ	買建	3,940,000.00	498,488,764	500,261,800	0.35
	イギリスポンド	買建	720,000.00	99,892,529	100,656,000	0.07

(注1)評価にあたっては、計算日または計算日に知りうる直近の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によって評価しております。発表されていない場合は、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

(注2)投資比率とは、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

## 参考情報

交付目論見書に記載するファンドの運用実績

## 運用実績

当初設定日：2008年3月3日  
作成基準日：2020年12月30日

## 基準価額・純資産の推移



基準価額	18,577円
純資産総額	34.03億円

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	分配金
2016年6月	0円
2017年6月	0円
2018年6月	0円
2019年6月	0円
2020年6月	0円
設定来 分配金合計額	60円

※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

※基準価額(分配金再投資)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

※上記グラフは作成基準日以前の直近10年間を表示しております。

## 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位組入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
外国株式 マザーファンド	33.8%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー/ハードウェア機器	-	-	1.6%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	1.1%
		AMAZON.COM	アメリカ	株式	小売	-	-	1.0%
		FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	メディア・娯楽	-	-	0.5%
日本株式 マザーファンド	33.7%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.2%
		ソニー	日本	株式	電気機器	-	-	0.9%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	-	-	0.8%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	-	-	0.7%
外国債券 マザーファンド	32.2%	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	国債	-	0.625%	2030/08/15	0.2%
		T 1.5% 09/30/24	アメリカ	国債	-	1,500%	2024/09/30	0.2%
		T 2.125% 05/15/25	アメリカ	国債	-	2,125%	2025/05/15	0.2%
		T 2.375% 08/15/24	アメリカ	国債	-	2,375%	2024/08/15	0.2%

※投資比率及び実質投資比率は純資産総額に対する比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※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。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

最新の運用の内容等は、表紙に記載されている委託会社のホームページでご確認いただけます。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

#### < 申込手続 >

受益権取得申込者は、販売会社との間で、受益権の取引に関する契約を締結していただきます。

#### < 申込コース >

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」（ ）の2つの申込方法があります。ただし、販売会社により取扱いコースが異なる場合があります。

「分配金再投資コース」での受益権の取得申込者は、販売会社との間で、分配金再投資に関する契約を締結していただきます。

#### < 申込みの受付 >

お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、当該時間を過ぎてのお申込みは翌営業日の取扱いとさせていただきます。

#### < 申込単位 >

販売会社が定める単位とします（「分配金再投資コース」を選択された受益権の収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 申込価額 >

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

（注）分配金再投資に関す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申込価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

#### < 申込手数料 >

ありません。

#### < 申込代金の支払い >

販売会社が定める期日までにお支払いください。

#### < 受付不可日 >

ありません。

#### < 申込受付の中止等 >

収益分配金を再投資する場合を除き、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、委託会社は受益権の取得申込みの受け付けを中止すること、及びすでに受付けた取得申込みを取り消すことができます。

#### < その他 >

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時に又はあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行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又は記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載又は記録を行うことができます。委託会社は、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又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うものとします。振替機関等は、委託会社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又は記録を行います。受託会社は、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います。

### < 問い合わせ先 >

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

## 2【換金（解約）手続等】

### < 一部解約手続 >

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

### < 一部解約の受付 >

一部解約の実行の請求の受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、お申込みの受付に係る販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日の受付とします。なお、当該時間を過ぎての受付は翌営業日の取扱いとさせていただきます。

### < 一部解約単位 >

1口以上1口単位とします。

### < 解約価額 >

一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から、当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た解約時における信託財産留保額を控除した価額（以下「解約価額」といいます。）とします。解約価額は委託会社の営業日において日々算出されます。日々の解約価額は、販売会社へお問い合わせください。また、解約価額は原則として、委託会社ホームページ（<https://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

### < 一部解約代金の支払い >

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営業日目から販売会社において当該受益者に支払われます。

### < 受付不可日 >

ありません。

### < 一部解約受付の中止等 >

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。

一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当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に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして上記<解約価額>の規定に準じて計算された価額とします。

#### <一部解約の制限>

当ファンドの規模及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、大口の一部解約には受付時間及び金額の制限を行う場合があります。詳細につきましては、販売会社までお問い合わせください。

#### <その他>

一部解約の実行の請求を行う受益者は、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投資信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、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又は記録が行われます。

#### <問い合わせ先>

上記手続きの詳細につきましては、販売会社にお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記の照会先までお問い合わせください。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

### 3【資産管理等の概要】

#### （1）【資産の評価】

##### <基準価額の算出方法>

基準価額とは、投資信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券及び借入公社債を除きます。）を法令及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投資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。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

##### <基準価額の算出頻度>

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。

##### <主要な投資対象資産の評価方法>

親投資信託受益証券（日本株式マザーファンド、外国株式マザーファンド及び外国債券マザーファンド）の評価方法

計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式、国内上場投信の評価方法

原則として計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。

外国上場株式、外国上場投資信託受益証券、外国上場投資証券（上場には店頭登録を含みません。）の評価方法

原則として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（店頭登録銘柄は海外店頭市場の最終相場又は最終買気配相場）で評価します。

公社債等の評価方法

計算日（ ）における次のa. からc. までに掲げるいずれかの価額で評価します。

a. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）

b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除きます。）

c. 価格情報会社の提供する価額

外国の公社債については、計算日に知りうる直近の日とします。

外貨建資産等の円換算

外貨建資産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電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は、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って計算します。

#### < 基準価額の照会方法 >

基準価額は、販売会社又は委託会社へお問い合わせください。販売会社の詳細につきましては、下記に記載の照会先までお問い合わせください。また、基準価額は原則として、委託会社ホームページ（<https://www.smtam.jp/>）でご覧いただけます。

（照会先）

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

ホームページ：<https://www.smtam.jp/>

フリーダイヤル：0120-668001

（受付時間は営業日の午前9時から午後5時までとします。）

#### （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。（2008年 3月 3日設定）

ただし、下記「(5)その他 <投資信託契約の終了（償還）と手続き>」の事項に該当する場合は、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

#### （4）【計算期間】

当ファンドの計算期間は、毎年6月11日から翌年6月10日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は2008年3月3日から2008年6月10日までとします。なお、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、信託期間の終了日とします。

#### （5）【その他】

<投資信託契約の終了（償還）と手続き>

(1)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託契約に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託契約を解約し信託を終了（繰上償還）させることができます。

- ・受益権の口数が10億口を下回るようになった場合
- ・投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合
- ・やむを得ない事情が発生した場合

委託会社は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき又は業務を廃止したときは、原則として、ファンドを繰上償還させます。

委託会社は、上記の場合においてファンドを繰上償還させる場合は、あらかじめ、その旨を監督官庁に届け出ます。

## (2)投資信託契約の終了（ファンドの繰上償還）に係る書面決議の手続き

委託会社は上記（1）によりファンドの繰上償還を行おうとする場合、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの繰上償還について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びにファンドの繰上償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

上記 から までの規定は、委託会社がファンドの繰上償還について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託契約に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、投資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、上記 から までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

## <投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き>

### (1)投資信託約款の変更等

委託会社は、以下の場合には法令及び投資信託約款に定める手続きに従い、受託会社と合意のうえ、この投資信託約款を変更すること又は受託会社を同一とする他のファンドとの併合を行うことができます。

- ・受益者の利益のため必要と認めるとき
- ・やむを得ない事情が発生したとき

委託会社は、投資信託約款の変更又はファンドの併合を行う場合は、あらかじめ、その旨及びその内容を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて、投資信託約款を変更しようとするときは、本手続きに従います。

### (2)重大な投資信託約款の変更等に係る書面決議の手続き

委託会社はファンドの約款変更のうち重大な内容の変更（以下「重大な約款変更」といいます。）又はファンドの併合について、以下の手続きで行います。

委託会社は、ファンドの重大な約款変更又はファンドの併合（併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日並びに重大な約款変更又はファンドの併合の内容及びその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この投資信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

受益者（委託会社及びこの信託の投資信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使

しないときは、当該受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

上記の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

書面決議の効力は、このファンドの全ての受益者に対してその効力を生じます。

上記からまでの規定は、委託会社が重大な約款変更又はファンドの併合について提案をした場合において、当該提案につき、この投資信託約款に係る全ての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合に係る他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### < 受託会社の辞任及び解任に伴う取扱い >

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して投資信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社又は受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、又は裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、上記< 投資信託約款の変更等と重大な投資信託約款の変更等の手続き >に従い、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。

委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの投資信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### < 運用報告書 >

委託会社は、毎決算時及び償還時に交付運用報告書及び運用報告書（全体版）を作成し、交付運用報告書を販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

#### < 関係法人との契約の更改手続き >

- ・委託会社が販売会社と締結している募集・販売等に関する契約

当該契約の有効期間は、契約満了日の3ヶ月前までに委託会社及び販売会社から別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長され、その後も同様とします。

#### < 公告 >

委託会社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。

#### < 混蔵寄託 >

金融機関又は第一種金融商品取引業者等（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う者及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。以下同じ。）から、売買代金及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又はコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関又は第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託することができるものとします。

#### < 投資信託財産の登記等及び記載等の留保等 >

信託の登記又は登録をすることができる投資信託財産については、信託の登記又は登録をすることとします。ただし、受託会社が認める場合は、信託の登記又は登録を留保することがあります。

上記 ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託会社又は受託会社が必要と認めるときは、速やかに登記又は登録をするものとします。

投資信託財産に属する旨の記載又は記録をすることができる投資信託財産については、投資信託財産に属する旨の記載又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、受託会社が認める場合は、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。

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。

#### 4【受益者の権利等】

##### (1)収益分配金に対する請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、毎計算期間終了日（決算日）において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係る決算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販売会社の名義で記載又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）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

上記の規定にかかわらず、収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社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、毎決算日の翌営業日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、分配金再投資に関する契約に基づき、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売付を行います。当該売付により増加した受益権は、振替口座簿に記載又は記録されます。

上記に規定する収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

##### (2)償還金に対する請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還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販売会社の名義で記載又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）に、原則として償還日から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

##### (3)換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行の請求をすることにより換金する権利を有します。

詳細につきましては、上記「2換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### (4)帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの投資信託財産に関する帳簿書類の閲覧又は謄写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)」に基づいて作成しております。

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13期計算期間(2019年6月11日から2020年6月10日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第12期 ( 2019年 6月10日現在 )	第13期 ( 2020年 6月10日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	14,165,514	15,873,903
親投資信託受益証券	3,149,458,046	3,155,500,956
未収入金	10,796,797	82,460,627
流動資産合計	3,174,420,357	3,253,835,486
資産合計	3,174,420,357	3,253,835,486
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	799,999	3,058,593
未払受託者報酬	843,628	860,365
未払委託者報酬	9,279,807	9,463,919
未払利息	29	23
その他未払費用	84,303	86,002
流動負債合計	11,007,766	13,468,902
負債合計	11,007,766	13,468,902
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,999,287,386	1,906,104,728
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	1,164,125,205	1,334,261,856
( 分配準備積立金 )	1,001,178,408	998,005,737
元本等合計	3,163,412,591	3,240,366,584
純資産合計	3,163,412,591	3,240,366,584
負債純資産合計	3,174,420,357	3,253,835,486

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自 2018年 6月12日	至 2019年 6月10日	自 2019年 6月11日	至 2020年 6月10日
営業収益				
受取利息		6		29
有価証券売買等損益		59,695,827		248,264,578
営業収益合計		59,695,821		248,264,607
営業費用				
支払利息		12,995		10,129
受託者報酬		1,768,544		1,732,861
委託者報酬		19,453,812		19,061,376
その他費用		177,519		173,196
営業費用合計		21,412,870		20,977,562
営業利益又は営業損失（ ）		81,108,691		227,287,045
経常利益又は経常損失（ ）		81,108,691		227,287,045
当期純利益又は当期純損失（ ）		81,108,691		227,287,045
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		8,893,779		7,980,363
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,320,407,236		1,164,125,205
剰余金増加額又は欠損金減少額		97,270,168		85,242,076
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		97,270,168		85,242,076
剰余金減少額又は欠損金増加額		181,337,287		134,412,107
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		181,337,287		134,412,107
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,164,125,205		1,334,261,856

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

	第12期 (2019年 6月10日現在)	第13期 (2020年 6月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,999,287,386口	1,906,104,728口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.5823円 (15,823円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.7000円 (17,000円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自 2018年 6月12日 至 2019年 6月10日	第13期 自 2019年 6月11日 至 2020年 6月10日																																																												
<b>分配金の計算過程</b> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>52,982,467円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>773,670,570円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>948,195,941円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>1,774,848,978円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,999,287,386口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>8,877円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	52,982,467円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円	収益調整金額	C	773,670,570円	分配準備積立金額	D	948,195,941円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,774,848,978円	当ファンドの期末残存口数	F	1,999,287,386口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	8,877円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円	<b>分配金の計算過程</b> <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>61,936,069円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>46,164,672円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>803,113,067円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>889,904,996円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>1,801,118,804円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,906,104,728口</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>9,449円</td> </tr> <tr> <td>1万口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>- 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>- 円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	61,936,069円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	46,164,672円	収益調整金額	C	803,113,067円	分配準備積立金額	D	889,904,996円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,801,118,804円	当ファンドの期末残存口数	F	1,906,104,728口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	9,449円	1万口当たり分配金額	H	- 円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	52,982,467円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	- 円																																																											
収益調整金額	C	773,670,570円																																																											
分配準備積立金額	D	948,195,941円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,774,848,978円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,999,287,386口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	8,877円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	61,936,069円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	46,164,672円																																																											
収益調整金額	C	803,113,067円																																																											
分配準備積立金額	D	889,904,996円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,801,118,804円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,906,104,728口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	9,449円																																																											
1万口当たり分配金額	H	- 円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	- 円																																																											

(金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第13期 自 2019年 6月11日 至 2020年 6月10日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第13期 (2020年 6月10日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.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)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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。

( 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。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。
-------------

## （その他の注記）

元本の移動

区分	第12期	第13期
	自 2018年 6月12日 至 2019年 6月10日	自 2019年 6月11日 至 2020年 6月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	2,128,429,347円	1,999,287,386円
期中追加設定元本額	164,740,715円	138,119,120円
期中一部解約元本額	293,882,676円	231,301,778円

## （有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第12期 (2019年 6月10日現在)	第13期 (2020年 6月10日現在)
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	59,702,150	230,411,420
合計	59,702,150	230,411,420

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （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

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
----	----	------	--------	----

親投資信託受益証券	日本株式マザーファンド	608,515,485	1,082,001,383
	外国株式マザーファンド	365,329,291	1,070,670,553
	外国債券マザーファンド	396,437,785	1,002,829,020
合計		1,370,282,561	3,155,500,956

(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。

(参考)

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

### 日本株式マザーファンド

#### 貸借対照表

項目	2020年 6月10日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,067,088,335
株式	247,199,274,550
派生商品評価勘定	28,907,500
未収入金	2,614,314,357
未収配当金	2,000,874,213
差入委託証拠金	121,508,000
流動資産合計	253,031,966,955
資産合計	253,031,966,955
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,909,900
前受金	20,997,600
未払解約金	1,724,353,185
未払利息	1,571
その他未払費用	4,035
流動負債合計	1,753,266,291
負債合計	1,753,266,291
純資産の部	
元本等	
元本	141,320,500,211
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	109,958,200,453
元本等合計	251,278,700,664
純資産合計	251,278,700,664

	2020年 6月10日現在
項目	金額（円）
負債純資産合計	253,031,966,955

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年 6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 新株予約権証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(金融商品取引所等に上場されるまでの間は、取得価額及び最終相場のないものについては、それに準じる価額)に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2020年 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	141,320,500,211口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 1.7781円 (1万口当たり純資産額) (17,781円)

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

	2020年 6月10日現在
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2．金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	2020年 6月10日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．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)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	2020年 6月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## （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。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月11日
期首元本額	132,345,809,414円
期中追加設定元本額	29,538,871,508円
期中一部解約元本額	20,564,180,711円
期末元本額	141,320,500,211円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	686,815,105円
D C 日本株式インデックスファンド	316,771,682円
D C 日本株式インデックスファンド L	53,910,728,738円
D C 日本株式インデックスファンド A	1,083,814,512円
D C バランスファンド 3 0	2,317,197,495円
D C バランスファンド 5 0	3,550,907,483円
D C バランスファンド 7 0	1,879,550,257円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	608,515,485円
日本株式インデックス e	1,644,497,086円
インデックスコレクション（国内株式）	18,872,032,906円

区分	2020年 6月10日現在
インデックスコレクション（バランス株式30）	13,077,195,413円
インデックスコレクション（バランス株式50）	2,346,615,261円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,802,505,688円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,547,521,895円
日本株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	2,419,865,444円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,389,028,446円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	80,472,134円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	926,099,610円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	112,549,443円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	408,328,283円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	4,745,762円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	767,238,848円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,141,425,335円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	587,077,148円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	9,859,235,992円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	849,776,401円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	132,845,825円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,654,886,785円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	44,234,078円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	199,099,988円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,416,518,836円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	77,767,144円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	79,843,723円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	40,382,782円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	901,156,988円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	400,509,125円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	6,812,780,962円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	125,913,646円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	54,347,995円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	11,917,082円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	175,628,772円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	2,154,628円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	15,056,539,976
合計	15,056,539,976

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「日本株式マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 株式関連

（2020年 6月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,822,702,400	-	3,843,700,000	20,997,600
合計		3,822,702,400	-	3,843,700,000	20,997,600

## （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、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第 1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	5,100	2,760.00	14,076,000	
日本水産	147,100	521.00	76,639,100	
マルハニチロ	21,300	2,343.00	49,905,900	
カネコ種苗	4,500	1,436.00	6,462,000	
サカタのタネ	17,500	3,510.00	61,425,000	
ホクト	11,200	1,975.00	22,120,000	
ホクリヨウ	2,300	658.00	1,513,400	
住石ホールディングス	29,700	123.00	3,653,100	
日鉄鉱業	3,400	4,500.00	15,300,000	
三井松島ホールディングス	5,700	906.00	5,164,200	
国際石油開発帝石	590,300	779.80	460,315,940	
石油資源開発	19,200	2,123.00	40,761,600	
K & O エナジーグループ	7,100	1,549.00	10,997,900	
ヒノキヤグループ	3,700	1,831.00	6,774,700	
ショーボンドホールディングス	22,900	4,990.00	114,271,000	
ミライト・ホールディングス	43,700	1,526.00	66,686,200	
タマホーム	7,900	1,296.00	10,238,400	
サンヨーホームズ	1,300	652.00	847,600	
日本アクア	5,800	597.00	3,462,600	

ファーストコーポレーション	4,500	572.00	2,574,000
ベストエラ	2,500	1,069.00	2,672,500
TATERU	30,300	183.00	5,544,900
キャンディル	2,400	549.00	1,317,600
スペースバリューホールディングス	17,900	385.00	6,891,500
ダイセキ環境ソリューション	2,800	1,007.00	2,819,600
第一カッター興業	1,800	2,055.00	3,699,000
明豊ファシリティワークス	4,700	594.00	2,791,800
安藤・間	87,600	690.00	60,444,000
東急建設	43,100	600.00	25,860,000
コムシスホールディングス	52,200	3,035.00	158,427,000
ビーアールホールディングス	16,000	578.00	9,248,000
高松コンストラクショングループ	9,200	2,393.00	22,015,600
東建コーポレーション	4,500	7,440.00	33,480,000
ソネック	1,500	838.00	1,257,000
ヤマウラ	6,400	832.00	5,324,800
大成建設	113,300	4,045.00	458,298,500
大林組	339,800	1,063.00	361,207,400
清水建設	344,800	921.00	317,560,800
飛鳥建設	9,700	1,153.00	11,184,100
長谷工コーポレーション	131,500	1,364.00	179,366,000
松井建設	13,400	691.00	9,259,400
銭高組	1,500	3,945.00	5,917,500
鹿島建設	266,700	1,296.00	345,643,200
不動テトラ	8,900	1,486.00	13,225,400
大末建設	3,900	841.00	3,279,900
鉄建建設	7,400	2,198.00	16,265,200
西松建設	26,200	2,133.00	55,884,600
三井住友建設	82,100	484.00	39,736,400
大豊建設	7,600	2,461.00	18,703,600
前田建設工業	85,100	875.00	74,462,500
佐田建設	7,300	415.00	3,029,500
ナカノフドー建設	9,300	385.00	3,580,500
奥村組	18,400	2,621.00	48,226,400
東鉄工業	14,600	2,800.00	40,880,000
イチケン	2,400	1,599.00	3,837,600
富士ピー・エス	5,000	577.00	2,885,000
浅沼組	3,800	4,400.00	16,720,000
戸田建設	141,100	704.00	99,334,400
熊谷組	15,700	2,723.00	42,751,100
北野建設	2,100	2,648.00	5,560,800
植木組	1,500	2,470.00	3,705,000

矢作建設工業	15,000	809.00	12,135,000	
ピーエス三菱	11,200	556.00	6,227,200	
日本ハウスホールディングス	23,200	305.00	7,076,000	
大東建託	37,100	11,650.00	432,215,000	
新日本建設	14,400	834.00	12,009,600	
N I P P O	28,100	2,615.00	73,481,500	
東亜道路工業	2,100	3,265.00	6,856,500	
前田道路	30,000	2,182.00	65,460,000	
日本道路	3,300	7,470.00	24,651,000	
東亜建設工業	10,600	1,601.00	16,970,600	
日本国土開発	33,100	540.00	17,874,000	
若築建設	6,100	1,247.00	7,606,700	
東洋建設	38,100	419.00	15,963,900	
五洋建設	134,700	587.00	79,068,900	
世紀東急工業	16,300	760.00	12,388,000	
福田組	3,900	4,980.00	19,422,000	
住友林業	86,100	1,352.00	116,407,200	
日本基礎技術	11,400	427.00	4,867,800	
巴コーポレーション	15,100	397.00	5,994,700	
大和ハウス工業	336,200	2,916.50	980,527,300	
ライト工業	19,400	1,537.00	29,817,800	
積水ハウス	368,500	2,162.50	796,881,250	
日特建設	8,900	737.00	6,559,300	
北陸電気工事	5,900	925.00	5,457,500	
ユアテック	19,400	642.00	12,454,800	
日本リーテック	7,100	2,182.00	15,492,200	
四電工	1,800	2,519.00	4,534,200	
中電工	13,700	2,313.00	31,688,100	
関電工	48,300	973.00	46,995,900	
きんでん	80,700	1,816.00	146,551,200	
東京エネシス	11,300	818.00	9,243,400	
トーエネック	3,400	3,735.00	12,699,000	
住友電設	9,600	2,398.00	23,020,800	
日本電設工業	18,600	2,480.00	46,128,000	
協和エクシオ	51,500	2,533.00	130,449,500	
新日本空調	9,000	2,546.00	22,914,000	
九電工	23,800	3,080.00	73,304,000	
三機工業	24,500	1,312.00	32,144,000	
日揮ホールディングス	104,600	1,238.00	129,494,800	
中外炉工業	3,700	1,655.00	6,123,500	
ヤマト	10,900	665.00	7,248,500	
太平電業	8,200	2,392.00	19,614,400	

高砂熱学工業	29,500	1,815.00	53,542,500
三晃金属工業	1,500	2,200.00	3,300,000
朝日工業社	2,300	3,115.00	7,164,500
明星工業	22,000	786.00	17,292,000
大気社	16,500	3,225.00	53,212,500
ダイダン	8,100	2,904.00	23,522,400
日比谷総合設備	10,900	1,852.00	20,186,800
フィル・カンパニー	1,900	3,110.00	5,909,000
O S J Bホールディングス	53,600	248.00	13,292,800
東洋エンジニアリング	14,300	450.00	6,435,000
レイズネクスト	18,200	1,236.00	22,495,200
日本製粉	31,800	1,613.00	51,293,400
日清製粉グループ本社	122,900	1,754.00	215,566,600
日東富士製粉	800	6,200.00	4,960,000
昭和産業	10,000	3,210.00	32,100,000
鳥越製粉	9,600	930.00	8,928,000
中部飼料	13,300	1,661.00	22,091,300
フィード・ワン	73,000	202.00	14,746,000
東洋精糖	1,800	1,265.00	2,277,000
日本甜菜製糖	5,700	1,727.00	9,843,900
三井製糖	9,500	2,107.00	20,016,500
塩水港精糖	11,800	217.00	2,560,600
日新製糖	5,100	1,954.00	9,965,400
森永製菓	25,500	4,345.00	110,797,500
中村屋	2,800	4,145.00	11,606,000
江崎グリコ	32,200	5,280.00	170,016,000
名糖産業	5,200	1,309.00	6,806,800
井村屋グループ	6,200	2,050.00	12,710,000
不二家	6,100	2,267.00	13,828,700
山崎製パン	81,500	1,868.00	152,242,000
第一屋製パン	1,900	970.00	1,843,000
モロゾフ	1,900	5,740.00	10,906,000
亀田製菓	6,200	5,330.00	33,046,000
寿スピリッツ	10,500	5,270.00	55,335,000
カルビー	49,600	3,010.00	149,296,000
森永乳業	20,100	4,470.00	89,847,000
六甲バター	7,200	1,566.00	11,275,200
ヤクルト本社	74,800	6,890.00	515,372,000
明治ホールディングス	71,900	8,260.00	593,894,000
雪印メグミルク	26,200	2,631.00	68,932,200
プリマハム	17,000	2,668.00	45,356,000
日本ハム	41,600	4,330.00	180,128,000

林兼産業	3,600	589.00	2,120,400
丸大食品	11,600	1,980.00	22,968,000
S Foods	8,700	2,724.00	23,698,800
柿安本店	3,800	2,643.00	10,043,400
伊藤ハム米久ホールディングス	70,000	656.00	45,920,000
サッポロホールディングス	37,100	2,226.00	82,584,600
アサヒグループホールディングス	227,700	4,416.00	1,005,523,200
キリンホールディングス	461,200	2,315.00	1,067,678,000
宝ホールディングス	80,600	1,064.00	85,758,400
オエノンホールディングス	28,700	408.00	11,709,600
養命酒製造	3,300	1,889.00	6,233,700
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	76,300	2,274.00	173,506,200
サントリー食品インターナショナル	72,800	4,425.00	322,140,000
ダイドーグループホールディングス	5,600	4,765.00	26,684,000
伊藤園	33,000	6,090.00	200,970,000
キーコーヒー	10,700	2,297.00	24,577,900
ユニカフェ	2,800	975.00	2,730,000
ジャパンフーズ	1,500	1,202.00	1,803,000
日清オイリオグループ	14,000	3,370.00	47,180,000
不二製油グループ本社	26,500	2,904.00	76,956,000
かどや製油	1,200	3,650.00	4,380,000
J - オイルミルズ	5,600	4,075.00	22,820,000
キッコーマン	78,300	5,430.00	425,169,000
味の素	240,100	1,833.50	440,223,350
キューピー	60,500	2,157.00	130,498,500
ハウス食品グループ本社	40,700	3,665.00	149,165,500
カゴメ	41,300	3,030.00	125,139,000
焼津水産化学工業	5,300	961.00	5,093,300
アリアケジャパン	9,900	7,270.00	71,973,000
ピエトロ	1,400	1,624.00	2,273,600
エバラ食品工業	2,600	2,192.00	5,699,200
やまみ	900	2,176.00	1,958,400
ニチレイ	51,800	3,035.00	157,213,000
東洋水産	55,900	5,570.00	311,363,000
イトアンド	3,800	1,805.00	6,859,000
大冷	1,400	1,979.00	2,770,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,000	1,129.00	6,774,000
日清食品ホールディングス	46,200	8,850.00	408,870,000
永谷園ホールディングス	5,300	2,194.00	11,628,200
一正蒲鉾	4,200	1,049.00	4,405,800
フジッコ	11,800	1,956.00	23,080,800
ロック・フィールド	11,700	1,313.00	15,362,100

日本たばこ産業	627,900	2,206.00	1,385,147,400
ケンコーマヨネーズ	6,100	2,185.00	13,328,500
わらべや日洋ホールディングス	7,100	1,751.00	12,432,100
なとり	6,100	1,745.00	10,644,500
イフジ産業	1,900	826.00	1,569,400
ピクルスコーポレーション	2,400	2,479.00	5,949,600
北の達人コーポレーション	38,000	574.00	21,812,000
ユーグレナ	46,900	840.00	39,396,000
ミヨシ油脂	4,200	1,104.00	4,636,800
理研ビタミン	10,300	2,253.00	23,205,900
片倉工業	15,700	1,267.00	19,891,900
ゲンゼ	7,900	3,890.00	30,731,000
東洋紡	42,200	1,542.00	65,072,400
ユニチカ	32,100	382.00	12,262,200
富士紡ホールディングス	5,200	3,370.00	17,524,000
倉敷紡績	10,700	2,385.00	25,519,500
シキボウ	5,600	1,033.00	5,784,800
日本毛織	35,300	1,051.00	37,100,300
トーア紡コーポレーション	4,200	503.00	2,112,600
帝国繊維	12,100	2,307.00	27,914,700
帝人	86,800	1,813.00	157,368,400
東レ	769,000	560.00	430,640,000
サカイオーベックス	3,000	2,182.00	6,546,000
住江織物	2,300	2,173.00	4,997,900
日本フェルト	6,800	495.00	3,366,000
イチカワ	1,800	1,311.00	2,359,800
日東製網	1,200	1,360.00	1,632,000
アツギ	8,900	634.00	5,642,600
ダイニック	4,000	769.00	3,076,000
セーレン	26,400	1,394.00	36,801,600
ソトー	4,300	958.00	4,119,400
東海染工	1,500	1,122.00	1,683,000
小松マテーレ	17,500	757.00	13,247,500
ワコールホールディングス	27,700	2,164.00	59,942,800
ホギメディカル	12,100	3,410.00	41,261,000
クラウディアホールディングス	2,800	439.00	1,229,200
T S Iホールディングス	35,700	505.00	18,028,500
マツオカコーポレーション	3,100	2,170.00	6,727,000
ワールド	15,100	1,673.00	25,262,300
三陽商会	5,500	945.00	5,197,500
ナイガイ	4,100	371.00	1,521,100
オンワードホールディングス	63,900	391.00	24,984,900

ルックホールディングス	3,700	867.00	3,207,900
ゴールドウイン	19,200	6,690.00	128,448,000
デサント	20,700	1,736.00	35,935,200
キング	5,200	500.00	2,600,000
ヤマトインターナショナル	9,500	380.00	3,610,000
特種東海製紙	6,700	4,340.00	29,078,000
王子ホールディングス	443,600	531.00	235,551,600
日本製紙	46,900	1,635.00	76,681,500
三菱製紙	12,000	390.00	4,680,000
北越コーポレーション	63,300	415.00	26,269,500
中越パルプ工業	4,500	1,486.00	6,687,000
巴川製紙所	3,100	946.00	2,932,600
大王製紙	46,800	1,459.00	68,281,200
阿波製紙	2,700	525.00	1,417,500
レンゴー	100,300	876.00	87,862,800
トモク	6,500	1,726.00	11,219,000
ザ・パック	8,000	3,290.00	26,320,000
クラレ	167,100	1,261.00	210,713,100
旭化成	703,300	940.50	661,453,650
共和レザー	5,800	705.00	4,089,000
昭和電工	75,500	2,696.00	203,548,000
住友化学	779,600	356.00	277,537,600
住友精化	4,700	3,365.00	15,815,500
日産化学	58,900	5,500.00	323,950,000
ラサ工業	3,700	1,595.00	5,901,500
クレハ	9,100	5,150.00	46,865,000
多木化学	4,100	7,840.00	32,144,000
テイカ	7,800	1,548.00	12,074,400
石原産業	19,000	787.00	14,953,000
片倉コープアグリ	2,700	1,231.00	3,323,700
日本曹達	15,700	3,020.00	47,414,000
東ソー	164,000	1,564.00	256,496,000
トクヤマ	30,600	2,637.00	80,692,200
セントラル硝子	21,700	2,090.00	45,353,000
東亜合成	66,600	1,088.00	72,460,800
大阪ソーダ	10,800	2,565.00	27,702,000
関東電化工業	25,200	922.00	23,234,400
デンカ	38,700	2,805.00	108,553,500
信越化学工業	182,200	12,770.00	2,326,694,000
日本カーバイド工業	3,600	1,418.00	5,104,800
堺化学工業	6,900	2,075.00	14,317,500
第一稀元素化学工業	11,500	811.00	9,326,500

エア・ウォーター	98,700	1,595.00	157,426,500
大陽日酸	102,000	1,979.00	201,858,000
日本化学工業	3,300	2,371.00	7,824,300
東邦アセチレン	1,600	1,286.00	2,057,600
日本パーカラライジング	53,500	1,189.00	63,611,500
高压ガス工業	16,800	775.00	13,020,000
チタン工業	1,300	1,851.00	2,406,300
四国化成工業	16,400	1,144.00	18,761,600
戸田工業	2,500	1,860.00	4,650,000
ステラ ケミファ	5,800	2,754.00	15,973,200
保土谷化学工業	4,000	4,045.00	16,180,000
日本触媒	16,500	6,060.00	99,990,000
大日精化工業	9,400	2,547.00	23,941,800
カネカ	27,400	2,994.00	82,035,600
三菱瓦斯化学	98,700	1,678.00	165,618,600
三井化学	96,300	2,475.00	238,342,500
J S R	98,900	2,018.00	199,580,200
東京応化工業	18,200	5,020.00	91,364,000
大阪有機化学工業	9,800	2,046.00	20,050,800
三菱ケミカルホールディングス	709,400	673.10	477,497,140
K Hネオケム	18,700	2,204.00	41,214,800
ダイセル	138,200	925.00	127,835,000
住友ベークライト	16,700	3,370.00	56,279,000
積水化学工業	228,200	1,581.00	360,784,200
日本ゼオン	95,700	1,060.00	101,442,000
アイカ工業	31,800	3,355.00	106,689,000
宇部興産	53,600	2,006.00	107,521,600
積水樹脂	19,100	2,347.00	44,827,700
タキロンシーアイ	23,000	703.00	16,169,000
旭有機材	6,000	1,517.00	9,102,000
ニチバン	5,600	1,502.00	8,411,200
リケンテクノス	26,700	433.00	11,561,100
大倉工業	5,000	1,690.00	8,450,000
積水化成成品工業	14,200	624.00	8,860,800
群栄化学工業	2,400	2,676.00	6,422,400
タイガースポリマー	5,600	500.00	2,800,000
ミライアル	3,700	1,197.00	4,428,900
ダイキアクシス	3,800	865.00	3,287,000
ダイキョーニシカワ	22,400	601.00	13,462,400
竹本容器	3,800	766.00	2,910,800
森六ホールディングス	5,700	1,731.00	9,866,700
日本化薬	65,700	1,132.00	74,372,400

カーリットホールディングス	11,300	551.00	6,226,300	
日本精化	8,500	1,460.00	12,410,000	
扶桑化学工業	10,800	3,920.00	42,336,000	
トリケミカル研究所	2,400	11,470.00	27,528,000	
A D E K A	48,800	1,523.00	74,322,400	
日油	40,000	3,820.00	152,800,000	
新日本理化	17,600	184.00	3,238,400	
ハリマ化成グループ	8,800	1,038.00	9,134,400	
花王	259,400	8,966.00	2,325,780,400	
第一工業製薬	4,000	4,920.00	19,680,000	
石原ケミカル	2,900	1,958.00	5,678,200	
日華化学	3,600	953.00	3,430,800	
ニイタカ	2,200	4,395.00	9,669,000	
三洋化成工業	6,300	4,945.00	31,153,500	
有機合成薬品工業	8,100	383.00	3,102,300	
大日本塗料	12,000	949.00	11,388,000	
日本ペイントホールディングス	87,600	7,880.00	690,288,000	
関西ペイント	119,200	2,312.00	275,590,400	
神東塗料	8,300	202.00	1,676,600	
中国塗料	30,200	817.00	24,673,400	
日本特殊塗料	7,900	1,004.00	7,931,600	
藤倉化成	14,300	538.00	7,693,400	
太陽ホールディングス	7,800	5,020.00	39,156,000	
D I C	44,800	2,878.00	128,934,400	
サカタインクス	23,200	1,087.00	25,218,400	
東洋インキＳＣホールディングス	22,400	2,150.00	48,160,000	
T & K T O K A	8,200	830.00	6,806,000	
富士フイルムホールディングス	207,700	5,011.00	1,040,784,700	
資生堂	215,300	7,223.00	1,555,111,900	
ライオン	140,900	2,442.00	344,077,800	
高砂香料工業	6,800	2,495.00	16,966,000	
マンダム	24,400	2,135.00	52,094,000	
ミルボン	14,500	5,270.00	76,415,000	
ファンケル	43,800	3,050.00	133,590,000	
コーセー	20,400	14,870.00	303,348,000	
コタ	6,200	1,204.00	7,464,800	
シーボン	1,400	2,160.00	3,024,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	46,200	2,228.00	102,933,600	
ノエビアホールディングス	9,200	4,705.00	43,286,000	
アジュバンコスメジャパン	2,400	960.00	2,304,000	
エステー	7,000	1,655.00	11,585,000	
アグロ カネショウ	4,500	1,360.00	6,120,000	

コニシ	17,800	1,552.00	27,625,600
長谷川香料	18,700	2,303.00	43,066,100
星光P M C	6,200	751.00	4,656,200
小林製薬	30,400	9,700.00	294,880,000
荒川化学工業	9,700	1,279.00	12,406,300
メック	7,400	2,021.00	14,955,400
日本高純度化学	3,000	2,560.00	7,680,000
タカラバイオ	28,400	3,385.00	96,134,000
J C U	13,100	3,185.00	41,723,500
新田ゼラチン	6,800	735.00	4,998,000
O A T アグリオ	1,900	1,192.00	2,264,800
デクセリアルズ	28,000	882.00	24,696,000
アース製薬	8,200	7,390.00	60,598,000
北興化学工業	11,100	624.00	6,926,400
大成ラミック	3,600	2,778.00	10,000,800
クミアイ化学工業	44,800	900.00	40,320,000
日本農薬	19,300	508.00	9,804,400
アキレス	7,500	1,761.00	13,207,500
有沢製作所	17,100	834.00	14,261,400
日東電工	74,800	6,170.00	461,516,000
レック	11,600	1,790.00	20,764,000
三光合成	12,400	313.00	3,881,200
きもと	18,400	164.00	3,017,600
藤森工業	9,700	3,715.00	36,035,500
前澤化成工業	6,900	1,025.00	7,072,500
未来工業	5,800	1,998.00	11,588,400
ウェーブロックホールディングス	3,700	762.00	2,819,400
J S P	6,300	1,558.00	9,815,400
エフピコ	11,900	7,950.00	94,605,000
天馬	7,200	1,754.00	12,628,800
信越ポリマー	19,500	937.00	18,271,500
東リ	27,000	278.00	7,506,000
ニフコ	39,800	2,520.00	100,296,000
バルカー	8,800	2,040.00	17,952,000
ユニ・チャーム	208,800	4,049.00	845,431,200
ショーエイコーポレーション	1,600	905.00	1,448,000
協和キリン	109,000	2,829.00	308,361,000
武田薬品工業	901,400	4,115.00	3,709,261,000
アステラス製薬	939,400	1,839.50	1,728,026,300
大日本住友製薬	80,300	1,617.00	129,845,100
塩野義製薬	136,300	6,614.00	901,488,200
わかもと製薬	12,900	321.00	4,140,900

あすか製薬	12,300	1,296.00	15,940,800
日本新薬	28,400	9,040.00	256,736,000
ピオフェルミン製薬	1,800	2,310.00	4,158,000
中外製薬	113,000	15,810.00	1,786,530,000
科研製薬	18,500	5,730.00	106,005,000
エーザイ	129,700	8,896.00	1,153,811,200
ロート製薬	55,600	3,275.00	182,090,000
小野薬品工業	248,800	3,027.00	753,117,600
久光製薬	28,600	5,580.00	159,588,000
持田製薬	15,000	4,170.00	62,550,000
参天製薬	201,800	2,037.00	411,066,600
扶桑薬品工業	3,800	2,600.00	9,880,000
日本ケミファ	1,400	2,662.00	3,726,800
ツムラ	33,600	2,930.00	98,448,000
日医工	30,700	1,336.00	41,015,200
キッセイ薬品工業	19,200	2,760.00	52,992,000
生化学工業	21,000	1,171.00	24,591,000
栄研化学	19,000	1,849.00	35,131,000
日水製薬	4,600	1,242.00	5,713,200
鳥居薬品	6,800	3,265.00	22,202,000
JCRファーマ	7,600	12,060.00	91,656,000
東和薬品	13,900	2,211.00	30,732,900
富士製薬工業	7,400	1,244.00	9,205,600
沢井製薬	22,200	5,970.00	132,534,000
ゼリア新薬工業	19,700	2,038.00	40,148,600
第一三共	310,000	8,968.00	2,780,080,000
キョーリン製薬ホールディングス	23,900	2,164.00	51,719,600
大幸薬品	13,200	2,232.00	29,462,400
ダイト	6,600	4,425.00	29,205,000
大塚ホールディングス	206,400	4,969.00	1,025,601,600
大正製薬ホールディングス	22,900	6,850.00	156,865,000
ペプチドリーム	55,100	4,975.00	274,122,500
日本コークス工業	91,500	69.00	6,313,500
ニチレキ	12,800	1,652.00	21,145,600
ユシロ化学工業	6,100	1,323.00	8,070,300
ビーピー・カストロール	3,900	1,299.00	5,066,100
富士石油	28,900	188.00	5,433,200
MORESCO	3,900	1,108.00	4,321,200
出光興産	120,200	2,429.00	291,965,800
JXTGホールディングス	1,629,900	421.90	687,654,810
コスモエネルギーホールディングス	31,400	1,749.00	54,918,600
横浜ゴム	62,700	1,725.00	108,157,500

TOYO TIRE	62,200	1,589.00	98,835,800
ブリヂストン	312,100	3,703.00	1,155,706,300
住友ゴム工業	97,300	1,191.00	115,884,300
藤倉コンポジット	9,500	390.00	3,705,000
オカモト	6,600	3,980.00	26,268,000
フコク	4,700	692.00	3,252,400
ニッタ	12,200	2,394.00	29,206,800
住友理工	21,000	681.00	14,301,000
三ツ星ベルト	14,300	1,769.00	25,296,700
バンドー化学	19,100	656.00	12,529,600
日東紡績	16,100	5,190.00	83,559,000
A G C	107,100	3,440.00	368,424,000
日本板硝子	51,800	469.00	24,294,200
石塚硝子	2,000	2,151.00	4,302,000
日本山村硝子	4,500	910.00	4,095,000
日本電気硝子	43,500	1,907.00	82,954,500
オハラ	4,300	1,156.00	4,970,800
住友大阪セメント	20,500	3,890.00	79,745,000
太平洋セメント	68,400	2,620.00	179,208,000
日本ヒューム	10,900	753.00	8,207,700
日本コンクリート工業	23,400	280.00	6,552,000
三谷セキサン	5,000	5,320.00	26,600,000
アジアパイルホールディングス	15,400	488.00	7,515,200
東海カーボン	113,500	1,055.00	119,742,500
日本カーボン	5,600	3,730.00	20,888,000
東洋炭素	6,400	1,777.00	11,372,800
ノリタケカンパニーリミテド	6,000	3,700.00	22,200,000
T O T O	77,400	4,530.00	350,622,000
日本碍子	130,100	1,681.00	218,698,100
日本特殊陶業	82,400	1,762.00	145,188,800
M A R U W A	4,200	8,240.00	34,608,000
品川リフラクトリーズ	2,900	2,594.00	7,522,600
黒崎播磨	2,200	4,250.00	9,350,000
ヨータイ	8,600	740.00	6,364,000
イソライト工業	5,600	537.00	3,007,200
東京窯業	13,900	304.00	4,225,600
ニッカトー	4,900	720.00	3,528,000
フジインコーポレーテッド	9,700	3,125.00	30,312,500
クニミネ工業	4,400	1,008.00	4,435,200
エーアンドエーマテリアル	1,800	1,197.00	2,154,600
ニチアス	29,700	2,446.00	72,646,200
ニチハ	15,100	2,432.00	36,723,200

日本製鉄	479,500	1,095.50	525,292,250
神戸製鋼所	196,200	430.00	84,366,000
中山製鋼所	15,000	381.00	5,715,000
合同製鐵	5,800	2,149.00	12,464,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	289,400	894.00	258,723,600
東京製鐵	52,200	678.00	35,391,600
共英製鋼	12,100	1,450.00	17,545,000
大和工業	22,800	2,297.00	52,371,600
東京鐵鋼	4,400	1,409.00	6,199,600
大阪製鐵	5,700	1,350.00	7,695,000
淀川製鋼所	14,500	1,817.00	26,346,500
丸一鋼管	34,800	2,868.00	99,806,400
モリ工業	3,200	2,440.00	7,808,000
大同特殊鋼	17,600	3,780.00	66,528,000
日本高周波鋼業	4,100	392.00	1,607,200
日本冶金工業	8,900	1,812.00	16,126,800
山陽特殊製鋼	7,400	1,091.00	8,073,400
愛知製鋼	6,000	3,170.00	19,020,000
日立金属	115,500	1,332.00	153,846,000
日本金属	2,500	715.00	1,787,500
大平洋金属	7,300	1,870.00	13,651,000
新日本電工	69,300	176.00	12,196,800
栗本鐵工所	5,300	1,847.00	9,789,100
虹技	1,600	1,257.00	2,011,200
三菱製鋼	8,000	738.00	5,904,000
日亜鋼業	15,900	291.00	4,626,900
日本精線	1,800	3,580.00	6,444,000
エンビプロ・ホールディングス	4,600	693.00	3,187,800
シンニッタン	16,800	282.00	4,737,600
新家工業	2,500	1,185.00	2,962,500
大紀アルミニウム工業所	17,800	618.00	11,000,400
日本軽金属ホールディングス	271,600	196.00	53,233,600
三井金属鋁業	29,000	2,400.00	69,600,000
東邦亜鉛	5,500	1,678.00	9,229,000
三菱マテリアル	70,800	2,486.00	176,008,800
住友金属鋁山	137,000	3,186.00	436,482,000
D O W A ホールディングス	27,100	3,615.00	97,966,500
古河機械金属	19,100	1,147.00	21,907,700
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,200	1,130.00	12,656,000
東邦チタニウム	19,300	747.00	14,417,100
U A C J	16,300	2,083.00	33,952,900
C K サンエツ	2,300	3,330.00	7,659,000

古河電気工業	33,300	2,720.00	90,576,000
住友電気工業	400,700	1,377.00	551,763,900
フジクラ	129,700	340.00	44,098,000
昭和電線ホールディングス	12,400	1,091.00	13,528,400
東京特殊電線	1,600	2,313.00	3,700,800
タツタ電線	21,400	593.00	12,690,200
カナレ電気	1,800	1,888.00	3,398,400
平河ヒューテック	5,400	1,100.00	5,940,000
リョービ	13,200	1,477.00	19,496,400
アーレスティ	14,300	406.00	5,805,800
アサヒホールディングス	18,800	2,779.00	52,245,200
稲葉製作所	6,000	1,396.00	8,376,000
宮地エンジニアリンググループ	3,300	1,681.00	5,547,300
トーカロ	29,800	1,089.00	32,452,200
アルファC o	3,800	978.00	3,716,400
SUMCO	127,300	1,683.00	214,245,900
川田テクノロジーズ	2,200	5,210.00	11,462,000
RS Technologies	3,000	3,625.00	10,875,000
信和	6,200	735.00	4,557,000
東洋製罐グループホールディングス	68,200	1,354.00	92,342,800
ホッカンホールディングス	5,900	1,700.00	10,030,000
コロナ	5,900	1,001.00	5,905,900
横河ブリッジホールディングス	19,900	2,199.00	43,760,100
駒井ハルテック	2,000	1,505.00	3,010,000
高田機工	1,000	2,401.00	2,401,000
三和ホールディングス	101,000	1,010.00	102,010,000
文化シャッター	31,600	796.00	25,153,600
三協立山	13,800	1,054.00	14,545,200
アルインコ	7,800	959.00	7,480,200
東洋シャッター	2,600	700.00	1,820,000
LIXILグループ	158,100	1,638.00	258,967,800
日本フィルコン	8,200	542.00	4,444,400
ノーリツ	22,200	1,306.00	28,993,200
長府製作所	10,900	2,325.00	25,342,500
リンナイ	20,800	9,350.00	194,480,000
ダイニチ工業	5,800	670.00	3,886,000
日東精工	14,800	497.00	7,355,600
三洋工業	1,400	1,831.00	2,563,400
岡部	21,700	855.00	18,553,500
ジーテクト	13,300	1,229.00	16,345,700
東プレ	20,000	1,384.00	27,680,000
高周波熱錬	20,600	581.00	11,968,600

東京製綱	7,700	620.00	4,774,000
サンコール	8,000	479.00	3,832,000
モリテック スチール	8,300	326.00	2,705,800
パイオラックス	15,800	1,737.00	27,444,600
エイチワン	10,500	629.00	6,604,500
日本発條	114,900	796.00	91,460,400
中央発條	1,300	2,811.00	3,654,300
アドバネクス	1,500	1,308.00	1,962,000
立川ブラインド工業	4,700	1,283.00	6,030,100
三益半導体工業	8,400	2,264.00	19,017,600
日本ドライケミカル	2,700	1,719.00	4,641,300
日本製鋼所	32,600	1,656.00	53,985,600
三浦工業	46,400	4,480.00	207,872,000
タクマ	36,400	1,442.00	52,488,800
ツガミ	22,300	1,018.00	22,701,400
オークマ	12,500	5,070.00	63,375,000
芝浦機械	12,100	2,411.00	29,173,100
アマダ	133,000	1,012.00	134,596,000
アイダエンジニアリング	28,200	782.00	22,052,400
滝澤鉄工所	3,400	1,059.00	3,600,600
F U J I	46,100	1,953.00	90,033,300
牧野フライス製作所	12,600	3,685.00	46,431,000
オーエスジー	49,600	1,745.00	86,552,000
ダイジェット工業	1,300	1,339.00	1,740,700
旭ダイヤモンド工業	28,300	545.00	15,423,500
D M G 森精機	67,900	1,438.00	97,640,200
ソディック	25,300	875.00	22,137,500
ディスコ	14,500	26,730.00	387,585,000
日東工器	5,900	2,016.00	11,894,400
日進工具	4,200	2,692.00	11,306,400
パンチ工業	9,800	442.00	4,331,600
富士ダイス	4,800	675.00	3,240,000
豊和工業	6,000	815.00	4,890,000
O K K	4,400	446.00	1,962,400
東洋機械金属	7,800	445.00	3,471,000
津田駒工業	2,200	1,008.00	2,217,600
エンシュウ	2,700	1,014.00	2,737,800
島精機製作所	16,900	1,640.00	27,716,000
オプトラン	12,000	2,570.00	30,840,000
N C ホールディングス	3,400	544.00	1,849,600
イワキポンプ	6,900	1,061.00	7,320,900
フリー	10,600	957.00	10,144,200

ヤマシンフィルタ	23,300	1,068.00	24,884,400
日阪製作所	13,300	804.00	10,693,200
やまびこ	20,800	1,011.00	21,028,800
平田機工	5,100	6,190.00	31,569,000
ペガサスミシン製造	11,100	375.00	4,162,500
マルマエ	4,000	1,012.00	4,048,000
タツモ	5,000	1,752.00	8,760,000
ナプテスコ	63,200	3,420.00	216,144,000
三井海洋開発	11,400	1,739.00	19,824,600
レオン自動機	10,600	1,384.00	14,670,400
S M C	34,000	55,890.00	1,900,260,000
ホソカワミクロン	3,800	5,960.00	22,648,000
ユニオンツール	4,000	2,894.00	11,576,000
オイレス工業	13,900	1,464.00	20,349,600
日精エー・エス・ビー機械	3,100	3,520.00	10,912,000
サトーホールディングス	15,300	2,568.00	39,290,400
技研製作所	9,400	5,020.00	47,188,000
日本エアージェット	3,800	1,036.00	3,936,800
カワタ	3,200	813.00	2,601,600
日精樹脂工業	9,100	880.00	8,008,000
オカダアイヨン	3,500	1,003.00	3,510,500
ワイエイシイホールディングス	4,600	527.00	2,424,200
小松製作所	490,800	2,306.00	1,131,784,800
住友重機械工業	62,100	2,695.00	167,359,500
日立建機	43,400	3,055.00	132,587,000
日工	15,000	671.00	10,065,000
巴工業	4,600	1,874.00	8,620,400
井関農機	10,900	1,258.00	13,712,200
T O W A	11,000	1,244.00	13,684,000
丸山製作所	2,300	1,281.00	2,946,300
北川鉄工所	4,900	1,804.00	8,839,600
ローツェ	4,800	5,380.00	25,824,000
タカキタ	3,900	593.00	2,312,700
クボタ	574,900	1,613.50	927,601,150
荏原実業	2,800	2,605.00	7,294,000
三菱化工機	3,800	1,761.00	6,691,800
月島機械	20,000	1,300.00	26,000,000
帝国電機製作所	9,000	1,273.00	11,457,000
新東工業	25,800	814.00	21,001,200
澁谷工業	9,500	3,140.00	29,830,000
アイチ コーポレーション	18,800	754.00	14,175,200
小森コーポレーション	27,600	734.00	20,258,400

鶴見製作所	8,400	1,883.00	15,817,200
住友精密工業	1,600	2,459.00	3,934,400
日本ギア工業	4,600	292.00	1,343,200
酒井重工業	2,100	2,500.00	5,250,000
荏原製作所	44,900	2,729.00	122,532,100
石井鐵工所	1,400	2,530.00	3,542,000
西島製作所	11,000	838.00	9,218,000
北越工業	11,200	1,104.00	12,364,800
ダイキン工業	138,000	16,760.00	2,312,880,000
オルガノ	3,900	5,880.00	22,932,000
トーヨーカネツ	4,800	2,225.00	10,680,000
栗田工業	58,700	3,075.00	180,502,500
椿本チエイン	15,500	2,960.00	45,880,000
大同工業	5,300	707.00	3,747,100
木村化工機	9,200	478.00	4,397,600
アネスト岩田	16,900	876.00	14,804,400
ダイフク	55,400	8,860.00	490,844,000
サムコ	2,700	2,150.00	5,805,000
加藤製作所	6,000	1,282.00	7,692,000
油研工業	1,900	1,534.00	2,914,600
タダノ	52,400	939.00	49,203,600
フジテック	39,400	1,809.00	71,274,600
C K D	29,700	1,969.00	58,479,300
キトー	8,200	1,288.00	10,561,600
平和	30,300	1,895.00	57,418,500
理想科学工業	9,600	1,495.00	14,352,000
S A N K Y O	24,100	2,886.00	69,552,600
日本金銭機械	12,100	659.00	7,973,900
マースグループホールディングス	6,900	1,652.00	11,398,800
フクシマガリレイ	6,700	3,590.00	24,053,000
オーイズミ	4,700	413.00	1,941,100
ダイコク電機	5,000	1,271.00	6,355,000
竹内製作所	18,200	1,808.00	32,905,600
アマノ	28,400	2,458.00	69,807,200
J U K I	15,100	661.00	9,981,100
蛇の目マシン工業	10,000	489.00	4,890,000
マックス	16,600	1,677.00	27,838,200
グローリー	27,900	2,641.00	73,683,900
新晃工業	10,100	1,505.00	15,200,500
大和冷機工業	15,700	1,038.00	16,296,600
セガサミーホールディングス	107,500	1,389.00	149,317,500
日本ピストンリング	4,000	1,245.00	4,980,000

リケン	5,000	3,050.00	15,250,000
T P R	14,600	1,589.00	23,199,400
ツバキ・ナカシマ	22,200	1,050.00	23,310,000
ホシザキ	31,700	9,220.00	292,274,000
大豊工業	9,000	612.00	5,508,000
日本精工	204,100	898.00	183,281,800
N T N	251,000	253.00	63,503,000
ジェイテクト	104,000	964.00	100,256,000
不二越	10,100	3,740.00	37,774,000
日本トムソン	32,300	401.00	12,952,300
T H K	63,100	2,959.00	186,712,900
ユーシン精機	8,500	796.00	6,766,000
前澤給装工業	4,000	1,994.00	7,976,000
イーグル工業	13,500	795.00	10,732,500
前澤工業	7,400	353.00	2,612,200
日本ピラー工業	11,000	1,474.00	16,214,000
キッツ	44,000	736.00	32,384,000
マキタ	141,300	3,920.00	553,896,000
日立造船	86,100	411.00	35,387,100
三菱重工業	181,600	2,971.00	539,533,600
I H I	78,100	1,820.00	142,142,000
スター精密	16,700	1,342.00	22,411,400
日清紡ホールディングス	72,300	889.00	64,274,700
イビデン	66,500	2,969.00	197,438,500
コニカミノルタ	237,700	453.00	107,678,100
ブラザー工業	132,500	2,116.00	280,370,000
ミネベアミツミ	201,300	2,115.00	425,749,500
日立製作所	520,600	3,709.00	1,930,905,400
三菱電機	1,083,500	1,483.50	1,607,372,250
富士電機	65,300	3,055.00	199,491,500
東洋電機製造	4,000	1,252.00	5,008,000
安川電機	116,600	3,895.00	454,157,000
シンフォニアテクノロジー	14,100	1,126.00	15,876,600
明電舎	20,000	1,824.00	36,480,000
オリジン	3,000	1,538.00	4,614,000
山洋電気	5,300	4,695.00	24,883,500
デンヨー	9,300	1,933.00	17,976,900
東芝テック	13,600	3,990.00	54,264,000
芝浦メカトロニクス	2,100	3,020.00	6,342,000
マブチモーター	30,100	3,600.00	108,360,000
日本電産	260,800	7,000.00	1,825,600,000
トレックス・セミコンダクター	6,600	1,280.00	8,448,000

東光高岳	6,500	1,059.00	6,883,500
ダイヘン	11,900	3,605.00	42,899,500
ヤーマン	18,300	781.00	14,292,300
JVCケンウッド	90,700	190.00	17,233,000
ミマキエンジニアリング	10,800	401.00	4,330,800
第一精工	4,600	2,529.00	11,633,400
日新電機	25,500	1,154.00	29,427,000
大崎電気工業	21,700	527.00	11,435,900
オムロン	97,100	7,440.00	722,424,000
日東工業	16,000	1,886.00	30,176,000
I D E C	15,700	1,750.00	27,475,000
正興電機製作所	2,900	1,032.00	2,992,800
不二電機工業	2,100	1,314.00	2,759,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,400	1,969.00	71,671,600
サクサホールディングス	2,600	1,803.00	4,687,800
メルコホールディングス	3,900	2,840.00	11,076,000
テクノメディカ	2,700	1,840.00	4,968,000
日本電気	131,400	5,040.00	662,256,000
富士通	104,500	11,925.00	1,246,162,500
沖電気工業	44,100	1,111.00	48,995,100
岩崎通信機	4,700	850.00	3,995,000
電気興業	5,200	2,765.00	14,378,000
サンケン電気	11,900	2,494.00	29,678,600
ナカヨ	2,200	1,468.00	3,229,600
アイホン	6,200	1,598.00	9,907,600
ルネサスエレクトロニクス	519,000	647.00	335,793,000
セイコーエプソン	134,500	1,423.00	191,393,500
ワコム	73,700	595.00	43,851,500
アルバック	20,000	3,320.00	66,400,000
アクセル	5,000	815.00	4,075,000
E I Z O	8,400	4,300.00	36,120,000
日本信号	27,700	1,223.00	33,877,100
京三製作所	25,500	535.00	13,642,500
能美防災	14,500	2,073.00	30,058,500
ホーチキ	8,200	1,441.00	11,816,200
星和電機	5,900	670.00	3,953,000
エレコム	12,100	5,130.00	62,073,000
パナソニック	1,238,000	987.00	1,221,906,000
シャープ	125,400	1,276.00	160,010,400
アンリツ	69,800	2,403.00	167,729,400
富士通ゼネラル	29,500	2,256.00	66,552,000
ソニー	678,700	7,496.00	5,087,535,200

TDK	52,400	11,140.00	583,736,000
帝国通信工業	5,200	1,225.00	6,370,000
タムラ製作所	36,400	484.00	17,617,600
アルプスアルパイン	96,200	1,583.00	152,284,600
池上通信機	3,400	928.00	3,155,200
鈴木	5,900	788.00	4,649,200
日本トリム	1,600	3,250.00	5,200,000
ローランド ディー・ジー・	6,300	1,344.00	8,467,200
フォスター電機	11,400	1,289.00	14,694,600
SMK	2,800	2,638.00	7,386,400
ヨコオ	7,200	2,808.00	20,217,600
ホシデン	30,100	984.00	29,618,400
ヒロセ電機	16,800	12,430.00	208,824,000
日本航空電子工業	24,900	1,676.00	41,732,400
TOA	11,700	796.00	9,313,200
マクセルホールディングス	23,700	1,122.00	26,591,400
古野電気	14,400	1,043.00	15,019,200
ユニデンホールディングス	3,000	1,870.00	5,610,000
スミダコーポレーション	8,800	870.00	7,656,000
アイコム	6,000	3,015.00	18,090,000
リオン	4,700	2,380.00	11,186,000
本多通信工業	10,200	467.00	4,763,400
横河電機	99,500	1,711.00	170,244,500
新電元工業	3,900	2,644.00	10,311,600
アズビル	68,400	3,010.00	205,884,000
東亜ディーケーケー	5,800	884.00	5,127,200
日本光電工業	44,900	3,445.00	154,680,500
チノー	3,800	1,405.00	5,339,000
共和電業	11,600	411.00	4,767,600
日本電子材料	4,400	996.00	4,382,400
堀場製作所	21,500	5,890.00	126,635,000
アドバンテスト	80,600	6,070.00	489,242,000
小野測器	5,300	542.00	2,872,600
エスベック	9,900	1,828.00	18,097,200
キーエンス	98,200	44,780.00	4,397,396,000
日置電機	5,800	3,350.00	19,430,000
シスメックス	77,500	8,325.00	645,187,500
日本マイクロニクス	19,300	1,120.00	21,616,000
メガチップス	10,300	2,067.00	21,290,100
OBARA GROUP	6,500	3,455.00	22,457,500
澤藤電機	1,600	1,613.00	2,580,800
原田工業	5,600	855.00	4,788,000

コーセル	14,900	947.00	14,110,300
イリソ電子工業	9,200	3,950.00	36,340,000
オブテックスグループ	18,100	1,413.00	25,575,300
千代田インテグレ	5,300	1,772.00	9,391,600
アイ・オー・データ機器	3,900	1,025.00	3,997,500
レーザーテック	47,600	9,690.00	461,244,000
スタンレー電気	76,300	2,823.00	215,394,900
岩崎電気	4,400	2,171.00	9,552,400
ウシオ電機	60,100	1,520.00	91,352,000
岡谷電機産業	9,800	337.00	3,302,600
ハリオス テクノ ホールディング	11,200	383.00	4,289,600
エノモト	3,600	1,075.00	3,870,000
日本セラミック	11,200	2,405.00	26,936,000
遠藤照明	6,200	657.00	4,073,400
古河電池	8,400	918.00	7,711,200
双信電機	6,300	395.00	2,488,500
山一電機	8,100	1,626.00	13,170,600
図研	7,200	2,747.00	19,778,400
日本電子	21,500	2,929.00	62,973,500
カシオ計算機	95,900	1,982.00	190,073,800
ファナック	103,000	20,440.00	2,105,320,000
日本シイエムケイ	26,500	450.00	11,925,000
エンプラス	5,700	2,605.00	14,848,500
大真空	4,200	2,063.00	8,664,600
ローム	48,200	7,680.00	370,176,000
浜松ホトニクス	77,800	4,825.00	375,385,000
三井ハイテック	12,300	1,651.00	20,307,300
新光電気工業	36,700	1,432.00	52,554,400
京セラ	152,500	6,156.00	938,790,000
太陽誘電	48,300	3,415.00	164,944,500
村田製作所	318,300	6,508.00	2,071,496,400
双葉電子工業	17,600	1,012.00	17,811,200
北陸電気工業	4,800	975.00	4,680,000
ニチコン	37,300	812.00	30,287,600
日本ケミコン	8,200	1,832.00	15,022,400
K O A	16,800	1,116.00	18,748,800
市光工業	17,000	563.00	9,571,000
小糸製作所	65,000	4,825.00	313,625,000
ミツバ	20,800	522.00	10,857,600
S C R E E Nホールディングス	18,800	5,490.00	103,212,000
キヤノン電子	11,600	1,752.00	20,323,200
キヤノン	583,300	2,347.50	1,369,296,750

リコー	275,700	926.00	255,298,200
象印マホービン	32,000	1,747.00	55,904,000
MUTOHホールディングス	1,600	1,538.00	2,460,800
東京エレクトロン	68,800	23,880.00	1,642,944,000
トヨタ紡織	31,600	1,535.00	48,506,000
芦森工業	2,300	938.00	2,157,400
ユニプレス	21,000	1,076.00	22,596,000
豊田自動織機	87,700	5,920.00	519,184,000
モリタホールディングス	19,000	1,753.00	33,307,000
三櫻工業	13,800	771.00	10,639,800
デンソー	238,600	4,237.00	1,010,948,200
東海理化電機製作所	28,600	1,677.00	47,962,200
三井E & Sホールディングス	39,100	642.00	25,102,200
川崎重工業	84,300	1,925.00	162,277,500
名村造船所	34,900	183.00	6,386,700
日本車輛製造	3,900	2,822.00	11,005,800
三菱ロジスネクスト	14,300	1,092.00	15,615,600
近畿車輛	1,600	1,332.00	2,131,200
日産自動車	1,277,800	463.90	592,771,420
いすゞ自動車	313,900	1,070.00	335,873,000
トヨタ自動車	1,208,900	7,094.00	8,575,936,600
日野自動車	135,300	816.00	110,404,800
三菱自動車工業	401,000	337.00	135,137,000
エフテック	7,700	575.00	4,427,500
レシップホールディングス	4,200	577.00	2,423,400
G M B	2,000	708.00	1,416,000
ファルテック	2,000	736.00	1,472,000
武蔵精密工業	24,200	1,158.00	28,023,600
日産車体	21,200	1,028.00	21,793,600
新明和工業	29,200	1,104.00	32,236,800
極東開発工業	20,100	1,400.00	28,140,000
日信工業	22,000	2,211.00	48,642,000
トピー工業	8,900	1,465.00	13,038,500
ティラド	4,000	1,509.00	6,036,000
曙ブレーキ工業	59,500	206.00	12,257,000
タチエス	17,800	987.00	17,568,600
N O K	58,300	1,471.00	85,759,300
フタバ産業	30,200	531.00	16,036,200
K Y B	12,100	2,407.00	29,124,700
大同メタル工業	20,900	589.00	12,310,100
プレス工業	53,900	305.00	16,439,500
ミクニ	13,900	299.00	4,156,100

太平洋工業	22,700	1,106.00	25,106,200
ケーヒン	24,900	2,551.00	63,519,900
河西工業	14,700	504.00	7,408,800
アイシン精機	89,200	3,635.00	324,242,000
マツダ	318,800	815.00	259,822,000
今仙電機製作所	10,100	779.00	7,867,900
本田技研工業	853,000	3,039.00	2,592,267,000
スズキ	214,700	4,155.00	892,078,500
S U B A R U	336,400	2,593.50	872,453,400
安永	5,300	1,085.00	5,750,500
ヤマハ発動機	141,300	1,773.00	250,524,900
ショーワ	25,600	2,253.00	57,676,800
T B K	13,000	470.00	6,110,000
エクセディ	14,700	1,841.00	27,062,700
豊田合成	35,000	2,441.00	85,435,000
愛三工業	17,100	623.00	10,653,300
盟和産業	1,700	978.00	1,662,600
日本プラスト	8,600	520.00	4,472,000
ヨロズ	10,200	1,226.00	12,505,200
エフ・シー・シー	17,700	2,066.00	36,568,200
シマノ	40,500	19,730.00	799,065,000
テイ・エス テック	25,200	3,210.00	80,892,000
ジャムコ	5,500	901.00	4,955,500
テルモ	306,600	4,171.00	1,278,828,600
クリエートメディック	3,600	999.00	3,596,400
日機装	32,500	1,056.00	34,320,000
日本エム・ディ・エム	6,300	1,758.00	11,075,400
島津製作所	129,500	2,914.00	377,363,000
J M S	9,200	851.00	7,829,200
長野計器	7,900	1,025.00	8,097,500
ブイ・テクノロジー	5,100	3,950.00	20,145,000
東京計器	6,900	973.00	6,713,700
愛知時計電機	1,400	4,380.00	6,132,000
インターアクション	5,800	2,274.00	13,189,200
オーバル	9,800	237.00	2,322,600
東京精密	19,600	3,745.00	73,402,000
マニー	43,200	2,966.00	128,131,200
ニコン	165,500	1,018.00	168,479,000
トプコン	54,600	1,031.00	56,292,600
オリンパス	599,500	1,921.00	1,151,639,500
理研計器	9,600	2,473.00	23,740,800
タムロン	8,700	2,026.00	17,626,200

HOYA	216,400	10,050.00	2,174,820,000
シード	4,600	794.00	3,652,400
ノーリツ鋼機	7,300	1,515.00	11,059,500
エー・アンド・デイ	9,900	741.00	7,335,900
朝日インテック	122,700	3,065.00	376,075,500
シチズン時計	127,000	407.00	51,689,000
リズム時計工業	3,400	685.00	2,329,000
大研医器	7,500	619.00	4,642,500
メニコン	15,400	4,845.00	74,613,000
シンシア	1,200	483.00	579,600
松風	4,900	1,608.00	7,879,200
セイコーホールディングス	15,300	1,959.00	29,972,700
ニプロ	75,000	1,241.00	93,075,000
中本パックス	2,700	1,523.00	4,112,100
スノーピーク	5,800	1,084.00	6,287,200
パラマウントベッドホールディングス	11,400	4,180.00	47,652,000
トランザクション	5,900	1,085.00	6,401,500
粧美堂	3,200	363.00	1,161,600
ニホンフラッシュ	10,100	1,420.00	14,342,000
前田工織	11,900	2,468.00	29,369,200
永大産業	14,200	329.00	4,671,800
アートネイチャー	11,600	620.00	7,192,000
バンダイナムコホールディングス	112,000	6,205.00	694,960,000
アイフィスジャパン	2,800	733.00	2,052,400
共立印刷	18,100	145.00	2,624,500
SHOEI	9,500	2,517.00	23,911,500
フランスベッドホールディングス	15,300	874.00	13,372,200
パイロットコーポレーション	17,700	3,670.00	64,959,000
萩原工業	6,000	1,448.00	8,688,000
トッパン・フォームズ	23,200	1,124.00	26,076,800
フジシールインターナショナル	24,300	2,165.00	52,609,500
タカラトミー	48,600	937.00	45,538,200
廣済堂	7,500	847.00	6,352,500
エステールホールディングス	2,900	620.00	1,798,000
アーク	41,400	126.00	5,216,400
タカノ	4,200	760.00	3,192,000
プロネクサス	9,300	1,196.00	11,122,800
ホクシン	6,700	130.00	871,000
ウッドワン	3,600	1,170.00	4,212,000
大建工業	7,300	1,756.00	12,818,800
凸版印刷	152,900	1,941.00	296,778,900
大日本印刷	141,800	2,637.00	373,926,600

共同印刷	3,300	2,960.00	9,768,000
N I S S H A	22,200	1,075.00	23,865,000
光村印刷	900	1,499.00	1,349,100
T A K A R A & C O M P A N Y	5,200	1,916.00	9,963,200
アシックス	89,400	1,380.00	123,372,000
ツツミ	3,400	1,848.00	6,283,200
小松ウオール工業	3,300	1,889.00	6,233,700
ヤマハ	64,400	5,650.00	363,860,000
河合楽器製作所	3,300	2,823.00	9,315,900
クリナップ	10,100	556.00	5,615,600
ピジョン	65,500	4,120.00	269,860,000
オリバー	2,300	2,965.00	6,819,500
兼松サステック	700	1,434.00	1,003,800
キングジム	9,000	954.00	8,586,000
リンテック	25,800	2,624.00	67,699,200
イトーキ	23,000	388.00	8,924,000
任天堂	66,400	45,340.00	3,010,576,000
三菱鉛筆	17,800	1,525.00	27,145,000
タカラスタANDARD	22,400	1,557.00	34,876,800
コクヨ	52,000	1,333.00	69,316,000
ナカバヤシ	10,700	603.00	6,452,100
グローブライド	4,800	2,336.00	11,212,800
オカムラ	37,800	843.00	31,865,400
美津濃	9,800	2,167.00	21,236,600
東京電力ホールディングス	864,900	373.00	322,607,700
中部電力	331,500	1,411.50	467,912,250
関西電力	410,500	1,126.50	462,428,250
中国電力	156,300	1,464.00	228,823,200
北陸電力	99,100	728.00	72,144,800
東北電力	270,700	1,094.00	296,145,800
四国電力	97,600	839.00	81,886,400
九州電力	223,300	925.00	206,552,500
北海道電力	101,400	453.00	45,934,200
沖縄電力	21,025	1,884.00	39,611,100
電源開発	86,200	2,109.00	181,795,800
エフオン	5,800	610.00	3,538,000
イーレックス	15,400	1,482.00	22,822,800
レノバ	18,100	975.00	17,647,500
東京瓦斯	208,400	2,562.50	534,025,000
大阪瓦斯	210,200	2,121.00	445,834,200
東邦瓦斯	53,300	5,260.00	280,358,000
北海道瓦斯	5,800	1,604.00	9,303,200

広島ガス	22,300	358.00	7,983,400	
西部瓦斯	12,200	2,590.00	31,598,000	
静岡ガス	30,800	997.00	30,707,600	
メタウォーター	5,200	4,760.00	24,752,000	
SBSホールディングス	9,400	2,380.00	22,372,000	
東武鉄道	112,900	3,865.00	436,358,500	
相鉄ホールディングス	34,700	3,005.00	104,273,500	
東急	273,200	1,721.00	470,177,200	
京浜急行電鉄	139,100	1,789.00	248,849,900	
小田急電鉄	161,100	2,677.00	431,264,700	
京王電鉄	56,200	6,350.00	356,870,000	
京成電鉄	75,400	3,690.00	278,226,000	
富士急行	14,800	3,425.00	50,690,000	
新京成電鉄	2,800	2,200.00	6,160,000	
東日本旅客鉄道	190,700	8,618.00	1,643,452,600	
西日本旅客鉄道	96,500	6,807.00	656,875,500	
東海旅客鉄道	90,100	18,715.00	1,686,221,500	
西武ホールディングス	145,400	1,393.00	202,542,200	
鴻池運輸	17,200	1,234.00	21,224,800	
西日本鉄道	30,000	2,940.00	88,200,000	
ハマキョウレックス	8,300	3,250.00	26,975,000	
サカイ引越センター	5,700	6,020.00	34,314,000	
近鉄グループホールディングス	102,600	5,240.00	537,624,000	
阪急阪神ホールディングス	136,900	3,935.00	538,701,500	
南海電気鉄道	48,600	2,644.00	128,498,400	
京阪ホールディングス	45,700	5,050.00	230,785,000	
神戸電鉄	2,400	3,715.00	8,916,000	
名古屋鉄道	84,400	3,235.00	273,034,000	
山陽電気鉄道	7,300	2,248.00	16,410,400	
日本通運	35,500	5,960.00	211,580,000	
ヤマトホールディングス	179,900	2,463.00	443,093,700	
山九	28,500	4,410.00	125,685,000	
丸運	5,800	249.00	1,444,200	
丸全昭和運輸	8,300	2,969.00	24,642,700	
センコーグループホールディングス	56,600	821.00	46,468,600	
トナミホールディングス	2,500	6,470.00	16,175,000	
ニッコンホールディングス	36,700	2,316.00	84,997,200	
日本石油輸送	1,100	3,080.00	3,388,000	
福山通運	13,100	3,805.00	49,845,500	
セイノーホールディングス	76,800	1,492.00	114,585,600	
エスライン	3,100	996.00	3,087,600	
神奈川中央交通	2,500	4,220.00	10,550,000	

日立物流	18,800	2,929.00	55,065,200
丸和運輸機関	10,800	2,874.00	31,039,200
C & F ロジホールディングス	10,400	1,540.00	16,016,000
九州旅客鉄道	90,000	3,105.00	279,450,000
S Gホールディングス	107,700	3,460.00	372,642,000
日本郵船	86,300	1,627.00	140,410,100
商船三井	65,300	2,085.00	136,150,500
川崎汽船	31,600	1,161.00	36,687,600
N S ユナイテッド海運	6,100	1,598.00	9,747,800
飯野海運	50,700	354.00	17,947,800
共栄タンカー	2,600	856.00	2,225,600
乾汽船	5,900	1,032.00	6,088,800
日本航空	181,500	2,403.00	436,144,500
A N Aホールディングス	187,600	2,832.00	531,283,200
パスコ	2,000	1,587.00	3,174,000
ランコム	2,900	7,190.00	20,851,000
日新	8,900	1,671.00	14,871,900
三菱倉庫	32,500	2,944.00	95,680,000
三井倉庫ホールディングス	11,700	1,593.00	18,638,100
住友倉庫	36,900	1,389.00	51,254,100
澁澤倉庫	5,600	2,125.00	11,900,000
東陽倉庫	18,500	335.00	6,197,500
日本トランスシティ	22,600	541.00	12,226,600
ケイヒン	2,000	1,315.00	2,630,000
中央倉庫	6,300	1,030.00	6,489,000
川西倉庫	1,900	1,028.00	1,953,200
安田倉庫	8,400	907.00	7,618,800
ファイズホールディングス	2,200	1,165.00	2,563,000
東洋埠頭	3,100	1,393.00	4,318,300
宇徳	8,800	522.00	4,593,600
上組	57,300	2,196.00	125,830,800
サンリツ	2,400	604.00	1,449,600
キムラユニティー	2,700	1,030.00	2,781,000
キューソー流通システム	2,600	1,713.00	4,453,800
近鉄エクスプレス	21,800	1,822.00	39,719,600
東海運	5,800	271.00	1,571,800
エーアイティー	7,200	812.00	5,846,400
内外トランスライン	3,600	1,047.00	3,769,200
日本コンセプト	3,300	1,430.00	4,719,000
N E C ネットズエスアイ	30,300	1,993.00	60,387,900
クロスキャット	3,000	1,184.00	3,552,000
システナ	38,100	1,576.00	60,045,600

デジタルアーツ	5,300	8,660.00	45,898,000
日鉄ソリューションズ	16,000	2,989.00	47,824,000
キューブシステム	6,000	795.00	4,770,000
エイジア	2,100	1,388.00	2,914,800
コア	4,700	1,246.00	5,856,200
ラクーンホールディングス	5,100	874.00	4,457,400
ソリトンシステムズ	4,800	1,606.00	7,708,800
ソフトクリエイティブホールディングス	4,800	2,215.00	10,632,000
T I S	106,400	2,259.00	240,357,600
ネオス	4,200	770.00	3,234,000
電算システム	4,100	3,515.00	14,411,500
グリー	65,800	461.00	30,333,800
コーエーテクモホールディングス	21,800	3,230.00	70,414,000
三菱総合研究所	4,600	4,090.00	18,814,000
電算	1,300	2,218.00	2,883,400
A G S	6,300	814.00	5,128,200
ファインデックス	9,200	993.00	9,135,600
ブレインパッド	2,800	5,080.00	14,224,000
K L a b	20,600	774.00	15,944,400
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	13,100	945.00	12,379,500
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	2,588.00	4,140,800
ネクソン	296,700	2,319.00	688,047,300
アイスタイル	30,600	328.00	10,036,800
エムアップホールディングス	3,200	2,518.00	8,057,600
エイチーム	7,600	811.00	6,163,600
エニグモ	10,300	1,038.00	10,691,400
テクノスジャパン	8,700	607.00	5,280,900
コロプラ	35,100	1,047.00	36,749,700
ブロードリーフ	53,200	559.00	29,738,800
クロス・マーケティンググループ	5,400	365.00	1,971,000
デジタルハーツホールディングス	5,900	911.00	5,374,900
システム情報	8,200	1,343.00	11,012,600
メディアドゥ	3,400	4,490.00	15,266,000
じげん	27,000	400.00	10,800,000
エンカレッジ・テクノロジー	2,600	859.00	2,233,400
サイバーリンクス	1,800	1,728.00	3,110,400
フィックスターズ	11,500	1,406.00	16,169,000
C A R T A H O L D I N G S	5,400	1,196.00	6,458,400
オブティム	5,700	3,005.00	17,128,500
セレス	3,700	1,301.00	4,813,700
S H I F T	4,300	10,580.00	45,494,000
ティーガイア	9,500	2,165.00	20,567,500

セック	1,600	3,435.00	5,496,000
日本アジアグループ	11,200	332.00	3,718,400
テクマトリックス	7,600	3,680.00	27,968,000
プロシップ	3,300	1,360.00	4,488,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	25,800	1,869.00	48,220,200
GMOペイメントゲートウェイ	22,500	11,250.00	253,125,000
ザッパラス	5,300	401.00	2,125,300
システムリサーチ	2,900	2,050.00	5,945,000
インターネットイニシアティブ	15,800	3,905.00	61,699,000
さくらインターネット	11,800	658.00	7,764,400
ヴィンクス	3,200	1,221.00	3,907,200
GMOクラウド	2,000	6,890.00	13,780,000
SRAホールディングス	5,700	2,491.00	14,198,700
システムインテグレータ	3,600	912.00	3,283,200
朝日ネット	7,700	1,392.00	10,718,400
eBASE	12,900	1,310.00	16,899,000
アバント	10,300	1,183.00	12,184,900
アドソル日進	3,900	2,558.00	9,976,200
フリービット	5,800	879.00	5,098,200
コムチュア	12,000	2,814.00	33,768,000
サイバーコム	2,000	1,894.00	3,788,000
アステリア	7,000	551.00	3,857,000
アイル	6,000	1,806.00	10,836,000
マークラインズ	5,500	2,101.00	11,555,500
メディカル・データ・ビジョン	8,300	1,122.00	9,312,600
ショーケース	2,900	658.00	1,908,200
モバイルファクトリー	2,600	1,215.00	3,159,000
テラスカイ	3,900	3,030.00	11,817,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,300	1,527.00	6,566,100
PCIホールディングス	4,200	1,352.00	5,678,400
パイプドHD	1,500	1,610.00	2,415,000
アイビーシー	1,900	1,041.00	1,977,900
ネオジャパン	2,200	1,527.00	3,359,400
PR TIMES	1,000	2,692.00	2,692,000
ランドコンピュータ	1,800	1,115.00	2,007,000
ダブルスタンダード	1,400	4,575.00	6,405,000
オープンドア	5,400	1,327.00	7,165,800
マイネット	3,400	1,109.00	3,770,600
アカツキ	3,800	4,250.00	16,150,000
ベネフィットジャパン	900	1,650.00	1,485,000
Ubicomホールディングス	2,500	1,878.00	4,695,000
LINE	24,400	5,360.00	130,784,000

カナミックネットワーク	10,000	924.00	9,240,000	
ノムラシステムコーポレーション	2,800	534.00	1,495,200	
チェンジ	3,800	5,770.00	21,926,000	
シンクロ・フード	5,200	371.00	1,929,200	
オークネット	6,800	1,096.00	7,452,800	
セグエグループ	2,600	897.00	2,332,200	
エイトレッド	1,900	1,985.00	3,771,500	
AOI TYO Holdings	11,300	495.00	5,593,500	
マクロミル	22,000	829.00	18,238,000	
ビーグリー	2,200	1,639.00	3,605,800	
オロ	2,900	2,845.00	8,250,500	
ユーザーローカル	1,100	3,550.00	3,905,000	
テモナ	2,600	856.00	2,225,600	
ニーズウェル	2,300	726.00	1,669,800	
サインポスト	2,300	1,919.00	4,413,700	
ソルクシーズ	4,900	754.00	3,694,600	
フェイス	4,100	700.00	2,870,000	
プロトコーポレーション	9,800	1,093.00	10,711,400	
ハイマックス	1,400	1,976.00	2,766,400	
野村総合研究所	150,800	2,784.00	419,827,200	
サイバネットシステム	7,900	703.00	5,553,700	
CEホールディングス	6,100	502.00	3,062,200	
日本システム技術	1,900	1,495.00	2,840,500	
インテージホールディングス	13,600	886.00	12,049,600	
東邦システムサイエンス	3,100	925.00	2,867,500	
ソースネクスト	51,200	320.00	16,384,000	
インフォコム	11,700	3,120.00	36,504,000	
HEROZ	1,600	4,250.00	6,800,000	
ラクスル	8,600	2,668.00	22,944,800	
FIG	12,400	294.00	3,645,600	
システムサポート	2,500	2,349.00	5,872,500	
イーソル	5,200	1,451.00	7,545,200	
アルテリア・ネットワークス	11,900	2,005.00	23,859,500	
東海ソフト	900	1,375.00	1,237,500	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,000	1,083.00	2,166,000	
トピラシステムズ	1,400	2,157.00	3,019,800	
フォーカスシステムズ	6,900	888.00	6,127,200	
クレスコ	6,600	1,552.00	10,243,200	
フジ・メディア・ホールディングス	102,600	1,148.00	117,784,800	
オービック	36,900	18,220.00	672,318,000	
ジャストシステム	17,300	7,520.00	130,096,000	
TDCソフト	9,600	998.00	9,580,800	

Zホールディングス	1,460,600	453.00	661,651,800
トレンドマイクロ	47,300	6,210.00	293,733,000
IDホールディングス	4,200	1,499.00	6,295,800
日本オラクル	21,600	12,350.00	266,760,000
アルファシステムズ	3,400	4,080.00	13,872,000
フューチャー	13,000	1,811.00	23,543,000
CAC Holdings	7,100	1,351.00	9,592,100
SBテクノロジー	3,900	2,815.00	10,978,500
トーセ	3,200	851.00	2,723,200
オービックビジネスコンサルタント	10,900	6,070.00	66,163,000
伊藤忠テクノソリューションズ	48,500	3,760.00	182,360,000
アイティフォー	13,200	727.00	9,596,400
東計電算	1,600	4,105.00	6,568,000
エクスネット	1,900	999.00	1,898,100
大塚商会	57,600	5,450.00	313,920,000
サイボウズ	12,500	3,170.00	39,625,000
ソフトブレーン	6,800	525.00	3,570,000
電通国際情報サービス	6,600	5,000.00	33,000,000
ACCESS	10,200	1,154.00	11,770,800
デジタルガレージ	19,200	3,850.00	73,920,000
EMシステムズ	15,300	899.00	13,754,700
ウェザーニューズ	3,700	3,775.00	13,967,500
CIJ	7,500	928.00	6,960,000
ビジネスエンジニアリング	1,300	2,864.00	3,723,200
日本エンタープライズ	11,800	281.00	3,315,800
WOWOW	5,200	2,543.00	13,223,600
スカラ	7,400	779.00	5,764,600
インテリジェント ウェイブ	6,500	816.00	5,304,000
IMAGICA GROUP	9,600	428.00	4,108,800
ネットワンシステムズ	40,600	3,400.00	138,040,000
システムソフト	25,300	101.00	2,555,300
アルゴグラフィックス	9,100	3,680.00	33,488,000
マーベラス	16,600	772.00	12,815,200
エイベックス	18,500	937.00	17,334,500
日本ユニシス	33,300	3,385.00	112,720,500
兼松エレクトロニクス	5,800	3,810.00	22,098,000
東京放送ホールディングス	64,800	1,800.00	116,640,000
日本テレビホールディングス	88,900	1,265.00	112,458,500
朝日放送グループホールディングス	10,800	812.00	8,769,600
テレビ朝日ホールディングス	29,400	1,665.00	48,951,000
スカパーJSATホールディングス	70,500	459.00	32,359,500
テレビ東京ホールディングス	8,800	2,504.00	22,035,200

日本BS放送	3,800	1,140.00	4,332,000
ビジョン	10,200	875.00	8,925,000
スマートバリュー	3,000	1,152.00	3,456,000
ワイヤレスゲート	5,400	720.00	3,888,000
コネクシオ	6,200	1,470.00	9,114,000
クロップス	2,300	745.00	1,713,500
日本電信電話	1,421,200	2,512.00	3,570,054,400
KDDI	792,400	3,191.00	2,528,548,400
ソフトバンク	966,400	1,374.00	1,327,833,600
光通信	11,000	25,060.00	275,660,000
NTTドコモ	760,300	2,890.00	2,197,267,000
エムティーアイ	10,700	619.00	6,623,300
GMOインターネット	42,000	2,837.00	119,154,000
ファイバーゲート	3,600	1,505.00	5,418,000
アйдママーケティングコミュニケーション	3,600	566.00	2,037,600
KADOKAWA	28,800	1,777.00	51,177,600
学研ホールディングス	14,400	1,557.00	22,420,800
ゼンリン	21,400	1,360.00	29,104,000
昭文社ホールディングス	5,500	424.00	2,332,000
インプレスホールディングス	8,800	154.00	1,355,200
アイネット	5,600	1,513.00	8,472,800
松竹	7,100	14,890.00	105,719,000
東宝	62,800	4,060.00	254,968,000
東映	4,000	14,600.00	58,400,000
エヌ・ティ・ティ・データ	283,300	1,322.00	374,522,600
ピー・シー・エー	1,900	4,510.00	8,569,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,900	2,691.00	5,112,900
DTS	23,900	2,383.00	56,953,700
スクウェア・エニックス・ホールディングス	45,400	5,460.00	247,884,000
シーイーシー	11,500	1,937.00	22,275,500
カブコン	50,200	3,930.00	197,286,000
アイ・エス・ビー	2,200	2,158.00	4,747,600
ジャステック	7,000	1,216.00	8,512,000
SCSK	24,600	5,510.00	135,546,000
日本システムウエア	3,600	2,348.00	8,452,800
アイネス	10,600	1,357.00	14,384,200
TKC	9,000	5,730.00	51,570,000
富士ソフト	13,700	4,410.00	60,417,000
NSD	34,300	1,735.00	59,510,500
コナミホールディングス	38,700	3,905.00	151,123,500
福井コンピュータホールディングス	4,300	2,885.00	12,405,500
JBCCHホールディングス	7,300	1,639.00	11,964,700

ミロク情報サービス	9,500	2,523.00	23,968,500
ソフトバンクグループ	843,600	5,355.00	4,517,478,000
ハウスイ	900	924.00	831,600
高千穂交易	4,100	982.00	4,026,200
カワニシホールディングス	1,300	1,487.00	1,933,100
伊藤忠食品	2,600	5,210.00	13,546,000
エレマテック	10,000	927.00	9,270,000
JALUX	3,000	1,895.00	5,685,000
あらた	8,500	4,590.00	39,015,000
トーメンデバイス	1,600	3,540.00	5,664,000
東京エレクトロン デバイス	3,900	2,870.00	11,193,000
フィールズ	8,200	370.00	3,034,000
双日	589,400	261.00	153,833,400
アルフレッサ ホールディングス	118,600	2,260.00	268,036,000
横浜冷凍	27,900	914.00	25,500,600
ラサ商事	5,700	915.00	5,215,500
アルコニックス	11,300	1,273.00	14,384,900
神戸物産	36,800	6,220.00	228,896,000
ハイパー	1,600	614.00	982,400
あい ホールディングス	15,200	1,569.00	23,848,800
ディーブイエックス	3,800	878.00	3,336,400
ダイワボウホールディングス	9,100	7,890.00	71,799,000
マクニカ・富士エレホールディングス	25,500	1,674.00	42,687,000
ラクト・ジャパン	4,000	3,900.00	15,600,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,100	1,074.00	21,587,400
八洲電機	8,300	903.00	7,494,900
メディアスホールディングス	6,100	983.00	5,996,300
レスターホールディングス	11,100	2,267.00	25,163,700
ジュテックホールディングス	2,500	994.00	2,485,000
大光	4,600	688.00	3,164,800
OCHIホールディングス	3,100	1,482.00	4,594,200
TOKAIホールディングス	56,400	990.00	55,836,000
黒谷	2,900	491.00	1,423,900
Cominix	1,900	733.00	1,392,700
三洋貿易	10,800	1,083.00	11,696,400
ビューティガレージ	1,700	1,744.00	2,964,800
ウイン・パートナーズ	7,700	1,006.00	7,746,200
ミタチ産業	3,200	610.00	1,952,000
シップヘルスケアホールディングス	17,100	4,510.00	77,121,000
明治電機工業	3,400	1,438.00	4,889,200
デリカフーズホールディングス	3,800	638.00	2,424,400
スターティアホールディングス	2,400	728.00	1,747,200

コメダホールディングス	23,300	1,924.00	44,829,200
ピーバンドットコム	1,100	1,010.00	1,111,000
アセンテック	1,100	3,475.00	3,822,500
富士興産	3,300	509.00	1,679,700
協栄産業	1,200	1,256.00	1,507,200
小野建	9,600	1,269.00	12,182,400
南陽	2,400	1,494.00	3,585,600
佐島電機	7,300	883.00	6,445,900
エコートレーディング	2,500	528.00	1,320,000
伯東	6,500	1,072.00	6,968,000
コンドーテック	8,300	1,148.00	9,528,400
中山福	6,200	533.00	3,304,600
ナガイレーベン	14,200	2,644.00	37,544,800
三菱食品	11,700	2,891.00	33,824,700
松田産業	7,800	1,391.00	10,849,800
第一興商	15,900	3,970.00	63,123,000
メディカルホールディングス	115,200	2,178.00	250,905,600
S P K	4,600	1,445.00	6,647,000
萩原電気ホールディングス	4,000	2,251.00	9,004,000
アズワン	7,000	11,580.00	81,060,000
スズデン	3,700	1,187.00	4,391,900
尾家産業	3,100	1,510.00	4,681,000
シモジマ	6,500	1,287.00	8,365,500
ドウシシャ	10,100	1,567.00	15,826,700
小津産業	2,400	1,783.00	4,279,200
高速	6,400	1,480.00	9,472,000
たけびし	3,700	1,495.00	5,531,500
リックス	2,400	1,550.00	3,720,000
丸文	9,500	510.00	4,845,000
ハビネット	8,900	1,164.00	10,359,600
橋本総業ホールディングス	2,200	1,941.00	4,270,200
日本ライフライン	31,600	1,465.00	46,294,000
タカショー	7,000	475.00	3,325,000
マルカ	3,800	1,855.00	7,049,000
I D O M	28,800	519.00	14,947,200
進和	6,300	2,045.00	12,883,500
エスケイジャパン	2,300	334.00	768,200
ダイトロン	4,500	1,810.00	8,145,000
シークス	13,600	1,147.00	15,599,200
田中商事	3,300	706.00	2,329,800
オーハシテクニカ	6,000	1,659.00	9,954,000
白銅	3,800	1,390.00	5,282,000

伊藤忠商事	746,400	2,353.00	1,756,279,200
丸紅	1,110,700	549.20	609,996,440
高島	1,700	1,800.00	3,060,000
長瀬産業	60,000	1,375.00	82,500,000
蝶理	6,800	1,998.00	13,586,400
豊田通商	119,100	3,015.00	359,086,500
三共生興	16,200	471.00	7,630,200
兼松	39,800	1,343.00	53,451,400
ツカモトコーポレーション	1,900	1,136.00	2,158,400
三井物産	923,900	1,748.00	1,614,977,200
日本紙パルプ商事	6,100	4,110.00	25,071,000
カメイ	13,900	1,065.00	14,803,500
東都水産	1,400	3,400.00	4,760,000
OUGホールディングス	1,700	2,677.00	4,550,900
スターゼン	3,900	4,525.00	17,647,500
山善	41,700	928.00	38,697,600
椿本興業	2,000	3,730.00	7,460,000
住友商事	673,300	1,333.00	897,508,900
内田洋行	4,200	6,950.00	29,190,000
三菱商事	748,800	2,491.50	1,865,635,200
第一実業	5,200	3,865.00	20,098,000
キャノンマーケティングジャパン	26,500	2,330.00	61,745,000
西華産業	6,100	1,298.00	7,917,800
佐藤商事	8,800	943.00	8,298,400
菱洋エレクトロ	10,800	2,710.00	29,268,000
東京産業	9,700	566.00	5,490,200
ユアサ商事	10,100	3,065.00	30,956,500
神鋼商事	2,700	1,999.00	5,397,300
トルク	6,400	340.00	2,176,000
阪和興業	19,900	2,006.00	39,919,400
正栄食品工業	6,900	4,440.00	30,636,000
カナデン	8,700	1,300.00	11,310,000
菱電商事	7,700	1,537.00	11,834,900
フルサト工業	5,900	1,511.00	8,914,900
岩谷産業	23,700	3,765.00	89,230,500
ナイス	4,500	830.00	3,735,000
昭光通商	3,400	634.00	2,155,600
二チモウ	1,700	1,817.00	3,088,900
極東貿易	3,100	1,605.00	4,975,500
イワキ	14,000	478.00	6,692,000
三愛石油	26,300	1,099.00	28,903,700
稲畑産業	23,500	1,326.00	31,161,000

G S I クレオス	2,600	1,233.00	3,205,800
明和産業	9,900	489.00	4,841,100
クワザワ	3,800	523.00	1,987,400
ヤマエ久野	7,800	1,259.00	9,820,200
ワキタ	22,800	998.00	22,754,400
東邦ホールディングス	34,200	2,091.00	71,512,200
サンゲツ	29,100	1,578.00	45,919,800
ミツウロコグループホールディングス	15,700	1,153.00	18,102,100
シナネンホールディングス	4,400	2,679.00	11,787,600
伊藤忠エネクス	23,600	868.00	20,484,800
サンリオ	30,000	1,932.00	57,960,000
サンワテクノス	7,600	876.00	6,657,600
リョーサン	11,800	2,416.00	28,508,800
新光商事	16,700	899.00	15,013,300
トーホー	4,800	1,896.00	9,100,800
三信電気	5,700	1,769.00	10,083,300
東陽テクニカ	11,400	1,075.00	12,255,000
モスフードサービス	14,000	2,939.00	41,146,000
加賀電子	10,600	2,181.00	23,118,600
ソーダニッカ	11,000	538.00	5,918,000
立花エレテック	7,900	1,740.00	13,746,000
フォーバル	4,700	1,116.00	5,245,200
P A L T A C	17,100	5,000.00	85,500,000
三谷産業	14,100	374.00	5,273,400
西本W i s m e t t a cホールディングス	1,900	2,135.00	4,056,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,000	1,908.00	1,908,000
国際紙パルプ商事	25,300	304.00	7,691,200
ヤマタネ	5,400	1,252.00	6,760,800
丸紅建材リース	1,100	1,593.00	1,752,300
日鉄物産	7,600	3,740.00	28,424,000
泉州電業	3,300	2,826.00	9,325,800
トラスコ中山	22,200	2,655.00	58,941,000
オートバックスセブン	39,600	1,457.00	57,697,200
モリト	7,800	729.00	5,686,200
加藤産業	15,400	3,795.00	58,443,000
北恵	2,700	954.00	2,575,800
イノテック	5,500	1,111.00	6,110,500
イエローハット	20,200	1,510.00	30,502,000
J Kホールディングス	9,700	865.00	8,390,500
日伝	9,700	2,293.00	22,242,100
北沢産業	8,100	290.00	2,349,000
杉本商事	5,800	1,904.00	11,043,200

因幡電機産業	30,400	2,502.00	76,060,800
東テク	3,500	2,266.00	7,931,000
ミスミグループ本社	133,800	2,943.00	393,773,400
アルテック	8,500	240.00	2,040,000
タキヒヨー	3,200	1,800.00	5,760,000
蔵王産業	2,100	1,459.00	3,063,900
スズケン	45,200	4,020.00	181,704,000
ジェコス	7,400	989.00	7,318,600
グローセル	10,700	455.00	4,868,500
ローソン	27,000	5,940.00	160,380,000
サンエー	8,900	4,300.00	38,270,000
カワチ薬品	8,300	2,669.00	22,152,700
エービーシー・マート	16,700	6,620.00	110,554,000
ハードオフコーポレーション	4,400	760.00	3,344,000
アスクル	11,200	3,770.00	42,224,000
ゲオホールディングス	19,300	1,375.00	26,537,500
アダストリア	14,900	1,803.00	26,864,700
ジーフット	6,400	503.00	3,219,200
くら寿司	5,600	4,990.00	27,944,000
キャンドゥ	5,200	1,927.00	10,020,400
パルグループホールディングス	11,000	1,414.00	15,554,000
エディオン	49,100	1,011.00	49,640,100
サーラコーポレーション	21,900	598.00	13,096,200
ワッツ	4,900	896.00	4,390,400
ハローズ	4,100	3,340.00	13,694,000
フジオフードシステム	9,100	1,601.00	14,569,100
あみやき亭	2,400	3,230.00	7,752,000
ひらまつ	19,600	198.00	3,880,800
大黒天物産	2,600	4,505.00	11,713,000
ハニーズホールディングス	9,500	1,196.00	11,362,000
ファーマライズホールディングス	2,800	675.00	1,890,000
アルペン	8,300	1,851.00	15,363,300
ハブ	3,300	740.00	2,442,000
クオールホールディングス	15,900	1,242.00	19,747,800
ジinzホールディングス	5,700	6,850.00	39,045,000
ビックカメラ	63,400	1,167.00	73,987,800
D C Mホールディングス	59,300	1,114.00	66,060,200
Monotaro	75,900	4,015.00	304,738,500
東京一番フーズ	3,000	512.00	1,536,000
D Dホールディングス	4,200	1,024.00	4,300,800
きちりホールディングス	3,100	656.00	2,033,600
アーランドサービスホールディングス	7,900	1,960.00	15,484,000

J・フロント リテイリング	127,600	956.00	121,985,600
ドトール・日レスホールディングス	15,400	1,832.00	28,212,800
マツモトキヨシホールディングス	44,200	3,845.00	169,949,000
ブロンコピリー	5,600	2,618.00	14,660,800
Z O Z O	73,500	2,344.00	172,284,000
トレジャー・ファクトリー	3,400	780.00	2,652,000
物語コーポレーション	2,900	8,750.00	25,375,000
ココカラファイン	11,200	5,800.00	64,960,000
三越伊勢丹ホールディングス	186,800	739.00	138,045,200
H a m e e	3,900	1,605.00	6,259,500
ウエルシアホールディングス	31,800	8,800.00	279,840,000
クリエイティブSDホールディングス	18,000	3,515.00	63,270,000
丸善C H Iホールディングス	12,500	396.00	4,950,000
ティーライフ	1,700	1,101.00	1,871,700
チムニー	3,300	1,833.00	6,048,900
シュッピン	7,500	854.00	6,405,000
オイシックス・ラ・大地	10,600	2,154.00	22,832,400
ネクステージ	15,500	902.00	13,981,000
ジョイフル本田	31,400	1,384.00	43,457,600
鳥貴族	3,200	1,795.00	5,744,000
麒麟堂ホールディングス	4,300	2,245.00	9,653,500
ホットランド	7,200	1,271.00	9,151,200
すかいらーくホールディングス	119,700	1,808.00	216,417,600
S F Pホールディングス	6,200	1,707.00	10,583,400
綿半ホールディングス	4,100	1,875.00	7,687,500
ヨシックス	1,800	2,312.00	4,161,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	31,200	1,139.00	35,536,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,200	591.00	3,073,200
B E E N O S	5,100	1,076.00	5,487,600
あさひ	8,100	1,459.00	11,817,900
日本調剤	6,600	1,715.00	11,319,000
コスモス薬品	9,400	16,120.00	151,528,000
トーエル	5,400	736.00	3,974,400
オンリー	2,100	621.00	1,304,100
セブン&アイ・ホールディングス	417,500	3,889.00	1,623,657,500
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	57,600	824.00	47,462,400
ツルハホールディングス	23,200	15,930.00	369,576,000
サンマルクホールディングス	8,500	1,861.00	15,818,500
フェリシモ	2,500	1,080.00	2,700,000
トリドールホールディングス	26,500	1,279.00	33,893,500
T O K Y O B A S E	10,100	397.00	4,009,700

ウイルプラスホールディングス	1,600	757.00	1,211,200
J Mホールディングス	8,100	2,698.00	21,853,800
サツドラホールディングス	1,700	2,027.00	3,445,900
アレンザホールディングス	5,500	935.00	5,142,500
串カツ田中ホールディングス	2,300	1,745.00	4,013,500
パロックジャパンリミテッド	7,700	691.00	5,320,700
クスリのアオキホールディングス	9,600	8,800.00	84,480,000
力の源ホールディングス	5,100	764.00	3,896,400
スシログローバルホールディングス	58,600	2,390.00	140,054,000
L I X I L ビバ	10,600	2,593.00	27,485,800
メディカルシステムネットワーク	10,700	506.00	5,414,200
はるやまホールディングス	5,200	778.00	4,045,600
ノジマ	19,000	2,478.00	47,082,000
カッパ・クリエイト	15,000	1,505.00	22,575,000
ライトオン	8,000	587.00	4,696,000
良品計画	141,800	1,587.00	225,036,600
三城ホールディングス	11,900	298.00	3,546,200
アドヴァン	16,400	1,340.00	21,976,000
アルビス	4,100	2,157.00	8,843,700
コナカ	13,100	329.00	4,309,900
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,613.00	2,258,200
G - 7ホールディングス	6,400	2,468.00	15,795,200
イオン北海道	14,200	800.00	11,360,000
コジマ	18,700	513.00	9,593,100
ヒマラヤ	3,900	822.00	3,205,800
コーナン商事	15,200	3,130.00	47,576,000
エコス	4,000	1,901.00	7,604,000
ワタミ	12,800	1,048.00	13,414,400
マルシェ	3,100	649.00	2,011,900
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	234,600	2,208.00	517,996,800
西松屋チェーン	23,600	948.00	22,372,800
ゼンショーホールディングス	51,200	2,280.00	116,736,000
幸楽苑ホールディングス	6,900	1,616.00	11,150,400
ハークスレイ	2,400	1,018.00	2,443,200
サイゼリヤ	15,900	2,264.00	35,997,600
V Tホールディングス	44,700	348.00	15,555,600
魚力	3,100	1,590.00	4,929,000
フジ・コーポレーション	2,900	2,065.00	5,988,500
ユナイテッドアローズ	11,300	2,108.00	23,820,400
ハイデイ日高	15,500	1,902.00	29,481,000
京都きもの友禅	7,500	235.00	1,762,500
コロワイド	35,500	1,697.00	60,243,500

ピーシーデポコーポレーション	14,400	701.00	10,094,400	
壱番屋	7,500	5,410.00	40,575,000	
P L A N T	3,000	598.00	1,794,000	
スギホールディングス	21,300	7,000.00	149,100,000	
薬王堂ホールディングス	4,700	2,558.00	12,022,600	
スクロール	16,900	381.00	6,438,900	
ヨンドシーホールディングス	10,900	1,955.00	21,309,500	
ファミリーマート	85,300	2,103.00	179,385,900	
木曽路	14,000	2,568.00	35,952,000	
S R S ホールディングス	12,800	926.00	11,852,800	
タカキュー	8,200	149.00	1,221,800	
リテールパートナーズ	14,200	1,611.00	22,876,200	
ケーヨー	22,100	652.00	14,409,200	
上新電機	12,600	2,174.00	27,392,400	
日本瓦斯	16,900	4,420.00	74,698,000	
ロイヤルホールディングス	18,700	2,034.00	38,035,800	
いなげや	13,300	1,660.00	22,078,000	
島忠	20,100	2,901.00	58,310,100	
チヨダ	11,300	1,159.00	13,096,700	
ライフコーポレーション	8,100	3,365.00	27,256,500	
リンガーハット	13,200	2,446.00	32,287,200	
M r M a x H D	15,000	491.00	7,365,000	
テンアライド	9,800	393.00	3,851,400	
A O K I ホールディングス	21,600	699.00	15,098,400	
オークワ	16,800	1,551.00	26,056,800	
コメリ	16,500	2,626.00	43,329,000	
青山商事	22,200	882.00	19,580,400	
しまむら	12,400	7,730.00	95,852,000	
はせがわ	6,100	345.00	2,104,500	
高島屋	77,800	1,047.00	81,456,600	
松屋	21,700	707.00	15,341,900	
エイチ・ツー・オー リテイリング	50,700	849.00	43,044,300	
近鉄百貨店	4,100	3,440.00	14,104,000	
丸井グループ	97,900	2,139.00	209,408,100	
アクシアル リテイリング	8,900	4,215.00	37,513,500	
イオン	410,700	2,419.50	993,688,650	
イズミ	21,700	3,450.00	74,865,000	
平和堂	21,700	1,948.00	42,271,600	
フジ	12,900	1,890.00	24,381,000	
ヤオコー	12,100	7,450.00	90,145,000	
ゼビオホールディングス	13,100	915.00	11,986,500	
ケーブホールディングス	103,100	1,457.00	150,216,700	

Olympicグループ	5,700	834.00	4,753,800
日産東京販売ホールディングス	16,400	236.00	3,870,400
シルバーライフ	1,500	2,249.00	3,373,500
一家ダイニングプロジェクト	1,100	677.00	744,700
Genky DrugStores	4,700	3,385.00	15,909,500
ナルミヤ・インターナショナル	2,600	750.00	1,950,000
ブックオフグループホールディングス	6,200	838.00	5,195,600
アインホールディングス	13,100	6,940.00	90,914,000
元気寿司	2,800	2,578.00	7,218,400
ヤマダ電機	325,400	571.00	185,803,400
アークランドサカモト	16,800	1,436.00	24,124,800
ニトリホールディングス	46,200	19,320.00	892,584,000
グルメ杵屋	7,800	995.00	7,761,000
愛眼	8,500	217.00	1,844,500
ケーユーホールディングス	5,800	830.00	4,814,000
吉野家ホールディングス	35,100	2,424.00	85,082,400
松屋フーズホールディングス	5,200	3,910.00	20,332,000
サガミホールディングス	14,400	1,274.00	18,345,600
関西スーパーマーケット	9,000	1,109.00	9,981,000
王将フードサービス	7,900	6,270.00	49,533,000
プレナス	12,000	1,844.00	22,128,000
ミニストップ	8,000	1,567.00	12,536,000
アークス	21,900	2,201.00	48,201,900
パローホールディングス	23,700	2,200.00	52,140,000
ベルク	5,300	6,710.00	35,563,000
大庄	5,800	1,398.00	8,108,400
ファーストリテイリング	14,300	66,040.00	944,372,000
サンドラッグ	40,200	3,555.00	142,911,000
サックスパーホールディングス	9,300	634.00	5,896,200
ヤマザワ	2,600	1,720.00	4,472,000
やまや	2,300	2,330.00	5,359,000
ベルーナ	23,200	641.00	14,871,200
島根銀行	2,800	519.00	1,453,200
じもとホールディングス	72,200	98.00	7,075,600
めぶきフィナンシャルグループ	555,200	257.00	142,686,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,400	1,157.00	16,660,800
九州フィナンシャルグループ	233,800	469.00	109,652,200
ゆうちょ銀行	302,700	921.00	278,786,700
富山第一銀行	25,500	276.00	7,038,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	610,300	373.00	227,641,900
西日本フィナンシャルホールディングス	71,100	791.00	56,240,100
関西みらいフィナンシャルグループ	62,700	435.00	27,274,500

三十三フィナンシャルグループ	9,900	1,526.00	15,107,400
第四北越フィナンシャルグループ	18,500	2,326.00	43,031,000
新生銀行	78,400	1,489.00	116,737,600
あおぞら銀行	63,700	2,138.00	136,190,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,309,900	469.00	3,428,343,100
りそなホールディングス	1,172,700	399.90	468,962,730
三井住友トラスト・ホールディングス	202,000	3,277.00	661,954,000
三井住友フィナンシャルグループ	739,000	3,326.00	2,457,914,000
千葉銀行	356,600	548.00	195,416,800
群馬銀行	205,300	352.00	72,265,600
武蔵野銀行	15,900	1,652.00	26,266,800
千葉興業銀行	29,300	269.00	7,881,700
筑波銀行	44,400	184.00	8,169,600
七十七銀行	36,100	1,643.00	59,312,300
青森銀行	8,300	2,277.00	18,899,100
秋田銀行	6,800	1,614.00	10,975,200
山形銀行	12,000	1,380.00	16,560,000
岩手銀行	7,000	2,688.00	18,816,000
東邦銀行	95,600	236.00	22,561,600
東北銀行	5,100	950.00	4,845,000
みちのく銀行	6,900	1,193.00	8,231,700
ふくおかフィナンシャルグループ	90,000	1,866.00	167,940,000
静岡銀行	264,600	735.00	194,481,000
十六銀行	13,400	2,133.00	28,582,200
スルガ銀行	109,300	440.00	48,092,000
八十二銀行	257,900	423.00	109,091,700
山梨中央銀行	12,400	926.00	11,482,400
大垣共立銀行	21,100	2,316.00	48,867,600
福井銀行	9,100	1,689.00	15,369,900
北國銀行	10,600	2,994.00	31,736,400
清水銀行	4,400	1,801.00	7,924,400
富山銀行	2,100	2,325.00	4,882,500
滋賀銀行	21,400	2,572.00	55,040,800
南都銀行	17,800	2,241.00	39,889,800
百五銀行	96,200	333.00	32,034,600
京都銀行	38,300	4,100.00	157,030,000
紀陽銀行	37,800	1,693.00	63,995,400
ほくほくフィナンシャルグループ	71,100	949.00	67,473,900
広島銀行	157,700	529.00	83,423,300
山陰合同銀行	63,400	555.00	35,187,000
中国銀行	92,000	1,029.00	94,668,000
鳥取銀行	3,600	1,287.00	4,633,200

伊予銀行	152,500	656.00	100,040,000	
百十四銀行	11,400	2,013.00	22,948,200	
四国銀行	16,200	847.00	13,721,400	
阿波銀行	17,500	2,699.00	47,232,500	
大分銀行	6,100	2,455.00	14,975,500	
宮崎銀行	7,100	2,411.00	17,118,100	
佐賀銀行	6,500	1,247.00	8,105,500	
沖縄銀行	9,800	3,265.00	31,997,000	
琉球銀行	24,700	960.00	23,712,000	
セブン銀行	357,000	302.00	107,814,000	
みずほフィナンシャルグループ	14,520,400	143.00	2,076,417,200	
高知銀行	3,900	719.00	2,804,100	
山口フィナンシャルグループ	133,400	672.00	89,644,800	
長野銀行	3,500	1,146.00	4,011,000	
名古屋銀行	8,000	2,523.00	20,184,000	
北洋銀行	161,100	227.00	36,569,700	
愛知銀行	3,900	2,985.00	11,641,500	
中京銀行	4,400	2,178.00	9,583,200	
大光銀行	3,700	1,468.00	5,431,600	
愛媛銀行	14,900	1,174.00	17,492,600	
トマト銀行	4,100	1,089.00	4,464,900	
京葉銀行	45,600	532.00	24,259,200	
栃木銀行	51,600	179.00	9,236,400	
北日本銀行	3,300	1,998.00	6,593,400	
東和銀行	18,800	729.00	13,705,200	
福島銀行	10,100	193.00	1,949,300	
大東銀行	5,600	624.00	3,494,400	
トモニホールディングス	82,600	358.00	29,570,800	
フィデアホールディングス	103,700	112.00	11,614,400	
池田泉州ホールディングス	122,900	174.00	21,384,600	
F P G	33,200	706.00	23,439,200	
マーキュリアインベストメント	5,000	614.00	3,070,000	
S B I ホールディングス	119,400	2,345.00	279,993,000	
ジャフコ	16,500	3,820.00	63,030,000	
大和証券グループ本社	857,800	480.70	412,344,460	
野村ホールディングス	1,880,500	506.40	952,285,200	
岡三証券グループ	91,500	362.00	33,123,000	
丸三証券	32,100	473.00	15,183,300	
東洋証券	39,300	138.00	5,423,400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	123,300	273.00	33,660,900	
光世証券	2,800	550.00	1,540,000	
水戸証券	31,600	214.00	6,762,400	

いちよし証券	20,300	487.00	9,886,100
松井証券	61,200	884.00	54,100,800
だいこう証券ビジネス	5,400	920.00	4,968,000
マネックスグループ	79,000	240.00	18,960,000
極東証券	14,600	574.00	8,380,400
岩井コスモホールディングス	10,200	1,066.00	10,873,200
藍澤証券	19,400	716.00	13,890,400
マネーパートナーズグループ	12,100	215.00	2,601,500
スパークス・グループ	50,000	230.00	11,500,000
かんぽ生命保険	37,800	1,511.00	57,115,800
S O M P Oホールディングス	200,900	3,876.00	778,688,400
アニコム ホールディングス	8,800	5,000.00	44,000,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	279,400	3,300.00	922,020,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	87,800	2,596.00	227,928,800
第一生命ホールディングス	604,700	1,523.50	921,260,450
東京海上ホールディングス	377,800	5,091.00	1,923,379,800
T & Dホールディングス	319,400	1,078.00	344,313,200
アドバンスクリエイト	2,200	2,296.00	5,051,200
全国保証	30,100	4,350.00	130,935,000
ジェイリース	3,000	399.00	1,197,000
イントラスト	3,700	791.00	2,926,700
日本モーゲージサービス	2,200	1,989.00	4,375,800
C a s a	3,700	1,305.00	4,828,500
アルヒ	17,000	1,694.00	28,798,000
プレミアグループ	5,800	1,937.00	11,234,600
クレディセゾン	74,900	1,431.00	107,181,900
芙蓉総合リース	11,200	6,330.00	70,896,000
みずほリース	16,500	2,520.00	41,580,000
東京センチュリー	21,500	5,520.00	118,680,000
日本証券金融	47,100	528.00	24,868,800
アイフル	163,000	266.00	43,358,000
リコーリース	8,400	3,190.00	26,796,000
イオンフィナンシャルサービス	65,400	1,329.00	86,916,600
アコム	214,800	461.00	99,022,800
ジャックス	11,800	1,978.00	23,340,400
オリエントコーポレーション	289,000	137.00	39,593,000
日立キャピタル	25,200	2,493.00	62,823,600
アプラスフィナンシャル	51,300	76.00	3,898,800
オリックス	668,400	1,550.00	1,036,020,000
三菱UFJリース	271,200	566.00	153,499,200
九州リースサービス	5,200	521.00	2,709,200
日本取引所グループ	306,700	2,435.00	746,814,500

イー・ギャランティ	11,400	2,024.00	23,073,600
アサックス	5,500	662.00	3,641,000
NECキャピタルソリューション	4,300	2,141.00	9,206,300
いちご	141,000	315.00	44,415,000
日本駐車場開発	116,400	146.00	16,994,400
スター・マイカ・ホールディングス	6,600	1,504.00	9,926,400
ADワークスグループ	19,800	197.00	3,900,600
ヒューリック	229,600	1,092.00	250,723,200
三栄建築設計	5,500	1,347.00	7,408,500
野村不動産ホールディングス	65,600	2,165.00	142,024,000
三重交通グループホールディングス	24,800	498.00	12,350,400
サムティ	16,200	1,471.00	23,830,200
ディア・ライフ	18,200	512.00	9,318,400
日本商業開発	7,800	1,566.00	12,214,800
ハウスコム	3,000	1,388.00	4,164,000
日本管理センター	8,300	1,320.00	10,956,000
サンセイランディック	4,900	888.00	4,351,200
フージャースホールディングス	21,300	577.00	12,290,100
オープンハウス	31,500	3,535.00	111,352,500
東急不動産ホールディングス	293,200	603.00	176,799,600
飯田グループホールディングス	90,100	1,736.00	156,413,600
イーランド	3,900	716.00	2,792,400
ムゲンエステート	10,100	570.00	5,757,000
ハウズドゥ	5,200	1,133.00	5,891,600
シーアールイー	3,800	1,376.00	5,228,800
グッドコムアセット	3,500	1,853.00	6,485,500
ジェイ・エス・ビー	3,000	2,282.00	6,846,000
テンポイノベーション	4,500	704.00	3,168,000
パーク24	58,100	2,263.00	131,480,300
パラカ	3,600	1,830.00	6,588,000
三井不動産	527,700	2,282.00	1,204,211,400
三菱地所	749,600	1,786.50	1,339,160,400
平和不動産	20,100	3,095.00	62,209,500
東京建物	113,700	1,455.00	165,433,500
ダイビル	29,000	1,094.00	31,726,000
京阪神ビルディング	18,200	1,401.00	25,498,200
住友不動産	240,700	3,274.00	788,051,800
テーオーシー	23,100	753.00	17,394,300
東京楽天地	2,100	4,895.00	10,279,500
スターツコーポレーション	15,200	2,227.00	33,850,400
フジ住宅	15,200	570.00	8,664,000
空港施設	14,200	447.00	6,347,400

明和地所	9,400	446.00	4,192,400
ゴールドクレスト	9,400	1,570.00	14,758,000
エスリード	5,200	1,520.00	7,904,000
日神グループホールディングス	19,700	407.00	8,017,900
日本エスコン	19,300	848.00	16,366,400
タカラレーベン	48,800	383.00	18,690,400
A V A N T I A	8,000	790.00	6,320,000
イオンモール	54,600	1,558.00	85,066,800
毎日コムネット	4,600	801.00	3,684,600
ファースト住建	6,100	981.00	5,984,100
カチタス	27,100	2,756.00	74,687,600
トーセイ	16,100	1,134.00	18,257,400
穴吹興産	3,200	1,773.00	5,673,600
サンフロンティア不動産	16,400	989.00	16,219,600
エフ・ジェー・ネクスト	11,000	909.00	9,999,000
インテリックス	3,000	538.00	1,614,000
ランドビジネス	3,600	435.00	1,566,000
日本社宅サービス	4,700	1,107.00	5,202,900
グランディハウス	11,900	428.00	5,093,200
日本空港ビルデング	34,400	5,060.00	174,064,000
日本工営	7,000	3,215.00	22,505,000
L I F U L L	36,400	434.00	15,797,600
ジェイエイシーリクルートメント	7,000	1,309.00	9,163,000
日本M&Aセンター	78,200	4,895.00	382,789,000
メンバーズ	3,100	1,675.00	5,192,500
中広	1,600	553.00	884,800
UTグループ	16,300	2,449.00	39,918,700
アイティメディア	4,200	1,401.00	5,884,200
タケエイ	10,000	969.00	9,690,000
E・Jホールディングス	1,900	1,563.00	2,969,700
ビーネックスグループ	13,100	957.00	12,536,700
コシダカホールディングス	25,100	521.00	13,077,100
アルトナー	2,600	921.00	2,394,600
パソナグループ	11,300	1,277.00	14,430,100
C D S	2,700	1,311.00	3,539,700
リンクアンドモチベーション	23,100	459.00	10,602,900
G C A	12,700	695.00	8,826,500
エス・エム・エス	32,300	2,657.00	85,821,100
サニーサイドアップグループ	3,700	870.00	3,219,000
パーソルホールディングス	103,600	1,522.00	157,679,200
リニカル	5,100	934.00	4,763,400
クックパッド	36,500	319.00	11,643,500

エスクリ	3,500	468.00	1,638,000
アイ・ケイ・ケイ	5,200	607.00	3,156,400
学情	3,700	1,417.00	5,242,900
スタジオアリス	5,300	1,709.00	9,057,700
シミックホールディングス	5,200	1,580.00	8,216,000
エプロ	2,300	1,179.00	2,711,700
N J S	2,300	1,781.00	4,096,300
総合警備保障	41,200	5,350.00	220,420,000
カカクコム	76,500	2,823.00	215,959,500
アイロムグループ	3,600	3,355.00	12,078,000
セントケア・ホールディング	7,000	409.00	2,863,000
サイネックス	1,900	700.00	1,330,000
ルネサンス	5,800	1,203.00	6,977,400
ディップ	14,600	2,486.00	36,295,600
オプトホールディング	5,700	1,510.00	8,607,000
ツクイ	24,600	565.00	13,899,000
キャリアデザインセンター	2,500	1,056.00	2,640,000
ベネフィット・ワン	37,700	2,281.00	85,993,700
エムスリー	228,300	4,505.00	1,028,491,500
ツカダ・グローバルホールディング	6,600	374.00	2,468,400
プラス	1,600	570.00	912,000
アウトソーシング	59,400	753.00	44,728,200
ウェルネット	10,600	801.00	8,490,600
ワールドホールディングス	3,600	1,860.00	6,696,000
ディー・エヌ・エー	50,800	1,457.00	74,015,600
博報堂D Yホールディングス	144,100	1,343.00	193,526,300
ぐるなび	18,200	799.00	14,541,800
タカミヤ	11,200	505.00	5,656,000
ジャパンベストレスキューシステム	8,200	935.00	7,667,000
ファンコミュニケーションズ	28,700	484.00	13,890,800
ライク	3,500	1,713.00	5,995,500
ビジネス・ブレークスルー	4,600	380.00	1,748,000
エスプール	26,700	797.00	21,279,900
W D Bホールディングス	4,800	2,800.00	13,440,000
手間いらず	700	5,210.00	3,647,000
ティア	6,200	537.00	3,329,400
C D G	1,200	1,550.00	1,860,000
バリューコマース	5,800	2,853.00	16,547,400
インフォマート	113,600	906.00	102,921,600
J Pホールディングス	32,900	281.00	9,244,900
エコナックホールディングス	19,800	103.00	2,039,400
E P Sホールディングス	14,100	1,106.00	15,594,600

レグス	2,700	1,035.00	2,794,500
プレステージ・インターナショナル	38,900	938.00	36,488,200
アミューズ	5,700	2,257.00	12,864,900
ドリームインキュベータ	3,200	1,517.00	4,854,400
クイック	6,500	1,270.00	8,255,000
T A C	6,800	200.00	1,360,000
ケネディクス	96,700	590.00	57,053,000
電通グループ	106,800	3,040.00	324,672,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,100	731.00	2,997,100
ぴあ	3,000	3,790.00	11,370,000
イオンファンタジー	4,100	1,866.00	7,650,600
シーティーエス	11,800	856.00	10,100,800
ネクシィーズグループ	3,300	1,175.00	3,877,500
みらかホールディングス	29,000	2,679.00	77,691,000
アルプス技研	9,200	1,961.00	18,041,200
ダイオーズ	2,100	1,121.00	2,354,100
日本空調サービス	11,000	728.00	8,008,000
オリエンタルランド	110,100	15,465.00	1,702,696,500
ダスキン	25,800	2,865.00	73,917,000
明光ネットワークジャパン	13,200	880.00	11,616,000
ファルコホールディングス	5,800	1,634.00	9,477,200
ラウンドワン	29,000	932.00	27,028,000
リゾートトラスト	47,500	1,512.00	71,820,000
ビー・エム・エル	13,400	3,085.00	41,339,000
ワタベウェディング	2,000	396.00	792,000
りらいあコミュニケーションズ	18,800	1,254.00	23,575,200
リソー教育	47,600	340.00	16,184,000
早稲田アカデミー	4,600	959.00	4,411,400
ユー・エス・エス	116,000	1,944.00	225,504,000
東京個別指導学院	3,800	623.00	2,367,400
サイバーエージェント	63,800	5,110.00	326,018,000
楽天	482,700	973.00	469,667,100
クリーク・アンド・リバー社	5,500	1,119.00	6,154,500
テー・オー・ダブリュー	16,800	382.00	6,417,600
山田コンサルティンググループ	6,800	1,432.00	9,737,600
セントラルスポーツ	3,900	2,615.00	10,198,500
フルキャストホールディングス	10,400	1,655.00	17,212,000
エン・ジャパン	18,400	3,165.00	58,236,000
リソルホールディングス	1,200	3,505.00	4,206,000
テクノプロ・ホールディングス	20,700	6,790.00	140,553,000
アトラ	2,800	271.00	758,800
インターワークス	2,300	398.00	915,400

アイ・アールジャパンホールディングス	4,200	10,410.00	43,722,000
K e e P e r 技研	3,900	1,724.00	6,723,600
ファーストロジック	2,200	620.00	1,364,000
三機サービス	2,100	1,057.00	2,219,700
G u n o s y	6,500	1,037.00	6,740,500
デザインワン・ジャパン	3,500	278.00	973,000
イー・ガーディアン	4,600	2,496.00	11,481,600
リブセンス	7,000	287.00	2,009,000
ジャパンマテリアル	31,900	1,703.00	54,325,700
ベクトル	13,000	960.00	12,480,000
ウチヤマホールディングス	5,400	370.00	1,998,000
チャーム・ケア・コーポレーション	8,900	877.00	7,805,300
ライクキッズ	1,900	922.00	1,751,800
キャリアリンク	3,600	593.00	2,134,800
I B J	7,200	838.00	6,033,600
アサンテ	4,200	1,562.00	6,560,400
N・フィールド	7,300	618.00	4,511,400
バリューHR	4,200	1,516.00	6,367,200
M&Aキャピタルパートナーズ	8,400	4,265.00	35,826,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,000	2,000.00	8,000,000
E R Iホールディングス	3,100	670.00	2,077,000
アビスト	1,700	2,624.00	4,460,800
シグマクシス	7,200	1,886.00	13,579,200
ウィルグループ	6,900	735.00	5,071,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,800	223.00	3,300,400
リクルートホールディングス	741,700	4,048.00	3,002,401,600
エラン	6,200	1,940.00	12,028,000
土木管理総合試験所	4,800	374.00	1,795,200
ネットマーケティング	4,200	673.00	2,826,600
日本郵政	848,700	848.80	720,376,560
ベルシステム24ホールディングス	17,400	1,456.00	25,334,400
鎌倉新書	7,900	1,298.00	10,254,200
S M N	2,300	1,084.00	2,493,200
一蔵	1,400	413.00	578,200
L I T A L I C O	3,600	2,634.00	9,482,400
グローバルキッズCOMPANY	2,000	607.00	1,214,000
エアトリ	5,400	1,356.00	7,322,400
アトラエ	3,200	3,415.00	10,928,000
ストライク	3,900	5,160.00	20,124,000
ソラスト	28,600	1,239.00	35,435,400
セラク	3,400	1,068.00	3,631,200
インソース	4,300	3,025.00	13,007,500

ベイカレント・コンサルティング	6,300	9,150.00	57,645,000
Orchestra Holdings	2,200	1,425.00	3,135,000
アイモバイル	3,800	824.00	3,131,200
キャリアインデックス	4,600	350.00	1,610,000
MS - Japan	3,500	908.00	3,178,000
船場	1,800	1,006.00	1,810,800
グレイステクノロジー	4,800	4,660.00	22,368,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	10,900	3,175.00	34,607,500
フルテック	1,500	1,278.00	1,917,000
グリーンズ	2,800	580.00	1,624,000
GameWith	3,200	657.00	2,102,400
ソウルドアウト	2,200	2,525.00	5,555,000
MS&Consulting	2,100	623.00	1,308,300
ミダック	1,400	1,653.00	2,314,200
日総工産	7,100	778.00	5,523,800
キュービーネットホールディングス	4,300	2,225.00	9,567,500
RPAホールディングス	8,000	899.00	7,192,000
スプリックス	3,000	887.00	2,661,000
マネジメントソリューションズ	4,600	1,171.00	5,386,600
プロレド・パートナーズ	1,400	5,070.00	7,098,000
and factory	1,000	1,144.00	1,144,000
ギークス	1,100	1,368.00	1,504,800
カーブスホールディングス	28,600	672.00	19,219,200
フォーラムエンジニアリング	5,500	958.00	5,269,000
アドバンテッジリスクマネジメント	5,300	918.00	4,865,400
リログループ	56,600	2,452.00	138,783,200
東祥	6,500	1,438.00	9,347,000
エイチ・アイ・エス	16,100	2,036.00	32,779,600
ラックランド	2,500	2,262.00	5,655,000
共立メンテナンス	17,200	3,950.00	67,940,000
イチネンホールディングス	11,700	1,269.00	14,847,300
建設技術研究所	7,200	1,828.00	13,161,600
スペース	6,800	1,042.00	7,085,600
長大	4,200	1,093.00	4,590,600
燦ホールディングス	4,600	1,240.00	5,704,000
スバル興業	600	7,900.00	4,740,000
東京テアトル	4,100	1,293.00	5,301,300
タナベ経営	2,100	1,291.00	2,711,100
ナガワ	3,300	7,600.00	25,080,000
よみうりランド	2,300	3,755.00	8,636,500
東京都競馬	6,800	3,745.00	25,466,000
カナモト	17,000	2,361.00	40,137,000

東京ドーム	42,000	890.00	37,380,000	
西尾レントオール	9,600	2,356.00	22,617,600	
トランス・コスモス	9,900	2,478.00	24,532,200	
乃村工藝社	44,500	1,016.00	45,212,000	
藤田観光	4,500	1,926.00	8,667,000	
KNT-CTホールディングス	6,400	1,136.00	7,270,400	
日本管財	11,100	1,895.00	21,034,500	
トーカイ	10,000	2,665.00	26,650,000	
白洋舎	1,200	2,895.00	3,474,000	
セコム	109,900	9,619.00	1,057,128,100	
セントラル警備保障	5,000	4,660.00	23,300,000	
丹青社	19,700	817.00	16,094,900	
メイテック	12,700	5,540.00	70,358,000	
応用地質	11,200	1,374.00	15,388,800	
船井総研ホールディングス	21,400	2,588.00	55,383,200	
進学会ホールディングス	4,300	514.00	2,210,200	
オオバ	7,500	670.00	5,025,000	
いであ	2,600	1,991.00	5,176,600	
学究社	3,100	1,143.00	3,543,300	
ベネッセホールディングス	34,500	2,932.00	101,154,000	
イオンディライト	12,800	3,230.00	41,344,000	
ナック	5,900	912.00	5,380,800	
ニチイ学館	15,000	1,600.00	24,000,000	
ダイセキ	17,400	2,850.00	49,590,000	
ステップ	3,900	1,516.00	5,912,400	
合計	126,972,425		247,199,274,550	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
新株予約権証券	千葉興業銀行第7回新株予約権	29,800	-	
	合計	29,800	-	

(注) 券面総額欄の数値は、証券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

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国株式マザーファンド

### 貸借対照表

	2020年 6月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	417,787,912
コール・ローン	3,457,999,144
株式	215,340,099,392
投資信託受益証券	163,638,118
投資証券	5,596,304,706
派生商品評価勘定	393,740,523
未収入金	2,080,087
未収配当金	296,724,274
差入委託証拠金	2,167,401,586
流動資産合計	227,835,775,742
資産合計	227,835,775,742
負債の部	
流動負債	
前受金	378,021,714
未払解約金	2,527,497,601
未払利息	5,093
その他未払費用	1,760
流動負債合計	2,905,526,168
負債合計	2,905,526,168
純資産の部	
元本等	
元本	76,748,723,588
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	148,181,525,986
元本等合計	224,930,249,574
純資産合計	224,930,249,574
負債純資産合計	227,835,775,742

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 6月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券</p>

	2020年 6月10日現在
	<p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(3)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2020年 6月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		76,748,723,588口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.9307円 (29,307円)

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2020年 6月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として株価指数先物取引及び為替予約取引を行っております。株価指数先物取引に係る主要なリスクは、株価の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券

	2020年 6月10日現在
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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)」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

( 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。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

元本の移動

区分	2020年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月11日
期首元本額	68,863,760,422円
期中追加設定元本額	19,371,644,950円
期中一部解約元本額	11,486,681,784円
期末元本額	76,748,723,588円
期末元本額の内訳	

区分	2020年 6月10日現在
外国株式インデックスファンド	1,673,441,501円
D C外国株式インデックスファンド	4,618,315,534円
D C外国株式インデックスファンドL	22,537,337,025円
D Cバランスファンド30	695,570,264円
D Cバランスファンド50	1,457,267,830円
D Cバランスファンド70	855,575,174円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	365,329,291円
外国株式インデックスe	5,242,629,858円
インデックスコレクション（外国株式）	10,285,401,664円
インデックスコレクション（バランス株式30）	3,999,003,506円
インデックスコレクション（バランス株式50）	980,370,329円
インデックスコレクション（バランス株式70）	852,151,852円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	8,058,817,409円
外国株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	1,296,308,148円
外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	808,142,125円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	49,646,896円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	562,022,403円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	70,366,939円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	255,343,229円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	1,441,054円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	2,317,107,881円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	456,682,319円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	316,812,397円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	5,918,910,004円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	583,053,176円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	249,179,292円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,034,670,969円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	27,655,311円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	121,666,079円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	145,864,229円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	449,263,055円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	25,247,607円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	103,046,401円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	329,425,174円
私募外国株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	5,657,663円

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	10,355,322,125

投資信託受益証券	15,981,151
投資証券	515,148,174
合計	10,886,451,450

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国株式マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 株式関連

(2020年 6月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,244,599,048	-	3,622,620,762	378,021,714
	合計	3,244,599,048	-	3,622,620,762	378,021,714

(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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2.株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 通貨関連

(2020年 6月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	996,101,015	-	1,011,805,059	15,704,044
	アメリカドル	768,238,438	-	773,003,549	4,765,111
	ユーロ	139,638,960	-	146,712,000	7,073,040
	イギリスポンド	88,223,617	-	92,089,510	3,865,893
	売建	235,624,665	-	235,609,900	14,765
	アメリカドル	118,566,030	-	118,558,000	8,030
	ユーロ	12,226,450	-	12,226,000	450
	スイスフラン	82,735,280	-	82,730,900	4,380
	ノルウェークローネ	10,458,180	-	10,458,000	180
	シンガポールドル	11,638,725	-	11,637,000	1,725
	合計	1,231,725,680	-	1,247,414,959	15,718,809

(注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の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によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の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、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	BAKER HUGHES CO	34,920	18.67	651,956.40	
	CABOT OIL & GAS CORP	18,624	21.93	408,424.32	
	CHENIERE ENERGY INC	11,266	51.01	574,678.66	
	CHEVRON CORP	97,265	101.53	9,875,315.45	
	CONCHO RESOURCES INC	10,403	64.98	675,986.94	
	CONOCOPHILLIPS	56,292	48.63	2,737,479.96	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	8,591	53.92	463,226.72	
	EOG RESOURCES INC	30,410	59.47	1,808,482.70	
	EXXON MOBIL	218,994	53.52	11,720,558.88	
	HALLIBURTON CO	47,020	15.43	725,518.60	
	HESS CORP	14,572	57.67	840,367.24	
	HOLLYFRONTIER CORP	7,524	35.33	265,822.92	
	KINDER MORGAN INC	104,998	17.29	1,815,415.42	
	MARATHON PETROLEUM CORP	34,027	40.41	1,375,031.07	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	20,993	15.69	329,380.17	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	43,476	23.18	1,007,773.68	
	ONEOK INC	21,844	44.44	970,747.36	
	PHILLIPS 66	22,933	85.67	1,964,670.11	
	PIONEER NATURAL RESOURCES	8,391	108.53	910,675.23	
	SCHLUMBERGER	72,712	22.51	1,636,747.12	
	VALERO ENERGY CORP	21,414	71.27	1,526,175.78	
	WILLIAMS COS	63,193	20.53	1,297,352.29	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	11,274	250.87	2,828,308.38	
	ALBEMARLE CORP	4,921	85.00	418,285.00	
	AMCOR PLC	83,398	10.20	850,659.60	
	AVERY DENNISON CORP	4,144	122.42	507,308.48	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,844	24.25	262,967.00		
BALL CORP	17,106	72.44	1,239,158.64		
CELANESE CORP-SERIES A	6,028	97.00	584,716.00		

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,379	31.93	331,401.47
CORTEVA INC	37,876	29.59	1,120,750.84
CROWN HOLDINGS INC	7,597	68.23	518,343.31
DOW INC	38,361	44.41	1,703,612.01
DUPONT DE NEMOURS INC	38,221	55.93	2,137,700.53
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	6,407	77.02	493,467.14
ECOLAB INC	13,280	226.71	3,010,708.80
FMC CORP	6,680	104.24	696,323.20
FREEMONT-MCMORAN INC	72,491	11.27	816,973.57
INT'L PAPER CO	19,784	38.31	757,925.04
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,553	134.57	612,697.21
LINDE PLC	27,654	214.23	5,924,316.42
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,058	76.00	1,068,408.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,199	208.85	668,111.15
MOSAIC CO/THE	20,003	14.75	295,044.25
NEWMONT CORPORATION	42,026	57.17	2,402,626.42
NUCOR CORP	16,038	44.25	709,681.50
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,079	107.85	547,770.15
PPG INDUSTRIES INC	12,257	111.42	1,365,674.94
RPM INTERNATIONAL INC	6,943	79.22	550,024.46
SEALED AIR CORP	7,368	33.78	248,891.04
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,255	581.77	2,475,431.35
STEEL DYNAMICS INC	11,755	29.36	345,126.80
VULCAN MATERIALS CO	6,788	118.03	801,187.64
WESTROCK CO	13,827	31.91	441,219.57
3 M COMPANY	29,852	166.70	4,976,328.40
AERCAP HOLDINGS NV	5,656	37.89	214,305.84
ALLEGION PLC	4,638	112.29	520,801.02
AMETEK INC	11,592	94.79	1,098,805.68
BOEING CO	27,761	216.74	6,016,919.14
CARRIER GLOBAL CORP	41,753	23.21	969,087.13
CATERPILLAR	28,193	134.19	3,783,218.67
CUMMINS INC	7,873	181.75	1,430,917.75
DEERE&CO	15,323	164.81	2,525,383.63
DOVER CORP	7,651	106.67	816,132.17
EATON CORP	21,252	95.42	2,027,865.84
EMERSON ELECTRIC CO	31,361	67.51	2,117,181.11
FASTENAL CO	29,108	42.86	1,247,568.88
FORTIVE CORP	15,923	69.58	1,107,922.34
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	6,720	63.33	425,577.60
GENERAL DYNAMICS CORP	12,651	163.48	2,068,185.48
GENERAL ELECTRIC CO	445,218	8.02	3,570,648.36

GRAINGER (WW) INC	2,418	326.34	789,090.12
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,789	37.85	294,813.65
HEICO CORP	2,252	113.72	256,097.44
HEICO CORP-CLASS A	3,238	97.03	314,183.14
HONEYWELL INTL INC	36,934	158.10	5,839,265.40
HOWMET AEROSPACE INC	18,227	16.22	295,641.94
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	1,993	197.76	394,135.68
IDEX CORP	3,709	162.11	601,265.99
ILLINOIS TOOL WORKS	16,433	178.03	2,925,566.99
INGERSOLL-RAND INC	17,228	33.09	570,074.52
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,714	88.59	594,793.26
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,500	46.00	529,000.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	9,400	23.13	217,422.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	38,179	35.74	1,364,517.46
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,331	208.28	2,360,020.68
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,882	233.14	438,769.48
LOCKHEED MARTIN CORP	13,156	408.56	5,375,015.36
MASCO CORP	14,744	47.84	705,352.96
NORDSON CORP	2,944	199.78	588,152.32
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,184	342.53	2,803,265.52
OTIS WORLDWIDE CORP	20,876	60.65	1,266,129.40
OWENS CORNING	4,925	58.47	287,964.75
PACCAR INC	17,922	78.95	1,414,941.90
PARKER HANNIFIN CORP	6,734	195.18	1,314,342.12
PENTAIR PLC	9,170	40.37	370,192.90
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	78,563	70.54	5,541,834.02
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,016	220.04	1,323,760.64
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,531	402.13	2,224,181.03
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,602	41.84	318,067.68
SMITH (A.O.) CORP	6,846	49.27	337,302.42
SNAP-ON INC	2,819	151.44	426,909.36
STANLEY BLACK&DECKER	7,694	141.23	1,086,623.62
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,889	366.16	691,676.24
TEXTRON	10,911	38.51	420,182.61
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,523	97.46	1,220,491.58
TRANSDIGM GROUP INC	2,610	479.20	1,250,712.00
UNITED RENTALS INC	3,773	158.25	597,077.25
WABTEC CORP	8,979	69.12	620,628.48
XYLEM INC	9,287	70.27	652,597.49
CINTAS CORP	4,432	282.91	1,253,857.12
COPART INC	10,663	89.10	950,073.30
COSTAR GROUP INC	2,039	691.65	1,410,274.35

EQUIFAX INC	6,176	175.03	1,080,985.28
IHS MARKIT LTD	19,686	73.11	1,439,243.46
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,880	16.66	264,560.80
REPUBLIC SERVICES INC	11,640	87.82	1,022,224.80
ROBERT HALF INTL INC	6,315	57.81	365,070.15
ROLLINS INC	7,140	43.50	310,590.00
TRANSUNION	9,966	93.21	928,930.86
VERISK ANALYTICS INC	7,837	169.33	1,327,039.21
WASTE CONNECTIONS INC	13,249	94.79	1,255,872.71
WASTE MANAGEMENT INC	21,722	111.25	2,416,572.50
AMERCO	376	340.13	127,888.88
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	7,206	83.09	598,746.54
CSX CORP	40,226	73.66	2,963,047.16
DELTA AIR LINES INC	7,841	34.17	267,926.97
EXPEDITORS INTL WASH INC	9,000	78.18	703,620.00
FEDEX CORP	12,740	144.69	1,843,350.60
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,552	119.81	545,375.12
KANSAS CITY SOUTHERN	5,212	158.17	824,382.04
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,000	40.01	280,070.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,362	192.05	2,566,172.10
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,977	163.88	815,630.76
SOUTHWEST AIRLINES CO	8,049	38.01	305,942.49
UBER TECHNOLOGIES INC	49,607	36.59	1,815,120.13
UNION PACIFIC CORP	35,761	178.16	6,371,179.76
UNITED PARCEL SERVICE B	36,454	107.83	3,930,834.82
XPO LOGISTICS INC	5,001	79.38	396,979.38
APTIV PLC	13,432	75.91	1,019,623.12
AUTOLIV INC	3,858	67.67	261,070.86
BORGWARNER INC	9,348	36.65	342,604.20
FORD MOTOR COMPANY	204,322	7.24	1,479,291.28
GENERAL MOTORS CO	66,196	29.86	1,976,612.56
LEAR CORP	2,989	121.48	363,103.72
TESLA INC	7,642	940.67	7,188,600.14
DR HORTON INC	17,782	55.53	987,434.46
GARMIN LTD	7,602	98.13	745,984.26
HASBRO INC	6,321	79.21	500,686.41
LENNAR CORP-CL A	14,276	62.21	888,109.96
LULULEMON ATHLETICA INC	6,459	316.40	2,043,627.60
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,830	112.72	318,997.60
NEWELL BRANDS INC	20,391	16.66	339,714.06
NIKE B	64,359	102.63	6,605,164.17
NVR INC	171	3,428.69	586,305.99

PULTE GROUP INC	12,739	35.84	456,565.76
RALPH LAUREN CORPORATION	2,566	85.48	219,341.68
VF CORP	17,641	64.45	1,136,962.45
WHIRLPOOL CORP	3,060	137.01	419,250.60
ARAMARK	11,643	30.11	350,570.73
CARNIVAL CORPORATION	27,109	23.04	624,591.36
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,335	1,039.47	1,387,692.45
DARDEN RESTAURANTS INC	6,357	80.89	514,217.73
DOMINO'S PIZZA INC	2,006	382.22	766,733.32
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	14,558	86.13	1,253,880.54
LAS VEGAS SANDS CORP	18,124	53.66	972,533.84
MARRIOTT INTL A	14,364	107.32	1,541,544.48
MCDONALD'S CORP	38,602	199.52	7,701,871.04
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	10,511	18.44	193,822.84
MGM RESORTS INTERNATIONAL	25,221	22.06	556,375.26
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,553	69.91	667,850.23
STARBUCKS CORP	60,110	82.37	4,951,260.70
VAIL RESORTS INC	2,150	188.57	405,425.50
WYNN RESORTS LTD	5,210	102.76	535,379.60
YUM BRANDS INC	15,648	95.56	1,495,322.88
ACTIVISION BLIZZARD INC	39,306	72.00	2,830,032.00
ALPHABET INC-CL A	15,502	1,452.08	22,510,144.16
ALPHABET INC-CL C	15,863	1,456.16	23,099,066.08
ALTICE USA INC- A	18,078	25.83	466,954.74
CABLE ONE INC	247	1,799.52	444,481.44
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,662	531.57	4,072,889.34
COMCAST CORP-CL A	235,143	42.15	9,911,277.45
DISCOVERY INC - A	7,886	23.88	188,317.68
DISCOVERY INC-C	18,339	21.52	394,655.28
DISH NETWORK CORPORATION-A	12,603	35.28	444,633.84
ELECTRONIC ARTS INC	15,026	121.07	1,819,197.82
FACEBOOK INC-A	124,334	238.67	29,674,795.78
FOX CORP - CLASS A	18,452	30.81	568,506.12
FOX CORP- CLASS B	9,450	30.33	286,618.50
IAC/INTERACTIVECORP	4,143	281.67	1,166,958.81
INTERPUBLIC GROUP OF COS	20,801	19.24	400,211.24
LIBERTY BROADBAND-A	1,450	130.11	188,659.50
LIBERTY BROADBAND-C	5,220	132.64	692,380.80
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,831	22.97	179,878.07
LIBERTY GLOBAL PLC-C	22,447	22.41	503,037.27
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,885	36.16	357,441.60
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,928	38.31	303,721.68

LIBERTY SIRIUSXM-A	3,171	38.75	122,876.25
LIVE NATION ENTERTAINMENT	7,407	53.42	395,681.94
MATCH GROUP INC	2,319	89.69	207,991.11
NETFLIX INC	22,709	434.05	9,856,841.45
NEWS CORP-CLASS A	16,730	12.88	215,482.40
OMNICOM GROUP	11,546	60.34	696,685.64
PINTEREST INC- CLASS A	19,736	22.04	434,981.44
ROKU INC	4,881	113.25	552,773.25
SIRIUS XM HOLDINGS INC	60,402	6.32	382,042.65
SNAP INC - A	46,191	21.09	974,168.19
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	5,950	134.41	799,739.50
THE WALT DISNEY CO	93,403	123.89	11,571,697.67
TWITTER INC	40,953	35.92	1,471,031.76
VIACOMCBS INC-CLASS B	27,145	26.02	706,312.90
ZILLOW GROUP INC-C	7,027	61.19	429,982.13
ADVANCE AUTO PARTS	3,293	144.21	474,883.53
AMAZON.COM	21,862	2,600.86	56,860,001.32
AUTOZONE INC	1,235	1,144.76	1,413,778.60
BEST BUY COMPANY INC	12,410	81.62	1,012,904.20
BOOKING HOLDINGS INC	2,136	1,777.97	3,797,743.92
BURLINGTON STORES INC	3,511	212.63	746,543.93
CARMAX INC	8,658	94.92	821,817.36
DOLLAR GENERAL CORP	13,174	186.25	2,453,657.50
DOLLAR TREE INC	12,000	92.58	1,110,960.00
EBAY	41,547	49.75	2,066,963.25
EXPEDIA GROUP INC	6,437	88.70	570,961.90
GENUINE PARTS CO	7,736	91.66	709,081.76
HOME DEPOT	56,417	256.76	14,485,628.92
LKQ CORP	15,761	28.50	449,188.50
LOWES COMPANIES	39,739	129.57	5,148,982.23
MERCADOLIBRE INC	2,333	866.43	2,021,381.19
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,915	423.24	1,656,984.60
ROSS STORES INC	18,636	101.59	1,893,231.24
TARGET (DAYTON HUDSON)	25,873	120.72	3,123,388.56
TIFFANY & CO	5,652	124.56	704,013.12
TJX COMPANIES INC	61,741	56.24	3,472,313.84
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,225	122.44	762,189.00
ULTA BEAUTY INC	2,965	244.68	725,476.20
WAYFAIR INC- CLASS A	3,414	172.43	588,676.02
COSTCO WHOLESALE CORP	22,877	305.55	6,990,067.35
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	17,000	5.00	85,000.00
KROGER CO	41,354	32.92	1,361,373.68

SYSCO CORP	25,289	61.39	1,552,491.71
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	38,911	45.28	1,761,890.08
WALMART INC	73,419	121.35	8,909,395.65
ALTRIA GROUP INC	95,242	42.18	4,017,307.56
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	29,317	42.38	1,242,454.46
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	16,243	69.14	1,123,041.02
BUNGE LIMITED	6,250	42.91	268,187.50
CAMPBELL SOUP CO (US)	9,742	49.53	482,521.26
COCA-COLA CO	210,913	49.00	10,334,737.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	10,990	41.51	456,194.90
CONAGRA BRANDS INC	25,534	33.57	857,176.38
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,669	183.40	1,589,894.60
GENERAL MILLS INC	31,075	62.82	1,952,131.50
HERSHEY FOODS CORPORATION	7,797	133.34	1,039,651.98
HORMEL FOODS CORP	14,360	47.98	688,992.80
INGREDION INC	3,679	89.39	328,865.81
JM SMUCKER CO	5,955	108.43	645,700.65
KELLOGG CO	13,372	66.20	885,226.40
KEURIG DR PEPPER INC	18,861	28.33	534,332.13
KRAFT HEINZ CO/THE	35,314	33.10	1,168,893.40
LAMB WESTON HOLDINGS INC	7,853	71.90	564,630.70
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,493	171.10	1,110,952.30
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	10,321	41.75	430,901.75
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	73,348	52.95	3,883,776.60
MONSTER BEVERAGE CORP	21,099	70.43	1,486,002.57
PEPSICO INC	71,912	132.97	9,562,138.64
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	80,620	75.65	6,098,903.00
TYSON FOODS INC	14,963	66.77	999,079.51
CHURCH & DWIGHT CO INC	12,525	74.93	938,498.25
CLOROX COMPANY	6,492	202.07	1,311,838.44
COLGATE-PALMOLIVE CO	41,580	73.28	3,046,982.40
ESTEE LAUDER CO-CL A	11,411	200.72	2,290,415.92
KIMBERLY-CLARK CORP	17,546	138.58	2,431,524.68
PROCTER & GAMBLE CO	127,711	118.34	15,113,319.74
ABBOTT LABORATORIES	91,288	90.27	8,240,567.76
ABIOMED INC	2,591	245.62	636,401.42
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,934	279.71	1,100,379.14
AMERISOURCEBERGEN CORP	8,181	99.90	817,281.90
ANTHEM INC	12,949	291.01	3,768,288.49
BAXTER INTERNATIONAL	26,588	87.01	2,313,421.88
BECTON DICKINSON & CO	14,086	237.28	3,342,326.08
BOSTON SCIENTIFIC CORP	71,363	38.26	2,730,348.38

CARDINAL HEALTH	15,354	57.65	885,158.10
CENTENE CORP	30,031	65.67	1,972,135.77
CERNER CORP	16,388	71.88	1,177,969.44
CIGNA CORP	19,053	214.50	4,086,868.50
CVS HEALTH CORP	67,647	69.37	4,692,672.39
DANAHER CORP	32,481	169.45	5,503,905.45
DAVITA INC	4,396	84.50	371,462.00
DENTSPLY SIRONA INC	11,899	48.51	577,220.49
DEXCOM INC	4,780	380.50	1,818,790.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	32,043	74.96	2,401,943.28
HCA HEALTHCARE INC	14,005	116.00	1,624,580.00
HENRY SCHEIN INC	6,861	61.16	419,618.76
HOLOGIC INC	13,047	52.75	688,229.25
HUMANA INC	6,802	390.18	2,654,004.36
IDEXX LABORATORIES INC	4,457	303.00	1,350,471.00
INSULET CORP	3,227	181.87	586,894.49
INTUITIVE SURGICAL INC	6,024	584.52	3,521,148.48
LABORATORY CRP OF AMER	5,131	178.94	918,141.14
MASIMO CORP	2,735	215.78	590,158.30
MCKESSON CORP	8,474	161.19	1,365,924.06
MEDTRONIC PLC	69,442	99.11	6,882,396.62
MOLINA HEALTHCARE INC	3,244	175.09	567,991.96
QUEST DIAGNOSTICS	7,120	116.74	831,188.80
RESMED INC	7,252	161.49	1,171,125.48
STERIS PLC	4,144	161.56	669,504.64
STRYKER CORP	17,213	200.70	3,454,649.10
TELADOC HEALTH INC	3,748	168.83	632,774.84
TELEFLEX INC	2,448	367.18	898,856.64
THE COOPER COS INC	2,406	303.23	729,571.38
UNITEDHEALTH GROUP INC	49,056	309.21	15,168,605.76
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,898	109.22	425,739.56
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,835	127.64	617,139.40
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,924	213.55	1,478,620.20
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,868	206.29	797,929.72
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,664	134.14	1,430,468.96
ABBVIE INC	91,428	96.17	8,792,630.76
AGILENT TECHNOLOGIES	16,268	89.77	1,460,378.36
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,617	115.99	1,347,455.83
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,952	129.79	772,510.08
AMGEN	30,547	224.90	6,870,020.30
AVANTOR INC	23,317	17.85	416,208.45
BEIGENE LTD-ADR	2,232	172.63	385,310.16

BIO-RAD LABORATORIES-A	1,201	459.94	552,387.94
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,468	105.09	994,992.12
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	116,907	60.93	7,123,143.51
CATALENT INC	8,308	74.83	621,687.64
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,778	24.10	500,749.80
EXACT SCIENCES CORP	7,646	91.36	698,538.56
GILEAD SCIENCES INC	65,520	77.59	5,083,696.80
ILLUMINA INC	7,531	357.78	2,694,441.18
INCYTE CORP	9,706	93.00	902,658.00
IONIS PHARMACEUTICALS INC	6,654	58.48	389,125.92
IQVIA HOLDINGS INC	10,089	146.80	1,481,065.20
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,663	113.05	301,052.15
JOHNSON & JOHNSON	136,209	145.96	19,881,065.64
LILLY (ELI) & CO	44,582	149.13	6,648,513.66
MERCK & CO	131,237	82.26	10,795,555.62
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,191	815.48	971,236.68
MODERNA INC	14,381	58.23	837,405.63
MYLAN NV	27,817	18.45	513,223.65
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,708	118.82	559,404.56
PERKINELMER INC	5,468	102.44	560,141.92
PERRIGO CO PLC	7,371	55.96	412,481.16
PFIZER	286,328	36.21	10,367,936.88
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,249	608.59	3,194,488.91
SAREPTA THERAPEUTICS INC	4,016	155.65	625,090.40
SEATTLE GENETICS INC	6,223	148.94	926,853.62
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	56,857	12.63	718,103.91
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	20,655	347.65	7,180,710.75
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	13,461	270.85	3,645,911.85
WATERS CORP	3,249	197.38	641,287.62
ZOETIS INC	24,326	138.80	3,376,448.80
BANK OF AMERICA CORP	406,505	28.22	11,471,571.10
CITIGROUP	109,185	59.50	6,496,507.50
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,232	29.51	597,046.32
COMERICA INC	7,736	45.71	353,612.56
EAST WEST BANCORP INC	6,421	42.20	270,966.20
FIFTH THIRD BANCORP	37,592	24.08	905,215.36
FIRST REPUBLIC BANK/CA	9,019	115.64	1,042,957.16
HUNTINGTON BANCSHARES INC	49,512	11.00	544,632.00
JPMORGAN CHASE & CO	158,917	110.54	17,566,685.18
KEY CORP	48,707	14.79	720,376.53
M & T BANK CORP	6,910	123.89	856,079.90

PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	22,684	13.51	306,574.26
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	22,432	126.19	2,830,694.08
REGIONS FINL CORP	46,000	13.46	619,160.00
SIGNATURE BANK	2,815	117.10	329,636.50
SVB FINANCIAL GROUP	2,758	234.31	646,226.98
TRUIST FINANCIAL CORP	68,647	44.68	3,067,147.96
US BANCORP	71,293	42.10	3,001,435.30
WELLS FARGO & CO	201,878	32.63	6,587,279.14
ZIONS BANCORPORATION	8,203	39.30	322,418.91
ALLY FINANCIAL INC	18,129	22.92	415,516.68
AMERICAN EXPRESS	35,469	110.46	3,917,905.74
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,178	159.59	985,947.02
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	9,341	52.07	486,385.87
BANK NEW YORK CO	40,579	41.42	1,680,782.18
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	71,688	196.07	14,055,866.16
BLACKROCK INC	7,909	558.06	4,413,696.54
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	35,123	58.35	2,049,427.05
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	24,035	78.47	1,886,026.45
CARLYLE GROUP INC/THE	7,865	29.95	235,556.75
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,888	103.05	606,758.40
CME GROUP INC	18,285	191.10	3,494,263.50
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	15,312	58.85	901,111.20
E*TRADE FINANCIAL CORP	10,854	51.97	564,082.38
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,238	22.12	491,904.56
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,887	304.90	575,346.30
FRANKLIN RESOURCES INC	14,748	23.65	348,790.20
GOLDMAN SACHS GROUP INC	17,056	218.10	3,719,913.60
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	28,496	97.44	2,776,650.24
INVESCO LTD	19,405	11.14	216,171.70
KKR & CO INC	25,570	31.55	806,733.50
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,975	499.93	987,361.75
MOODY'S CORP	8,719	274.98	2,397,550.62
MORGAN STANLEY	62,135	50.40	3,131,604.00
MSCI INC	4,264	327.16	1,395,010.24
NASDAQ INC	6,126	120.09	735,671.34
NORTHERN TRUST CORP	10,269	91.99	944,645.31
PRICE T ROWE GROUP INC	12,347	128.64	1,588,318.08
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,565	81.66	536,097.90
S&P GLOBAL INC	12,473	327.61	4,086,279.53
SCHWAB (CHARLES) CORP	59,165	40.18	2,377,249.70
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,289	59.88	376,585.32
STATE STREET CORP	17,955	70.48	1,265,468.40

SYNCHRONY FINANCIAL	28,151	25.86	727,984.86
TD AMERITRADE HOLDING CORP	12,743	43.33	552,154.19
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,522	65.01	293,975.22
VOYA FINANCIAL INC	6,370	51.41	327,481.70
AFLAC	35,967	40.20	1,445,873.40
ALLEGHANY CORP	778	561.88	437,142.64
ALLSTATE CORP	16,698	103.21	1,723,400.58
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,803	71.44	271,686.32
AMERICAN INT'L GROUP	45,065	37.74	1,700,753.10
AON PLC	11,989	194.29	2,329,342.81
ARCH CAPITAL GROUP LTD	19,644	34.38	675,360.72
ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,925	101.15	1,003,913.75
ASSURANT INC	3,282	116.70	383,009.40
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	6,517	35.57	231,809.69
BROWN & BROWN INC	12,618	43.05	543,204.90
CHUBB LTD	23,160	137.69	3,188,900.40
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,964	68.81	548,002.84
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,444	186.42	269,190.48
EVEREST RE GROUP LTD	2,144	227.46	487,674.24
FNF GROUP	14,864	35.08	521,429.12
GLOBE LIFE INC	5,519	85.01	469,170.19
HARTFORD FINANCIAL SVCS	17,456	44.98	785,170.88
LINCOLN NATIONAL CORP	9,779	47.21	461,666.59
LOEWS CORP	12,517	38.26	478,900.42
MARKEL CORP	699	1,031.90	721,298.10
MARSH & MCLENNAN COS	25,806	110.44	2,850,014.64
METLIFE INC	40,723	41.55	1,692,040.65
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,665	47.27	693,214.55
PROGRESSIVE CORP	29,923	81.02	2,424,361.46
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,846	71.76	1,495,908.96
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	3,361	98.14	329,848.54
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,195	189.14	415,162.30
TRAVELERS COS INC/THE	13,315	125.42	1,669,967.30
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,646	201.01	1,335,912.46
WR BERKLEY CORP	7,737	62.99	487,353.63
CBRE GROUP INC-A	16,805	53.33	896,210.65
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	47,400	4.39	208,086.00
JONES LANG LASALLE INC	2,230	120.32	268,313.60
WEYERHAEUSER CO	39,134	23.75	929,432.50
ACCENTURE PLC-CL A	32,894	207.34	6,820,241.96
ADOBE INC	24,951	397.16	9,909,539.16
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	8,444	102.73	867,452.12

ANSYS INC	4,507	285.27	1,285,711.89
AUTODESK INC	11,269	234.15	2,638,636.35
AUTOMATIC DATA PROCESS	22,087	157.69	3,482,899.03
AVALARA INC	4,011	100.90	404,709.90
BLACK KNIGHT INC	8,009	76.15	609,885.35
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	7,486	79.99	598,805.14
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	6,056	123.51	747,976.56
CADENCE DESIGN SYSTEMS	14,289	92.56	1,322,589.84
CDK GLOBAL INC	5,199	46.37	241,077.63
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,391	110.76	707,867.16
CITRIX SYSTEMS INC	6,139	140.22	860,810.58
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	28,687	57.19	1,640,609.53
COUPA SOFTWARE INC	3,528	224.59	792,353.52
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	5,578	93.90	523,774.20
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,100	103.83	218,043.00
DATADOG INC - CLASS A	5,705	73.74	420,686.70
DOCUSIGN INC	8,950	141.92	1,270,184.00
DROPBOX INC-CLASS A	10,931	21.93	239,716.83
DYNATRACE INC	7,027	37.96	266,744.92
EPAM SYSTEMS INC	2,881	235.00	677,035.00
FAIR ISAAC CORP	1,555	419.51	652,338.05
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	31,969	141.37	4,519,457.53
FISERV INC	29,511	107.39	3,169,186.29
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,483	276.61	1,240,042.63
FORTINET INC	7,709	135.92	1,047,807.28
GARTNER INC	4,660	131.24	611,578.40
GLOBAL PAYMENTS INC	15,374	185.45	2,851,108.30
GODADDY INC - CLASS A	8,747	79.63	696,523.61
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,453	107.44	478,430.32
INTL BUSINESS MACHINES CORP	46,038	131.87	6,071,031.06
INTUIT INC	13,520	291.25	3,937,700.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,785	178.86	676,985.10
LEIDOS HOLDINGS	7,121	105.69	752,618.49
MASTERCARD INC-CLASS A	46,279	311.49	14,415,445.71
MICROSOFT CORP	373,403	189.80	70,871,889.40
MONGODB INC	2,429	201.70	489,929.30
NORTONLIFELOCK INC	30,049	21.14	635,235.86
OKTA INC	5,957	180.07	1,072,676.99
ORACLE CORP	113,729	54.18	6,161,837.22
PALO ALTO NETWORKS INC	5,106	233.56	1,192,557.36
PAYCHEX INC	16,929	77.83	1,317,584.07
PAYCOM SOFTWARE INC	2,631	327.60	861,915.60

PAYPAL HOLDINGS INC	57,680	156.86	9,047,684.80
PTC INC	5,381	81.54	438,766.74
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,832	258.43	990,303.76
SALESFORCE.COM INC	43,628	174.56	7,615,703.68
SERVICENOW INC	9,852	388.83	3,830,753.16
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	16,471	31.32	515,871.72
SPLUNK INC	8,007	183.93	1,472,727.51
SQUARE INC - A	18,558	89.53	1,661,497.74
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,145	59.75	665,969.47
SYNOPSIS INC	7,870	189.62	1,492,309.40
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	2,173	362.98	788,755.54
TWILIO INC - A	6,209	194.27	1,206,222.43
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,028	355.61	721,177.08
VERISIGN INC	5,501	213.43	1,174,078.43
VISA INC-CLASS A SHARES	88,210	199.08	17,560,846.80
VMWARE INC-CLASS A	4,372	146.41	640,104.52
WESTERN UNION CO	20,387	24.39	497,238.93
WIX.COM LTD	2,600	215.87	561,262.00
WORKDAY INC-CLASS A	8,479	179.76	1,524,185.04
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	5,710	205.43	1,173,005.30
AMPHENOL CORPORATION	15,325	101.72	1,558,859.00
APPLE INC	226,159	343.99	77,796,434.41
ARISTA NETWORKS INC	2,873	231.40	664,812.20
ARROW ELECTRONICS INC	3,851	74.42	286,591.42
CDW CORP/DE	7,547	124.41	938,922.27
CISCO SYSTEMS	219,452	48.05	10,544,668.60
COGNEX CORP	9,214	57.45	529,344.30
CORNING	40,119	27.63	1,108,487.97
DELL TECHNOLOGIES -C	12,902	50.03	645,487.06
F5 NETWORKS INC	3,275	143.92	471,338.00
FLIR SYSTEMS INC	7,341	45.58	334,602.78
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	63,109	11.02	695,461.18
HP INC	68,031	17.50	1,190,542.50
IPG PHOTONICS CORP	1,782	165.59	295,081.38
JUNIPER NETWORKS INC	16,308	24.93	406,558.44
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	9,591	103.11	988,928.01
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,852	151.77	1,343,468.04
NETAPP INC	10,843	46.72	506,584.96
SEAGATE TECHNOLOGY	11,767	54.83	645,184.61
TE CONNECTIVITY LTD	17,320	87.08	1,508,225.60
TRIMBLE IMS HOLDINGS	13,321	43.92	585,124.92
WESTERN DIGITAL CORP	15,203	47.83	727,159.49

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,862	270.32	773,655.84
AT&T INC	370,351	32.62	12,080,849.62
CENTURYLINK INC	52,080	11.01	573,400.80
T-MOBILE US INC	22,419	103.19	2,313,416.61
VERIZON COMMUNICATIONS	213,956	57.86	12,379,494.16
AES CORP	32,456	13.84	449,191.04
ALLIANT ENERGY CORPORATION	12,663	50.77	642,900.51
AMEREN CORPORATION	12,485	75.27	939,745.95
AMERICAN ELECTRIC POWER	25,322	85.91	2,175,413.02
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,502	130.70	1,241,911.40
ATMOS ENERGY CORP	6,189	104.32	645,636.48
CENTERPOINT ENERGY INC	27,008	18.63	503,159.04
CMS ENERGY CORP	14,458	60.29	871,672.82
CONSOLIDATED EDISON INC	17,160	76.70	1,316,172.00
DOMINION ENERGY INC	43,513	85.85	3,735,591.05
DTE ENERGY COMPANY	9,677	115.00	1,112,855.00
DUKE ENERGY CORP	37,404	90.32	3,378,329.28
EDISON INTL	18,014	61.63	1,110,202.82
ENTERGY CORP	10,503	103.34	1,085,380.02
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,385	46.06	524,393.10
EVERGY INC	11,198	63.57	711,856.86
EVERSOURCE ENERGY	16,717	85.27	1,425,458.59
EXELON CORP	49,875	40.51	2,020,436.25
FIRSTENERGY CORP	28,016	42.89	1,201,606.24
NEXTERA ENERGY INC	25,334	258.67	6,553,145.78
NISOURCE INC	20,005	24.83	496,724.15
NRG ENERGY INC	12,298	36.40	447,647.20
OGE ENERGY CORP	10,926	33.53	366,348.78
PINNACLE WEST CAPITAL	6,029	80.11	482,983.19
PPL CORPORATION	40,367	28.37	1,145,211.79
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	26,177	53.67	1,404,919.59
SEMPRA ENERGY	15,245	130.31	1,986,575.95
SOUTHERN CO	54,791	59.36	3,252,393.76
UGI CORP	11,353	35.70	405,302.10
VISTRA ENERGY CORP	23,603	21.17	499,675.51
WEC ENERGY GROUP INC	16,258	93.44	1,519,147.52
XCEL ENERGY INC	26,974	66.37	1,790,264.38
ADVANCED MICRO DEVICES	60,763	56.39	3,426,425.57
ANALOG DEVICES	18,888	123.38	2,330,495.88
APPLIED MATERIALS	47,263	59.79	2,825,854.77
BROADCOM INC	20,698	315.32	6,526,493.36
INTEL CORP	220,486	63.04	13,899,437.44

	KLA CORP	8,203	191.03	1,567,019.09
	LAM RESEARCH CORP	7,443	302.33	2,250,242.19
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP	35,255	35.17	1,239,918.35
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	14,195	60.66	861,068.70
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,571	105.73	1,329,131.83
	MICRON TECHNOLOGY	56,557	53.15	3,006,004.55
	NVIDIA CORP	31,663	361.84	11,456,939.92
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,410	111.51	1,606,859.10
	ON SEMICONDUCTOR CORP	19,013	20.17	383,492.21
	QORVO INC	5,629	115.53	650,318.37
	QUALCOMM	59,276	89.75	5,320,021.00
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,947	134.51	1,203,460.97
	TERADYNE INC	8,937	74.86	669,068.50
	TEXAS INSTRUMENTS	48,400	132.12	6,394,608.00
	XILINX INC	13,064	95.83	1,251,923.12
	アメリカドル 小計	15,209,919		1,418,433,536.06 (152,892,950,851)
カナダドル	CAMECO CORP	19,186	14.40	276,278.40
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	63,312	28.44	1,800,593.28
	CENOVUS ENERGY INC	50,155	7.19	360,614.45
	ENBRIDGE	103,266	44.26	4,570,553.16
	IMPERIAL OIL	11,645	25.67	298,927.15
	INTER PIPELINE LTD	18,856	13.93	262,664.08
	KEYERA CORP	10,963	22.73	249,188.99
	PARKLAND CORP	8,544	37.02	316,298.88
	PEMBINA PIPELINE CORP	26,492	37.10	982,853.20
	SUNCOR ENERGY	79,772	27.61	2,202,504.92
	TC ENERGY CORP	47,876	62.58	2,996,080.08
	AGNICO EAGLE MINES	12,637	78.86	996,553.82
	B2GOLD CORP	61,440	6.97	428,236.80
	BARRICK GOLD CORP	91,164	32.64	2,975,592.96
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,302	47.26	345,092.52
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	39,365	9.68	381,053.20
	FRANCO-NEVADA CORP	9,757	173.46	1,692,449.22
	KINROSS GOLD CORP	60,197	8.36	503,246.92
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	12,974	50.98	661,414.52
	LUNDIN MINING CORP	30,173	6.91	208,495.43
	NUTRIEN LTD	30,716	51.33	1,576,652.28
	PAN AMERICAN SILVER CORP	12,397	36.22	449,019.34
	TECK RESOURCES LTD-CL B	28,309	15.85	448,697.65
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	23,487	51.20	1,202,534.40
	YAMANA GOLD INC	57,051	6.88	392,510.88

CAE INC	11,940	26.97	322,021.80
WSP GLOBAL INC	5,400	86.78	468,612.00
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	6,642	57.39	381,184.38
THOMSON REUTERS CORP	10,276	92.88	954,434.88
AIR CANADA	6,737	21.01	141,544.37
CANADIAN NATL RAILWAY CO	36,504	123.00	4,489,992.00
CP RAILWAY LIMITED	7,224	353.75	2,555,490.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,428	62.95	908,242.60
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,000	22.92	229,200.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	14,471	79.64	1,152,470.44
QUEBECOR INC -CL B	11,279	29.98	338,144.42
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	26,673	23.81	635,084.13
CANADIAN TIRE CORP -CL A	2,526	125.29	316,482.54
DOLLARAMA INC	16,037	46.84	751,173.08
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	45,007	41.36	1,861,489.52
EMPIRE CO LTD 'A'	7,330	30.09	220,559.70
LOBLAW COMPANIES LTD	9,068	65.99	598,397.32
METRO INC	13,499	55.80	753,244.20
WESTON (GEORGE) LTD	3,705	95.94	355,457.70
SAPUTO INC	10,742	32.90	353,411.80
BAUSCH HEALTH COS INC	14,544	26.67	387,888.48
CANOPY GROWTH CORP	13,748	23.71	325,965.08
CRONOS GROUP INC	8,200	10.07	82,574.00
BANK MONTREAL	32,874	77.29	2,540,831.46
BANK NOVA SCOTIA	62,306	60.67	3,780,105.02
CANADIAN IMPERIAL BANK	22,999	98.72	2,270,461.28
NATIONAL BANK OF CANADA	16,271	64.14	1,043,621.94
ROYAL BANK OF CANADA	72,967	94.64	6,905,596.88
TORONTO-DOMINION BANK	94,492	64.90	6,132,530.80
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	68,469	49.94	3,419,341.86
CI FINANCIAL CORP	9,872	18.03	177,992.16
IGM FINANCIAL INC	3,890	35.05	136,344.50
ONEX CORP	4,872	67.28	327,788.16
TMX GROUP LTD	3,330	129.31	430,602.30
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,399	425.09	594,700.91
GREAT-WEST LIFE CO INC	11,567	25.57	295,768.19
IA FINANCIAL CORP INC	5,415	49.14	266,093.10
INTACT FINANCIAL CORP	7,822	133.15	1,041,499.30
MANULIFE FINANCIAL CORP	100,839	19.93	2,009,721.27
POWER CORP OF CANADA	26,652	26.17	697,482.84
SUN LIFE FINANCIAL INC	29,501	51.65	1,523,726.65
BLACKBERRY LIMITED	25,075	7.52	188,564.00

	CGI INC - CL A	12,624	91.27	1,152,192.48
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,075	1,501.70	1,614,327.50
	OPEN TEXT CORP	13,214	57.90	765,090.60
	SHOPIFY INC - CLASS A	5,451	992.92	5,412,406.92
	BCE INC	7,663	59.22	453,802.86
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	17,504	58.94	1,031,685.76
	TELUS CORP	23,120	24.26	560,891.20
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	26,086	19.19	500,590.34
	ALTAGAS INCOME LTD	14,516	16.34	237,191.44
	ATCO LTD -CLASS I	4,372	39.33	171,950.76
	CANADIAN UTILITIES LTD A	5,978	33.34	199,306.52
	EMERA INC	11,783	54.52	642,409.16
	FORTIS INC	25,010	52.99	1,325,279.90
	HYDRO ONE LTD	14,740	25.87	381,323.80
	カナダドル 小計	2,006,764		93,392,392.83 (7,505,946,611)
ユーロ	ENI	131,368	9.37	1,231,706.36
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	23,722	11.48	272,447.17
	NESTE OIL OYJ	22,270	36.31	808,623.70
	OMV AG	8,201	34.00	278,834.00
	REPSOL SA	74,780	9.23	690,668.08
	TENARIS SA	19,529	6.77	132,289.44
	TOTAL SA	128,464	37.70	4,843,092.80
	VOPAK	3,661	48.61	177,961.21
	AIR LIQUIDE	24,133	126.20	3,045,584.60
	AKZO NOBEL	10,648	78.28	833,525.44
	ARCELORMITTAL	35,308	10.03	354,421.70
	ARKEMA	3,446	85.14	293,392.44
	BASF SE	46,973	56.23	2,641,291.79
	COVESTRO AG	8,327	35.41	294,859.07
	CRH PLC	42,400	31.76	1,346,624.00
	EVONIK INDUSTRIES AG	9,603	24.57	235,945.71
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	3,246	37.44	121,530.24
	HEIDELBERGCEMENT AG	6,759	49.62	335,381.58
	KONINKLIJKE DSM NV	9,403	116.15	1,092,158.45
	LANXESS	3,921	49.00	192,129.00
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	13,393	28.62	383,307.66
	SOLVAY SA	3,676	77.00	283,052.00
	STORA ENSO OYJ R	31,971	11.13	355,837.23
	SYMRISE AG	6,316	95.36	602,293.76
	THYSSEN KRUPP	18,959	7.31	138,704.04
	UMICORE	9,946	43.07	428,374.22

UPM KYMMENE OYJ	27,357	27.04	739,733.28
VOESTALPINE AG	5,948	20.42	121,458.16
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	13,660	25.81	352,564.60
AIRBUS SE	29,922	75.67	2,264,197.74
ALSTOM	9,679	42.67	413,002.93
ANDRITZ AG	3,617	35.20	127,318.40
BOUYGUES ORD	11,344	29.40	333,513.60
BRENTAG AG	8,461	48.73	412,304.53
CNH INDUSTRIAL NV	54,274	7.09	385,019.75
DASSAULT AVIATION SA	121	932.50	112,832.50
EIFFAGE	4,629	84.74	392,261.46
FERROVIAL SA	26,165	25.82	675,580.30
GEA GROUP AG	7,649	29.16	223,044.84
HOCHTIEF AG	998	84.30	84,131.40
KINGSPAN GROUP PLC	8,873	56.80	503,986.40
KION GROUP AG	3,430	54.92	188,375.60
KNORR-BREMSE AG	2,788	97.56	271,997.28
KONE OYJ-B	17,409	61.48	1,070,305.32
LEGRAND SA	13,518	64.56	872,722.08
LEONARDO SPA	22,011	6.84	150,687.30
METSO OYJ	4,950	32.13	159,043.50
MTU AERO ENGINES AG	2,894	168.45	487,494.30
PRYSMIAN SPA	11,275	20.45	230,573.75
SAFRAN SA	16,881	97.18	1,640,495.58
SAINT-GOBAIN	26,009	31.99	832,027.91
SCHNEIDER ELECTRIC SE	28,262	95.16	2,689,411.92
SIEMENS	39,741	106.94	4,249,902.54
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	12,322	15.65	192,839.30
THALES SA	6,091	76.32	464,865.12
VINCI S.A.	26,347	87.34	2,301,146.98
WARTSILA OYJ	18,738	8.00	149,978.95
BUREAU VERITAS SA	13,374	20.04	268,014.96
RANDSTAD NV	5,866	41.90	245,785.40
TELEPERFORMANCE	3,026	216.40	654,826.40
WOLTERS KLUWER	14,206	67.50	958,905.00
ADP	1,532	111.00	170,052.00
AENA SME SA	3,518	135.30	475,985.40
ATLANTIA SPA	26,089	15.40	401,770.60
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,748	11.85	115,513.80
DEUTSCHE POST AG-REG	50,993	31.21	1,591,491.53
FRAPORT AG	1,934	48.38	93,566.92
GETLINK	24,901	13.86	345,127.86

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,536	59.41	1,041,813.76
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	2,582	46.42	119,856.44
CONTINENTAL AG	5,742	94.92	545,030.64
DAIMLER AG	44,896	38.96	1,749,372.64
FAURECIA	3,558	36.39	129,475.62
FERRARI NV	6,665	153.35	1,022,077.75
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	59,582	8.99	535,880.50
MICHELIN	8,706	97.52	849,009.12
PEUGEOT SA	30,939	14.75	456,350.25
PIRELLI & C SPA	20,549	4.24	87,127.76
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	7,141	53.56	382,471.96
RENAULT SA	10,803	25.50	275,476.50
VALEO SA	10,585	23.87	252,663.95
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,592	145.56	1,396,211.52
VOLKSWAGEN STAMM	1,657	156.40	259,154.80
ADIDAS AG	9,932	251.30	2,495,911.60
ESSILORLUXOTTICA	14,558	121.35	1,766,613.30
HERMES INTERNATIONAL	1,673	765.00	1,279,845.00
KERING	3,882	525.00	2,038,050.00
LVMH	14,419	395.30	5,699,830.70
MONCLER SPA	9,963	34.16	340,336.08
PUMA SE	4,644	67.94	315,513.36
SEB SA	1,191	125.30	149,232.30
ACCOR	10,837	28.04	303,869.48
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	3,764	119.90	451,303.60
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,332	31.51	168,011.32
SODEXO	5,008	68.86	344,850.88
ALTICE NV -A	27,649	3.93	108,743.51
BOLLORE	37,200	3.01	112,046.40
JC DECAUX SA	3,750	20.58	77,175.00
PUBLICIS GROUPE	11,844	31.56	373,796.64
SCOUT24 AG	5,889	69.00	406,341.00
SES	16,206	7.38	119,632.69
TELENET GROUP HOLDING NV	2,831	39.78	112,617.18
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,969	67.08	333,320.52
VIVENDI	41,830	22.86	956,233.80
DELIVERY HERO SE	6,869	84.80	582,491.20
INDITEX	56,809	25.68	1,458,855.12
JUST EAT TAKEAWAY	6,525	98.60	643,365.00
PROSUS	25,025	75.94	1,900,398.50
ZALANDO SE	8,215	64.84	532,660.60
CARREFOUR	30,831	14.45	445,662.10

CASINO GUICHARD PERRACHON	3,298	35.18	116,023.64
COLRUYT SA	2,228	52.68	117,371.04
JERONIMO MARTINS	13,062	15.35	200,501.70
KONINKLIJKE AHOLD NV	56,607	23.64	1,338,189.48
METRO AG	8,880	9.21	81,802.56
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	39,098	48.88	1,911,110.24
DANONE (GROUPE)	31,644	64.02	2,025,848.88
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	26,648	7.39	196,982.01
HEINEKEN HOLDING NV	6,065	77.65	470,947.25
HEINEKEN NV	13,426	85.84	1,152,487.84
KERRY GROUP PLC-A	8,698	107.90	938,514.20
PERNOD-RICARD	11,159	146.70	1,637,025.30
REMY COINTREAU	1,020	115.70	118,014.00
BEIERSDORF AG	4,768	99.96	476,609.28
HENKEL AG & CO KGAA	5,620	77.05	433,021.00
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	9,117	83.86	764,551.62
LOREAL	13,079	266.00	3,479,014.00
UNILEVER NV	74,760	46.85	3,502,506.00
BIOMERIEUX	1,835	113.90	209,006.50
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,091	89.35	186,830.85
DIASORIN SPA	1,418	161.50	229,007.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	11,179	76.86	859,217.94
FRESENIUS SE&CO KGAA	21,184	44.07	933,578.88
KONINKLIJKE PHILIPS	46,463	41.64	1,934,951.63
ORPEA	2,927	104.75	306,603.25
SARTORIUS AG-VORZUG	1,793	277.40	497,378.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	8,210	43.28	355,328.80
BAYER	50,127	67.26	3,371,542.02
EUROFINS SCIENTIFIC	649	590.00	382,910.00
GALAPAGOS NV	2,380	180.75	430,185.00
GRIFOLS SA	14,240	28.01	398,862.40
IPSEN	1,866	76.30	142,375.80
MERCK KGAA	6,893	106.15	731,691.95
ORION OYJ-CLASS B	5,393	43.39	234,002.27
QIAGEN N.V.	11,006	38.90	428,133.40
RECORDATI SPA	5,195	41.48	215,488.60
SANOFI	58,592	90.46	5,300,232.32
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,536	211.60	325,017.60
UCB (GROUPE)	6,228	89.38	556,658.64
ABN AMRO BANK NV-CVA	19,718	8.56	168,904.38
BANCO BILBAO VIZCAYA	348,348	3.40	1,187,169.98
BANCO SANTANDER SA	850,073	2.50	2,125,607.53

BANKINTER SA	24,407	4.64	113,272.88
BNP PARIBAS	57,706	38.16	2,202,060.96
CAIXABANK	190,947	1.96	374,256.12
COMMERZBANK AG	55,963	4.40	246,293.16
CREDIT AGRICOLE SA	59,470	8.69	516,913.24
ERSTE GROUP BANK AG	14,009	24.16	338,457.44
FINECOBANK SPA	28,289	11.28	319,241.36
ING GROEP NV-CVA	205,683	6.98	1,435,667.34
INTESA SANPAOLO	767,057	1.72	1,319,338.04
KBC GROEP NV	12,075	53.60	647,220.00
MEDIOBANCA	29,447	7.09	208,897.01
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,866	18.14	142,689.24
SOCIETE GENERALE	39,271	16.46	646,714.82
UNICREDIT SPA	112,848	8.92	1,007,168.40
AMUNDI SA	2,812	69.90	196,558.80
DEUTSCHE BANK NAMEN	100,131	8.62	863,529.74
DEUTSCHE BOERSE	9,803	153.70	1,506,721.10
EURAZEO SA	2,340	49.22	115,174.80
EXOR NV	5,889	54.04	318,241.56
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,728	78.66	293,244.48
NATIXIS	40,748	2.47	100,810.55
SOFINA	961	234.00	224,874.00
WENDEL	1,047	90.25	94,491.75
AEGON	76,385	2.93	223,808.05
AGEAS	10,380	35.38	367,244.40
ALLIANZ SE-REG	21,685	187.42	4,064,202.70
ASSICURAZIONI GENERALI	57,446	14.26	819,467.19
AXA	99,192	19.40	1,924,919.95
CNP ASSURANCES	8,406	12.01	100,956.06
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,976	160.70	478,243.20
MAPFRE SA	56,454	1.81	102,633.37
MUENCHENER RUECKVERSICH.	7,421	236.40	1,754,324.40
NN GROUP NV	14,216	31.10	442,117.60
POSTE ITALIANE SPA	25,777	8.67	223,641.25
SAMPO OYJ-A SHS	25,888	32.09	830,745.92
SCOR SE	6,580	26.40	173,712.00
AROUNDTOWN SA	64,179	5.70	365,820.30
DEUTSCHE WOHNEN SE	18,904	39.86	753,513.44
LEG IMMOBILIEN AG	3,774	116.94	441,331.56
VONOVIA SE	27,050	53.04	1,434,732.00
ADYEN NV	955	1,147.50	1,095,862.50
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	22,353	52.54	1,174,426.62

ATOS SE	5,368	71.32	382,845.76
CAPGEMINI SA	8,103	97.06	786,477.18
DASSAULT SYSTEMES SA	6,970	153.15	1,067,455.50
ELENRED	12,673	41.68	528,210.64
NEMETSCHKE SE	3,320	61.60	204,512.00
NEXI SPA	19,721	14.60	287,926.60
SAP SE	54,136	120.68	6,533,132.48
TEAMVIEWER AG	7,213	44.01	317,480.19
WIRECARD AG	6,029	94.82	571,669.78
WORLDLINE SA	6,787	67.60	458,801.20
INGENICO GROUP	3,351	127.45	427,084.95
NOKIA OYJ	285,445	3.89	1,113,092.77
CELLNEX TELECOM SA	13,166	48.16	634,074.56
DEUTSCHE TELEKOM	170,460	15.19	2,589,287.40
ELISA A	6,757	53.80	363,526.60
ILIAD SA	637	162.65	103,608.05
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,877	9.06	134,785.62
KPN (KON.)	173,861	2.30	400,228.02
ORANGE	102,847	11.03	1,134,916.64
PROXIMUS	7,531	20.39	153,557.09
TELECOM ITALIA ORD	489,749	0.36	180,521.48
TELECOM ITALIA RNC	345,204	0.39	134,802.16
TELEFONICA	241,360	4.86	1,173,009.60
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,879	2.78	113,684.49
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,889	35.93	211,591.77
E.ON SE	116,273	10.25	1,191,798.25
ELECTRICITE DE FRANCE	32,823	8.59	282,146.50
ELIA GROUP SA/NV	1,959	96.30	188,651.70
ENAGAS	11,944	21.89	261,454.16
ENDESA	17,138	22.31	382,348.78
ENEL	414,960	7.54	3,129,628.32
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	139,401	4.19	585,205.39
ENGIE	96,938	11.86	1,149,684.68
FORTUM OYJ	24,235	17.47	423,385.45
IBERDROLA SA	301,197	10.15	3,057,149.55
NATURGY ENERGY GROUP SA	14,147	17.55	248,350.58
RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,296	16.70	389,043.20
RWE STAMM	30,919	29.81	921,695.39
SNAM SPA	108,807	4.48	488,434.62
SUEZ	17,194	10.89	187,328.63
TERNA SPA	66,644	6.18	412,126.49
UNIPER SE	8,984	28.74	258,200.16

	VEOLIA ENVIRONNEMENT	29,222	21.40	625,350.80
	VERBUND AG	3,100	41.22	127,782.00
	ASML HOLDING NV	22,070	309.40	6,828,458.00
	INFINEON TECHNOLOGIES	64,996	20.87	1,356,466.52
	STMICROELECTRONICS	35,439	24.05	852,307.95
	ユーロ 小計	9,678,209		196,274,596.90 (23,996,532,216)
イギリスポンド	BP PLC	1,054,601	3.53	3,723,268.83
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	212,968	14.37	3,062,053.90
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	190,441	13.84	2,636,465.20
	ANGLO AMERICAN PLC	65,072	18.65	1,213,853.08
	ANTOFAGASTA PLC	16,971	8.98	152,501.40
	BHP GROUP PLC	108,434	17.12	1,856,390.08
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,013	51.56	361,590.28
	EVRAZ PLC	34,476	3.03	104,738.08
	GLENCORE PLC	520,278	1.77	922,348.83
	JOHNSON MATTHEY PLC	8,385	21.80	182,793.00
	MONDI PLC	26,857	15.03	403,794.99
	RIO TINTO PLC REG	57,529	45.25	2,603,187.25
	ASHTED GROUP PLC	22,351	25.50	569,950.50
	BAE SYSTEMS PLC	161,098	5.30	854,785.98
	BUNZL PLC	18,853	19.89	374,986.17
	DCC PLC	4,508	67.92	306,183.36
	FERGUSON PLC	11,486	63.30	727,063.80
	MELROSE INDUSTRIES PLC	238,890	1.33	318,918.15
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	108,149	3.70	400,151.30
	SMITHS GROUP PLC	20,046	13.60	272,725.83
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,672	99.22	364,335.84
	EXPERIAN PLC	47,869	27.68	1,325,013.92
	INTERTEK GROUP PLC	8,461	53.38	451,648.18
	RELX PLC	99,360	18.66	1,854,057.60
	RENTOKIL INITIAL PLC	100,842	4.73	477,386.02
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	50,978	5.45	277,932.05
	BURBERRY GROUP PLC	18,236	16.63	303,264.68
	PERSIMMON PLC	16,612	24.05	399,518.60
	TAYLOR WIMPEY PLC	166,048	1.59	264,016.32
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,550	42.82	280,471.00
	COMPASS GROUP PLC	94,330	12.65	1,193,274.50
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,939	108.25	318,146.75
	GVC HOLDINGS PLC	33,300	7.85	261,671.40
	INTERCONTINENTAL HOTELS	9,162	41.80	382,971.60
	WHITBREAD PLC	10,170	26.53	269,810.10

AUTO TRADER GROUP PLC	54,849	5.40	296,184.60
INFORMA PLC	83,570	4.87	407,236.61
ITV PLC	154,979	0.86	133,281.94
PEARSON	33,153	5.32	176,373.96
WPP PLC	65,133	6.95	453,195.41
JD SPORTS FASHION PLC	22,866	6.45	147,577.16
KINGFISHER PLC	90,095	2.05	184,784.84
NEXT PLC	6,461	53.46	345,405.06
OCADO GROUP PLC	23,500	20.72	486,920.00
MORRISON SUPERMARKETS	111,872	1.85	207,075.07
SAINSBURY (J) PLC	82,018	1.96	161,411.42
TESCO	504,901	2.23	1,127,948.83
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,743	20.66	387,230.38
BRITISH AMERICAN TOBACCO	119,307	30.26	3,610,229.82
COCA-COLA HBC AG-CDI	9,115	21.35	194,605.25
DIAGEO	119,565	28.43	3,399,232.95
IMPERIAL BRANDS PLC	50,639	15.08	763,889.31
RECKITT BENCKISER PLC	36,241	68.70	2,489,756.70
UNILEVER PLC	60,996	43.34	2,643,566.64
SMITH & NEPHEW PLC	44,384	16.49	732,114.08
ASTRAZENECA	68,078	82.44	5,612,350.32
GLAXOSMITHKLINE	260,698	16.42	4,282,225.34
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	8,586	22.84	196,104.24
BARCLAYS	949,750	1.25	1,189,846.80
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,056,007	4.05	4,281,580.38
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,604,337	0.35	1,269,627.70
ROYAL BANK OF SCOTLAND	252,932	1.31	332,226.18
STANDARD CHARTERED PLC	142,008	4.42	628,811.42
3I GROUP PLC	50,412	8.70	438,584.40
HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,246	16.41	299,508.09
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	16,220	78.38	1,271,323.60
M&G PLC	112,358	1.70	191,064.77
SCHRODERS PLC	5,525	31.08	171,717.00
ST JAMES'S PLACE PLC	26,728	9.67	258,513.21
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	145,646	2.66	388,292.23
ADMIRAL GROUP PLC	9,872	22.65	223,600.80
AVIVA PIC	206,665	2.90	599,535.16
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	68,857	2.77	191,009.31
LEGAL & GENERAL GROUP	301,878	2.42	732,657.90
PRUDENTIAL	133,761	12.12	1,621,183.32
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	51,693	4.14	214,474.25
AVEVA GROUP PLC	3,423	41.83	143,184.09

	SAGE GROUP PLC	58,775	6.79	399,317.35
	HALMA PLC	20,325	22.20	451,215.00
	BT GROUP PLC	440,451	1.22	537,570.44
	VODAFONE GROUP PLC	1,372,561	1.38	1,907,036.25
	NATIONAL GRID PLC	178,513	9.26	1,653,030.38
	SEVERN TRENT PLC	11,927	25.21	300,679.67
	SSE PLC	52,436	12.43	651,779.48
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,716	9.06	314,804.68
	イギリスポンド 小計	14,912,706		78,572,142.36 (10,776,955,046)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	8,748	18.86	164,987.28
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	408	715.00	291,720.00
	GIVAUDAN-REG	475	3,338.00	1,585,550.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	28,037	42.86	1,201,665.82
	SIKA AG-BR	6,442	172.30	1,109,956.60
	ABB LTD	94,658	20.67	1,956,580.86
	GEBERIT AG-REG	1,882	472.00	888,304.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	911	222.60	202,788.60
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,021	224.20	453,108.20
	ADECCO GROUP AG-REG	8,520	48.67	414,668.40
	SGS SA	311	2,294.00	713,434.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,066	145.00	444,570.00
	CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	26,841	64.96	1,743,591.36
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	1,586	203.10	322,116.60
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,004	39.52	118,718.08
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	149	1,884.00	280,716.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	83,700.00	418,500.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	61	7,880.00	480,680.00
	NESTLE SA - REGISTERED	154,081	105.36	16,233,974.16
	ALCON INC	26,036	58.92	1,534,041.12
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,672	205.50	549,096.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	480	794.80	381,504.00
	LONZA GROUP AG-REG	3,833	468.90	1,797,293.70
	NOVARTIS	111,423	84.14	9,375,131.22
	ROCHE HOLDING GENUSS	36,398	333.20	12,127,813.60
	VIFOR PHARMA AG	2,126	146.30	311,033.80
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	250	92.40	23,100.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG	124,429	10.18	1,266,687.22
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,752	43.70	469,862.40
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,289	78.50	179,686.50
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	951	833.00	792,183.00
	UBS GROUP AG	193,183	11.06	2,137,569.89

	BALOISE HOLDING AG - REG	2,334	149.10	347,999.40	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,587	371.60	589,729.20	
	SWISS RE LTD	15,271	77.50	1,183,502.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,645	341.30	2,609,238.50	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,622	89.90	325,617.80	
	TEMENOS AG - REG	3,520	143.35	504,592.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	9,187	56.42	518,330.54	
	SWISSCOM	1,253	506.20	634,268.60	
	スイスフラン 小計	900,447		66,683,910.95 (7,557,287,627)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	9,250	234.90	2,172,825.00	
	BOLIDEN AB	13,081	214.00	2,799,334.00	
	SCA SV CELLULOSA B	31,928	110.70	3,534,429.60	
	ALFA LAVAL AB	14,233	209.00	2,974,697.00	
	ASSA ABLOY AB-B	52,153	199.70	10,414,954.10	
	ATLAS COPCO A	35,801	378.10	13,536,358.10	
	ATLAS COPCO B	20,378	337.20	6,871,461.60	
	EPIROC AB-A	35,996	114.70	4,128,741.20	
	EPIROC AB-B	21,132	114.50	2,419,614.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,081	182.00	1,470,742.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	16,465	202.50	3,334,162.50	
	SANDVIK AB	58,793	172.40	10,135,913.20	
	SKANSKA B	18,477	197.35	3,646,435.95	
	SKF AB-B	18,340	181.30	3,325,042.00	
	VOLVO B	77,339	149.85	11,589,249.15	
	SECURITAS B	15,577	126.30	1,967,375.10	
	ELECTROLUX AB-SER B	8,955	159.65	1,429,665.75	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,841	75.50	1,648,995.50	
	EVOLUTION GAMING GROUP	6,697	565.20	3,785,144.40	
	HENNES & MAURITZ B	38,673	159.70	6,176,078.10	
	ICA GRUPPEN AB	4,719	431.10	2,034,360.90	
	SWEDISH MATCH AB	8,284	637.20	5,278,564.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	32,556	287.10	9,346,827.60	
	NORDEA BANK ABP	175,522	71.25	12,505,942.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	84,995	85.90	7,301,070.50	
	SVENSKA HANDELSBK A	81,197	94.60	7,681,236.20	
SWEDBANK AB-A	46,881	131.18	6,149,849.58		
EQT AB	12,798	167.30	2,141,105.40		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,631	225.00	1,941,975.00		
INVESTOR AB-B SHS	23,675	516.60	12,230,505.00		
KINNEVIK AB - B	11,182	242.60	2,712,753.20		
LUNDBERGS AB-B SHS	4,093	436.40	1,786,185.20		

	ERICSSON (LM) B	151,614	85.28	12,929,641.92	
	HEXAGON AB-B SHS	14,685	543.40	7,979,829.00	
	TELE2 AB-B SHS	24,520	122.30	2,998,796.00	
	TELIA CO AB	133,145	33.31	4,435,059.95	
	スウェーデンクローナ 小計	1,341,687		196,814,921.00 (2,304,702,724)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	51,412	150.65	7,745,217.80	
	NORSK HYDRO	61,358	26.99	1,656,052.42	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,800	351.50	3,444,700.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	4,706	233.80	1,100,262.80	
	MOWI ASA	23,314	194.00	4,522,916.00	
	ORKLA	33,665	85.22	2,868,931.30	
	DNB ASA	48,569	141.20	6,857,942.80	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,153	185.00	2,063,305.00	
	TELENOR ASA	38,320	149.95	5,746,084.00	
	ノルウェークローネ 小計	282,297		36,005,412.12 (418,382,888)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,314	638.40	3,392,457.60	
	NOVOZYMES A/S	11,390	374.30	4,263,277.00	
	VESTAS WIND SYSYEMS	10,339	720.00	7,444,080.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	199	7,325.00	1,457,675.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	361	7,904.00	2,853,344.00	
	DSV PANALPINA A S	11,022	741.00	8,167,302.00	
	PANDORA A/S	5,549	352.40	1,955,467.60	
	CARLSBERG AS-B	5,576	905.00	5,046,280.00	
	AMBU A/S-B	8,639	213.50	1,844,426.50	
	COLOPLAST-B	6,101	1,033.00	6,302,333.00	
	DEMANT A/S	4,463	191.20	853,325.60	
	GN STORE NORD A/S	6,740	359.70	2,424,378.00	
	GENMAB A/S	3,382	1,878.00	6,351,396.00	
	H LUNDBECK A/S	3,647	260.80	951,137.60	
	NOVO NORDISK A/S-B	91,491	428.25	39,181,020.75	
	DANSKE BANK A/S	32,879	95.94	3,154,411.26	
	TRYG A/S	5,192	194.00	1,007,248.00	
	ORSTED A/S	9,837	748.80	7,365,945.60	
	デンマーククローネ 小計	222,121		104,015,505.51 (1,705,854,290)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	12,821	28.40	364,116.40	
	OIL SEARCH LTD	110,184	3.73	410,986.32	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	87,883	6.43	565,087.69	
	SANTOS	83,906	6.17	517,700.02	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	4,845	20.07	97,239.15	

WOODSIDE PETROLEUM LTD	48,027	24.65	1,183,865.55
BHP GROUP LTD	151,924	37.64	5,718,419.36
BLUESCOPE STEEL LTD	21,549	12.89	277,766.61
EVOLUTION MINING LTD	88,310	5.24	462,744.40
FORTESCUE METALS GROUP LTD	89,546	14.87	1,331,549.02
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	20,708	27.33	565,949.64
NEWCREST MINING LIMITED	40,587	28.39	1,152,264.93
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	40,122	12.81	513,962.82
ORICA LTD	19,570	17.73	346,976.10
RIO TINTO LTD	18,760	101.37	1,901,701.20
SOUTH32 LTD	268,050	2.34	627,237.00
CIMIC GROUP LIMITED	2,943	28.10	82,698.30
BRAMBLES LTD	82,211	11.23	923,229.53
AURIZON HOLDINGS LTD	93,604	4.80	449,299.20
QANTAS AIRWAYS LIMITED	39,948	4.93	196,943.64
TRANSURBAN GROUP	141,919	14.89	2,113,173.91
ARISTOCRAT LEISURE LTD	30,759	28.10	864,327.90
CROWN RESORTS LTD	18,801	10.79	202,862.79
TABCORP HOLDINGS LTD	90,583	3.62	327,910.46
REA GROUP LTD	3,000	106.10	318,300.00
SEEK LTD	17,113	20.40	349,105.20
WESFARMERS LTD	58,648	41.77	2,449,726.96
COLES GROUP LTD	70,757	16.07	1,137,064.99
WOOLWORTHS GROUP LTD	66,268	37.94	2,514,207.92
COCA-COLA AMATIL LIMITED	22,146	9.35	207,065.10
TREASURY WINE ESTATES LTD	34,480	11.44	394,451.20
COCHLEAR LIMITED	3,460	193.00	667,780.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,641	66.35	639,680.35
SONIC HEALTHCARE LTD	24,299	28.89	701,998.11
CSL LIMITED	23,444	278.50	6,529,154.00
AUST AND NZ BANKING GROUP	148,143	21.00	3,111,003.00
COMMONWEALTH BANK OF AUST	91,415	72.20	6,600,163.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	166,802	20.47	3,414,436.94
WESTPAC BANKING	188,299	19.88	3,743,384.12
AMP LTD	182,052	1.81	329,514.12
ASX LTD	10,329	86.46	893,045.34
MACQUARIE GROUP LIMITED	16,822	124.40	2,092,656.80
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	6,690	60.30	403,407.00
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	114,505	6.21	711,076.05
MEDIBANK PRIVATE LTD	129,252	2.90	374,830.80
QBE INSURANCE GROUP	78,439	9.56	749,876.84
SUNCORP GROUP LIMITED	58,518	10.28	601,565.04

	AFTERPAY LTD	11,615	50.70	588,880.50	
	COMPUTERSHARE LIMITED	21,970	13.65	299,890.50	
	WISETECH GLOBAL LTD	10,764	22.50	242,190.00	
	TELSTRA CORP	233,571	3.24	756,770.04	
	TPG TELECOM LTD	22,697	8.25	187,250.25	
	AGL ENERGY LTD	32,928	18.05	594,350.40	
	AUSNET SERVICES	147,386	1.75	258,662.43	
	オーストラリアドル 小計	3,613,013		63,059,498.94 (4,717,481,115)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	49,114	6.95	341,342.30	
	A2 MILK CO LTD	40,302	19.01	766,141.02	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	29,782	28.30	842,830.60	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	22,000	13.79	303,380.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	104,543	4.39	458,943.77	
	MERCURY NZ LTD	46,613	4.92	229,335.96	
	MERIDIAN ENERGY LTD	64,034	4.86	311,525.41	
	ニュージーランドドル 小計	356,388		3,253,499.06 (227,972,679)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	134,948	55.40	7,476,119.20	
	NWS HOLDINGS LTD	73,500	7.58	557,130.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	73,000	75.00	5,475,000.00	
	MTR CORP	82,500	42.60	3,514,500.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	112,000	56.35	6,311,200.00	
	SANDS CHINA LTD	127,000	34.10	4,330,700.00	
	SJM HOLDINGS LTD	150,000	9.70	1,455,000.00	
	WYNN MACAU LTD	60,800	15.62	949,696.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	103,300	25.40	2,623,820.00	
	WH GROUP LTD	516,000	6.92	3,570,720.00	
	BANK EAST ASIA	46,964	18.68	877,287.52	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	196,000	25.20	4,939,200.00	
	HANG SENG BANK	39,300	138.50	5,443,050.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	61,400	290.80	17,855,120.00	
	AIA GROUP LTD	629,000	74.20	46,671,800.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	131,948	47.80	6,307,114.40	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	115,000	17.20	1,978,000.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	79,761	32.40	2,584,256.40	
	KERRY PROPERTIES LTD	37,000	21.20	784,400.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	305,000	9.28	2,830,400.00	
SINO LAND CO	128,600	10.14	1,304,004.00		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	71,000	102.80	7,298,800.00		
SWIRE PACIFIC A	20,000	46.85	937,000.00		
SWIRE PROPERTIES LTD	69,000	20.60	1,421,400.00		

	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	61,000	35.90	2,189,900.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	40,000	62.30	2,492,000.00	
	PCCW LTD	212,000	4.50	954,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	32,000	43.05	1,377,600.00	
	CLP HOLDINGS	84,000	78.40	6,585,600.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	541,229	12.86	6,960,204.94	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	73,500	45.40	3,336,900.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	11,700	80.30	939,510.00	
	香港ドル 小計	4,418,450		162,331,432.46 (2,258,030,225)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	80,200	6.16	494,032.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	74,800	3.56	266,288.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	117,400	1.02	119,748.00	
	SINGAPORE AIRLINES	43,750	4.32	189,000.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	319,700	0.83	265,351.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,600	22.87	105,202.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	112,800	3.99	450,072.00	
	DBS GROUP	95,400	22.95	2,189,430.00	
	OCBC BANK	171,450	9.70	1,663,065.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	65,600	22.66	1,486,496.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	8.35	354,875.00	
	CAPITALAND LTD	118,900	3.16	375,724.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	22,000	9.01	198,220.00	
	UOL GROUP LIMITED	24,800	7.37	182,776.00	
	VENTURE CORP LTD	14,300	15.56	222,508.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	408,180	2.67	1,089,840.60		
	シンガポールドル 小計	1,716,380		9,652,627.60 (748,947,375)	
イスラエルシェケル	ICL LTD	28,484	12.46	354,910.64	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,248	514.80	642,470.40	
	BANK HAPOLIM BM	61,880	22.35	1,383,018.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	70,692	19.74	1,395,460.08	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,227	12.12	778,431.24	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,272	75.25	471,968.00	
	AZRIELI GROUP	1,471	187.00	275,077.00	
	NICE LTD	3,165	640.90	2,028,448.50	
	イスラエルシェケル 小計	237,439		7,329,783.86 (229,055,745)	
	合 計	54,895,820		215,340,099,392 (215,340,099,392)	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	オーストラリアドル	APA GROUP	63,405	725,987.25		
		LENDLEASE GROUP	36,448	485,122.88		
		SYDNEY AIRPORT	53,915	380,100.75		
	オーストラリアドル 小計		153,768	1,591,210.88	(119,038,485)	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	130,000	1,027,000.00		
		HKT TRUST AND HKT LTD	185,000	2,179,300.00		
	香港ドル 小計		315,000	3,206,300.00	(44,599,633)	
投資信託受益証券合計			468,768	163,638,118	(163,638,118)	
投資証券	アメリカドル	AGNC INVESTMENT CORP	29,331	407,994.21		
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6,461	1,034,341.49		
		AMERICAN TOWER CORPORATION	22,952	6,099,723.52		
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	71,103	503,409.24		
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,110	1,238,704.20		
		BOSTON PROPERTIES	7,834	817,321.22		
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,093	508,281.40		
		CROWN CASTLE INTL CORP	21,226	3,700,540.84		
		DIGITAL REALTY TRUST INC	13,504	1,910,545.92		
		DUKE REALTY CORP	19,101	704,826.90		
		EQUINIX INC	4,358	3,012,336.76		
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,979	596,834.13		
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	19,522	1,276,543.58		
		ESSEX PROPERTY TRUST	3,352	898,470.08		
		EXTRA SPACE STORAGE INC	6,715	691,309.25		
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,030	394,778.80		
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	24,568	718,859.68		
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,932	475,867.40		
		INVITATION HOMES INC	27,833	792,127.18		
		IRON MOUNTAIN INC	15,540	468,220.20		
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	27,097	554,946.56		
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,042	753,195.72		
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	9,434	361,605.22		
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	12,315	417,971.10		
		PROLOGIS INC	38,363	3,733,870.79		
		PUBLIC STORAGE	8,220	1,737,461.40		
REALTY INCOME CORP	17,572	1,104,400.20				
REGENCY CENTERS CORP	8,875	450,672.50				
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,697	1,756,100.25				

	SIMON PROPERTY GROUP	16,164	1,397,701.08	
	SUN COMMUNITIES INC	4,728	684,756.24	
	UDR INC	14,820	617,845.80	
	VENTAS INC	18,598	809,570.94	
	VEREIT INC	55,232	377,234.56	
	VICI PROPERTIES INC	24,099	530,178.00	
	VORNADO REALTY TRUST	7,639	344,518.90	
	WELLTOWER INC	21,558	1,284,856.80	
	WP CAREY INC	8,887	630,710.39	
	アメリカドル 小計	656,884	43,798,632.45 (4,721,054,591)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,069	245,593.05	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	7,000	106,750.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,945	156,537.50	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,942	68,430.92	
	カナダドル 小計	23,956	577,311.47 (46,398,522)	
ユーロ	BGP HOLDINGS PLC	1,605,584	-	
	COVIVIO(FP)	1,902	129,431.10	
	GECINA SA	2,760	332,028.00	
	ICADE	1,843	128,088.50	
	KLEPIERRE	8,356	176,562.28	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,340	498,386.00	
	ユーロ 小計	1,627,785	1,264,495.88 (154,597,266)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	39,175	171,547.32	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,132	210,850.18	
	SEGRO PLC	58,155	499,435.14	
	イギリスポンド 小計	129,462	881,832.64 (120,952,164)	
オーストラリアドル	DEXUS	59,885	599,448.85	
	GOODMAN GROUP	84,283	1,254,131.04	
	GPT GROUP	84,564	386,457.48	
	MIRVAC GROUP	176,235	454,686.30	
	SCENTRE GROUP	274,323	748,901.79	
	STOCKLAND	121,481	496,857.29	
	VICINITY CENTERS	163,023	300,777.43	
	オーストラリアドル 小計	963,794	4,241,260.18 (317,288,674)	
香港ドル	LINK REIT	108,900	7,465,095.00	
	香港ドル 小計	108,900	7,465,095.00 (103,839,471)	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	139,548	456,321.96	

シンガポールドル	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	110,000	205,700.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	117,100	261,133.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	132,200	284,230.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	165,400	317,568.00	
	SUNTEC REIT	113,000	178,540.00	
シンガポールドル 小計		777,248	1,703,492.96	(132,174,018)
投資証券合計		4,288,029	5,596,304,706	(5,596,304,706)
合計			5,759,942,824	(5,759,942,824)

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

#### 有価証券明細表注記

- 1.通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
- 2.合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 3.通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
- 4.外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資信託 受益証券 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 590銘柄	97.0%			69.2%
	投資証券 38銘柄			3.0%	2.1%
カナダドル	株式 81銘柄	99.4%			3.4%
	投資証券 4銘柄			0.6%	0.0%
ユーロ	株式 241銘柄	99.4%			10.9%
	投資証券 6銘柄			0.6%	0.1%
イギリスポンド	株式 85銘柄	98.9%			4.9%
	投資証券 3銘柄			1.1%	0.1%
スイスフラン	株式 40銘柄	100.0%			3.4%
スウェーデンクローナ	株式 36銘柄	100.0%			1.0%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%			0.2%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%			0.8%
オーストラリアドル	株式 54銘柄	91.5%			2.1%
	投資信託受益証券 3銘柄		2.3%		0.1%
	投資証券 7銘柄			6.2%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港ドル	株式 32銘柄	93.8%			1.0%
	投資信託受益証券 2銘柄		1.9%		0.0%

	投資証券 1銘柄			4.3%	0.0%
シンガポールドル	株式 16銘柄	85.0%			0.3%
	投資証券 6銘柄			15.0%	0.1%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 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

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

## 外国債券マザーファンド

### 貸借対照表

	2020年 6月10日現在
項目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	76,285,786
コール・ローン	4,113,458,307
国債証券	135,597,791,229
派生商品評価勘定	63,441,699
未収入金	34,152,409
未収利息	780,966,601
前払金	19,966,648
前払費用	85,411,026
差入委託証拠金	316,188,754
流動資産合計	141,087,662,459
資産合計	141,087,662,459
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	24,045,421
未払金	45,176
未払解約金	118,275,232
未払利息	6,058
その他未払費用	6,478
流動負債合計	142,378,365
負債合計	142,378,365
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	55,718,442,750
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	85,226,841,344
元本等合計	140,945,284,094
純資産合計	140,945,284,094
負債純資産合計	141,087,662,459

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年 6月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までは個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>(2)為替予約取引による為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2020年 6月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	55,718,442,750口

	2020年 6月10日現在	
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,5296円 (25,296円)

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	2020年 6月10日現在
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスク、流動性リスク等に晒されております。 また、当ファンドは、ファンド運用の効率化を図ることを目的として債券先物取引及び為替予約取引を行っております。債券先物取引に係る主要なリスクは、債券価格の変動による価格変動リスクであります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変動により損失が発生する信用リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した運用監理部が、運用に関するリスク管理と法令等遵守状況のモニタリングを担当し、毎月開催される運用リスク管理委員会及び経営会議に報告します。 内部監査部は、業務執行に係る内部管理態勢の適切性・有効性を独立した立場から検証・評価し、監査結果等を取締役会に報告するとともに、指摘事項の是正・改善状況の事後点検を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	2020年 6月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 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)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

	2020年 6月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

（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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	2020年 6月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月11日
期首元本額	56,698,877,187円
期中追加設定元本額	12,357,419,792円
期中一部解約元本額	13,337,854,229円
期末元本額	55,718,442,750円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,194,281,027円
D C 外国債券インデックスファンド	2,101,271,876円
D C 外国債券インデックスファンド L	13,041,379,492円
D C バランスファンド 3 0	802,415,126円
D C バランスファンド 5 0	802,732,110円

区分	2020年 6月10日現在
DCバランスファンド70	161,986,078円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	396,437,785円
外国債券インデックスe	1,209,823,636円
インデックスコレクション（外国債券）	6,889,322,145円
インデックスコレクション（バランス株式30）	4,414,868,231円
インデックスコレクション（バランス株式50）	538,942,070円
インデックスコレクション（バランス株式70）	141,456,109円
私募外国債券パッシブファンド（適格機関投資家専用）	4,063,378,888円
外国債券パッシブファンド私募A（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	1,700,586,989円
外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	587,002,446円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	128,778,436円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	638,833,532円
VAバランスファンド（株25/100）（適格機関投資家専用）	367,421,520円
VAバランスファンド（株50/100）（適格機関投資家専用）	444,368,839円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	771,268円
VAバランスファンド（株60/100）（適格機関投資家専用）	1,304,816,298円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,812,827,514円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	654,369,436円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	6,494,225,202円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	303,444,154円
VAバランスファンド（株40/100）（適格機関投資家専用）	316,255,194円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,688,479,207円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	120,336,088円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	206,023,548円
VAバランスファンド2（株40/100）（適格機関投資家専用）	105,794,369円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	54,312,815円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	109,860,823円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	279,226,131円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	80,759,491円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	1,552,808,423円
私募外国債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	8,846,454円

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	2020年 6月10日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	2,153,569,959
合計	2,153,569,959

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、「外国債券マザーファンド」の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 債券関連

（2020年 6月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	3,861,795,273	-	3,841,828,625	19,966,648
	合計	3,861,795,273	-	3,841,828,625	19,966,648

## (注)1.時価の算定方法

債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2020年 6月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	4,009,847,369	-	4,069,207,800	59,360,431
	アメリカドル	1,877,898,090	-	1,878,605,400	707,310
	カナダドル	180,809,537	-	185,631,600	4,822,063
	ユーロ	1,667,149,119	-	1,712,862,600	45,713,481
	イギリスポンド 売建	283,990,623	-	292,108,200	8,117,577
	イギリスポンド	31,976,445	-	31,973,950	2,495
	イギリスポンド	31,976,445	-	31,973,950	2,495
	合計	4,041,823,814	-	4,101,181,750	59,362,926

## (注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の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によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の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、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 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

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.625% 03/31/27	3,400,000.00	3,399,734.39	
		T 1.125% 06/30/21	4,000,000.00	4,039,062.52	
		T 1.25% 07/31/23	3,950,000.00	4,071,431.65	
		T 1.25% 10/31/21	4,950,000.00	5,021,446.27	
		T 1.375% 08/31/23	3,450,000.00	3,571,962.88	
		T 1.375% 09/30/23	3,550,000.00	3,678,132.81	
		T 1.375% 10/15/22	2,250,000.00	2,310,205.07	
		T 1.5% 01/31/22	3,000,000.00	3,062,988.27	
		T 1.5% 02/15/30	1,820,000.00	1,936,025.00	
		T 1.5% 02/28/23	1,760,000.00	1,820,018.74	
		T 1.5% 03/31/23	4,000,000.00	4,140,625.00	
		T 1.5% 08/15/22	5,800,000.00	5,961,539.04	
		T 1.5% 08/15/26	8,300,000.00	8,772,386.69	
		T 1.5% 09/30/24	8,000,000.00	8,391,250.00	
		T 1.625% 02/15/26	5,750,000.00	6,111,171.87	
		T 1.625% 04/30/23	5,800,000.00	6,029,054.70	
		T 1.625% 05/15/26	5,400,000.00	5,744,882.82	
		T 1.625% 05/31/23	4,350,000.00	4,526,548.83	
		T 1.625% 08/15/22	1,400,000.00	1,442,929.68	
		T 1.625% 08/15/29	6,260,000.00	6,732,434.37	
		T 1.625% 08/31/22	500,000.00	515,507.81	
		T 1.625% 09/30/26	2,150,000.00	2,289,666.02	
		T 1.625% 11/15/22	4,000,000.00	4,134,687.52	
		T 1.625% 11/30/26	5,030,000.00	5,359,307.81	
		T 1.75% 01/31/23	2,650,000.00	2,755,171.87	
		T 1.75% 02/28/22	3,650,000.00	3,746,382.81	
		T 1.75% 03/31/22	2,500,000.00	2,569,091.80	
		T 1.75% 04/30/22	2,000,000.00	2,058,203.12	
		T 1.75% 05/15/22	4,600,000.00	4,736,203.14	
		T 1.75% 05/15/23	1,750,000.00	1,826,562.50	
		T 1.75% 05/31/22	2,650,000.00	2,729,862.30	
		T 1.75% 06/30/22	2,500,000.00	2,578,320.32	
		T 1.75% 06/30/24	2,000,000.00	2,113,906.26	
T 1.75% 07/15/22	1,200,000.00	1,238,343.75			

T 1.75% 09/30/22	1,050,000.00	1,086,791.01	
T 1.75% 11/15/29	3,220,000.00	3,501,246.87	
T 1.875% 01/31/22	1,550,000.00	1,592,019.53	
T 1.875% 03/31/22	5,100,000.00	5,252,402.33	
T 1.875% 04/30/22	2,800,000.00	2,887,609.36	
T 1.875% 05/31/22	2,350,000.00	2,426,788.08	
T 1.875% 06/30/26	3,980,000.00	4,294,979.70	
T 1.875% 07/31/22	2,880,000.00	2,981,700.00	
T 1.875% 07/31/26	1,800,000.00	1,943,226.55	
T 1.875% 08/31/22	2,600,000.00	2,695,164.05	
T 1.875% 09/30/22	1,500,000.00	1,556,777.34	
T 1.875% 10/31/22	2,000,000.00	2,078,359.38	
T 1.875% 11/30/21	3,500,000.00	3,585,859.37	
T 2.125% 02/29/24	1,400,000.00	1,493,898.43	
T 2.125% 03/31/24	1,200,000.00	1,281,937.50	
T 2.125% 05/15/25	7,250,000.00	7,857,187.50	
T 2.125% 06/30/21	3,000,000.00	3,060,878.91	
T 2.125% 06/30/22	1,100,000.00	1,143,140.62	
T 2.125% 07/31/24	1,500,000.00	1,609,921.87	
T 2.125% 08/15/21	2,900,000.00	2,965,759.76	
T 2.125% 09/30/21	2,000,000.00	2,050,039.06	
T 2.125% 09/30/24	2,200,000.00	2,365,773.43	
T 2.125% 11/30/23	2,700,000.00	2,871,175.78	
T 2.125% 11/30/24	1,400,000.00	1,508,773.43	
T 2.125% 12/31/22	3,800,000.00	3,982,578.14	
T 2.25% 01/31/24	5,090,000.00	5,448,884.75	
T 2.25% 02/15/27	3,900,000.00	4,319,250.00	
T 2.25% 04/15/22	2,680,000.00	2,780,395.31	
T 2.25% 04/30/24	7,600,000.00	8,165,843.78	
T 2.25% 07/31/21	4,500,000.00	4,605,029.28	
T 2.25% 08/15/27	2,320,000.00	2,581,181.26	
T 2.25% 08/15/46	6,680,000.00	7,655,384.40	
T 2.25% 08/15/49	5,110,000.00	5,917,220.31	
T 2.25% 10/31/24	2,500,000.00	2,704,785.15	
T 2.25% 11/15/24	5,000,000.00	5,413,476.55	
T 2.25% 11/15/25	6,500,000.00	7,120,546.87	
T 2.25% 11/15/27	5,260,000.00	5,864,900.00	
T 2.25% 12/31/23	3,500,000.00	3,741,718.75	
T 2.25% 12/31/24	2,900,000.00	3,145,140.62	
T 2.375% 01/31/23	5,000,000.00	5,280,859.40	
T 2.375% 04/30/26	1,820,000.00	2,014,939.07	
T 2.375% 05/15/27	3,600,000.00	4,026,375.00	

T 2.375% 05/15/29	3,890,000.00	4,432,168.75
T 2.375% 08/15/24	6,700,000.00	7,263,480.45
T 2.375% 11/15/49	2,010,000.00	2,390,643.75
T 2.5% 01/15/22	4,000,000.00	4,145,546.88
T 2.5% 01/31/25	4,000,000.00	4,389,375.00
T 2.5% 02/15/45	2,150,000.00	2,567,570.31
T 2.5% 02/15/46	4,750,000.00	5,692,949.24
T 2.5% 02/28/26	650,000.00	723,150.38
T 2.5% 05/15/24	3,700,000.00	4,014,210.95
T 2.5% 08/15/23	3,450,000.00	3,694,195.31
T 2.625% 01/31/26	1,350,000.00	1,509,943.35
T 2.625% 02/15/29	5,390,000.00	6,239,767.18
T 2.625% 03/31/25	2,500,000.00	2,765,039.07
T 2.625% 12/15/21	6,320,000.00	6,550,334.35
T 2.75% 02/15/24	8,900,000.00	9,694,742.23
T 2.75% 02/15/28	4,670,000.00	5,394,214.86
T 2.75% 04/30/23	4,200,000.00	4,502,203.14
T 2.75% 08/15/42	1,450,000.00	1,801,625.00
T 2.75% 08/15/47	3,950,000.00	4,990,269.55
T 2.75% 11/15/23	4,450,000.00	4,824,425.80
T 2.75% 11/15/42	1,040,000.00	1,291,468.75
T 2.75% 11/15/47	2,500,000.00	3,161,718.75
T 2.875% 04/30/25	2,300,000.00	2,575,191.41
T 2.875% 05/15/28	2,260,000.00	2,639,962.50
T 2.875% 05/15/43	1,050,000.00	1,330,957.03
T 2.875% 05/15/49	4,400,000.00	5,746,125.00
T 2.875% 08/15/28	4,200,000.00	4,920,234.39
T 2.875% 08/15/45	3,580,000.00	4,571,492.20
T 2.875% 10/15/21	4,250,000.00	4,402,236.31
T 2.875% 11/15/21	7,000,000.00	7,265,781.25
T 2% 02/15/22	3,100,000.00	3,192,939.45
T 2% 02/15/23	6,500,000.00	6,804,687.50
T 2% 02/15/25	6,050,000.00	6,501,859.37
T 2% 02/15/50	1,920,000.00	2,115,600.00
T 2% 04/30/24	8,000,000.00	8,518,750.00
T 2% 05/31/21	5,500,000.00	5,596,357.41
T 2% 05/31/24	1,500,000.00	1,598,964.84
T 2% 06/30/24	1,000,000.00	1,067,031.25
T 2% 07/31/22	3,900,000.00	4,048,382.83
T 2% 08/15/25	3,750,000.00	4,050,292.98
T 2% 08/31/21	4,200,000.00	4,292,121.07
T 2% 10/31/21	4,200,000.00	4,304,425.77
T 2% 10/31/22	4,500,000.00	4,689,492.21

T 2% 11/15/21	1,300,000.00	1,333,312.50
T 2% 11/15/26	2,700,000.00	2,939,941.41
T 2% 11/30/22	5,500,000.00	5,739,765.62
T 2% 12/31/21	3,380,000.00	3,473,676.15
T 3.125% 02/15/42	1,300,000.00	1,711,937.50
T 3.125% 02/15/43	2,100,000.00	2,763,140.62
T 3.125% 08/15/44	2,600,000.00	3,440,328.13
T 3.125% 11/15/28	5,260,000.00	6,288,165.62
T 3.125% 11/15/41	870,000.00	1,143,574.22
T 3.375% 05/15/44	2,000,000.00	2,744,843.76
T 3.5% 02/15/39	1,100,000.00	1,517,398.44
T 3.625% 02/15/44	2,650,000.00	3,767,140.62
T 3.625% 08/15/43	1,600,000.00	2,268,875.00
T 3.75% 08/15/41	1,100,000.00	1,574,804.69
T 3.75% 11/15/43	2,500,000.00	3,613,476.57
T 3.875% 08/15/40	680,000.00	986,956.25
T 3% 02/15/48	4,400,000.00	5,824,843.77
T 3% 02/15/49	1,940,000.00	2,587,020.32
T 3% 05/15/42	1,100,000.00	1,421,320.31
T 3% 05/15/45	2,100,000.00	2,733,445.31
T 3% 05/15/47	3,400,000.00	4,483,750.00
T 3% 08/15/48	6,910,000.00	9,181,122.69
T 3% 09/30/25	3,660,000.00	4,148,953.12
T 3% 10/31/25	5,950,000.00	6,753,482.40
T 3% 11/15/44	2,050,000.00	2,661,796.87
T 4.25% 05/15/39	850,000.00	1,281,839.84
T 4.25% 11/15/40	900,000.00	1,369,687.50
T 4.375% 02/15/38	500,000.00	758,867.19
T 4.375% 05/15/40	750,000.00	1,155,292.97
T 4.375% 05/15/41	550,000.00	851,425.78
T 4.375% 11/15/39	650,000.00	997,089.84
T 4.5% 02/15/36	100,000.00	149,757.81
T 4.5% 08/15/39	750,000.00	1,164,785.16
T 4.625% 02/15/40	1,500,000.00	2,372,812.50
T 4.75% 02/15/41	350,000.00	565,386.72
T 5.0% 05/15/37	650,000.00	1,042,894.53
T 5.25% 02/15/29	500,000.00	690,312.50
T 5.25% 11/15/28	900,000.00	1,234,476.56
T 5.375% 02/15/31	750,000.00	1,100,039.06
T 5.5% 08/15/28	250,000.00	345,488.28
T 6.0% 02/15/26	600,000.00	784,968.75
T 6.125% 11/15/27	1,050,000.00	1,469,179.68

	T 6.25% 05/15/30	720,000.00	1,096,425.00
	T 6.25% 08/15/23	1,350,000.00	1,606,658.20
	T 8.0% 11/15/21	2,600,000.00	2,890,570.30
	アメリカドル 小計	512,710,000.00	568,577,924.01 (61,287,014,429)
カナダドル	CAN 0.5% 03/01/22	1,110,000.00	1,114,462.20
	CAN 0.75% 09/01/21	1,740,000.00	1,751,057.70
	CAN 1.25% 03/01/25	1,640,000.00	1,703,115.40
	CAN 1.25% 06/01/30	270,000.00	285,930.00
	CAN 1.5% 02/01/22	1,220,000.00	1,244,387.80
	CAN 1.5% 05/01/22	990,000.00	1,012,369.05
	CAN 1.5% 06/01/23	2,010,000.00	2,082,169.05
	CAN 1.5% 06/01/26	840,000.00	891,786.00
	CAN 1.75% 03/01/23	700,000.00	727,566.00
	CAN 1% 06/01/27	1,060,000.00	1,095,494.10
	CAN 1% 09/01/22	2,360,000.00	2,396,721.60
	CAN 2.25% 03/01/24	670,000.00	716,397.50
	CAN 2.25% 06/01/25	1,530,000.00	1,669,138.20
	CAN 2.25% 06/01/29	390,000.00	446,598.75
	CAN 2.5% 06/01/24	1,780,000.00	1,929,511.10
	CAN 2.75% 06/01/22	1,000,000.00	1,049,140.00
	CAN 2.75% 12/01/48	870,000.00	1,195,314.75
	CAN 2.75% 12/01/64	290,000.00	446,283.90
	CAN 2% 06/01/28	530,000.00	589,749.55
	CAN 2% 12/01/51	640,000.00	774,563.20
	CAN 3.25% 06/01/21	1,400,000.00	1,441,104.00
	CAN 3.5% 12/01/45	1,490,000.00	2,246,212.25
	CAN 4.0% 06/01/41	820,000.00	1,259,733.20
	CAN 5.75% 06/01/29	960,000.00	1,390,507.20
CAN 5.75% 06/01/33	1,060,000.00	1,704,230.90	
CAN 5% 06/01/37	800,000.00	1,298,680.00	
CAN 8.0% 06/01/27	480,000.00	725,138.40	
	カナダドル 小計	28,650,000.00	33,187,361.80 (2,667,268,267)
メキシコペ ソ	MBONO 10% 11/20/36	6,400,000.00	8,364,352.00
	MBONO 10% 12/05/24	24,100,000.00	28,517,771.00
	MBONO 5.75% 03/05/26	13,280,000.00	13,328,538.40
	MBONO 6.5% 06/09/22	17,400,000.00	17,878,935.00
	MBONO 6.5% 06/10/21	21,190,000.00	21,490,686.10
	MBONO 6.75% 03/09/23	5,800,000.00	6,039,946.00
	MBONO 7.25% 12/09/21	10,190,000.00	10,515,621.45
	MBONO 7.5% 06/03/27	20,200,000.00	21,993,154.00
	MBONO 7.75% 05/29/31	10,950,000.00	12,077,904.75

	MBONO 7.75% 11/13/42	13,980,000.00	14,720,870.10
	MBONO 7.75% 11/23/34	4,320,000.00	4,757,292.00
	MBONO 8.5% 05/31/29	20,040,000.00	23,208,925.20
	MBONO 8.5% 11/18/38	8,200,000.00	9,381,948.00
	MBONO 8% 09/05/24	5,910,000.00	6,506,407.65
	MBONO 8% 11/07/47	9,720,000.00	10,505,473.20
	MBONO 8% 12/07/23	12,820,000.00	13,968,928.40
	メキシコペソ 小計	204,500,000.00	223,256,753.25 (1,100,655,793)
ユーロ	BGB 0.1% 06/22/30	1,010,000.00	1,014,176.35
	BGB 0.2% 10/22/23	640,000.00	654,675.20
	BGB 0.4% 06/22/40	260,000.00	249,814.50
	BGB 0.5% 10/22/24	350,000.00	363,854.75
	BGB 0.8% 06/22/25	1,100,000.00	1,163,811.00
	BGB 0.8% 06/22/27	750,000.00	800,655.00
	BGB 0.8% 06/22/28	780,000.00	835,824.60
	BGB 0.9% 06/22/29	790,000.00	854,661.50
	BGB 0% 10/22/27	1,170,000.00	1,179,728.55
	BGB 1.25% 04/22/33	330,000.00	373,289.40
	BGB 1.45% 06/22/37	400,000.00	464,128.00
	BGB 1.6% 06/22/47	810,000.00	978,848.55
	BGB 1.7% 06/22/50	490,000.00	609,508.55
	BGB 1.9% 06/22/38	510,000.00	632,185.80
	BGB 1% 06/22/26	1,260,000.00	1,355,029.20
	BGB 1% 06/22/31	1,140,000.00	1,248,556.50
	BGB 2.15% 06/22/66	440,000.00	653,474.80
	BGB 2.25% 06/22/23	970,000.00	1,051,446.05
	BGB 2.25% 06/22/57	380,000.00	551,758.10
	BGB 2.6% 06/22/24	1,200,000.00	1,347,750.00
	BGB 3.75% 06/22/45	620,000.00	1,054,136.40
	BGB 3% 06/22/34	500,000.00	685,625.00
	BGB 4.25% 03/28/41	1,070,000.00	1,823,397.70
	BGB 4.25% 09/28/21	1,130,000.00	1,200,184.30
	BGB 4.25% 09/28/22	940,000.00	1,044,424.60
	BGB 4.5% 03/28/26	750,000.00	959,242.50
	BGB 4% 03/28/22	790,000.00	854,918.25
	BGB 4% 03/28/32	450,000.00	650,931.75
	BGB 5.5% 03/28/28	1,190,000.00	1,712,826.50
	BGB 5% 03/28/35	1,180,000.00	1,971,951.10
	BKO 0% 06/11/21	900,000.00	905,458.50
	BKO 0% 12/10/21	1,180,000.00	1,190,915.00
	BTPS 0.05% 01/15/23	330,000.00	327,812.10
	BTPS 0.35% 02/01/25	1,740,000.00	1,708,262.40

BTPS 0.35% 11/01/21	800,000.00	802,908.00	
BTPS 0.45% 06/01/21	820,000.00	823,419.40	
BTPS 0.65% 10/15/23	560,000.00	563,701.60	
BTPS 0.85% 01/15/27	1,100,000.00	1,081,767.50	
BTPS 0.9% 08/01/22	1,500,000.00	1,521,090.00	
BTPS 0.95% 03/01/23	1,720,000.00	1,747,580.20	
BTPS 0.95% 08/01/30	980,000.00	930,358.10	
BTPS 1.2% 04/01/22	1,000,000.00	1,018,150.00	
BTPS 1.25% 12/01/26	1,170,000.00	1,185,280.20	
BTPS 1.35% 04/01/30	350,000.00	346,479.00	
BTPS 1.35% 04/15/22	1,000,000.00	1,020,940.00	
BTPS 1.45% 03/01/36	600,000.00	562,983.00	
BTPS 1.45% 05/15/25	1,070,000.00	1,101,516.85	
BTPS 1.45% 09/15/22	1,550,000.00	1,590,803.75	
BTPS 1.45% 11/15/24	600,000.00	619,173.00	
BTPS 1.5% 06/01/25	1,500,000.00	1,548,307.50	
BTPS 1.6% 06/01/26	1,350,000.00	1,398,964.50	
BTPS 1.65% 03/01/32	1,340,000.00	1,341,782.20	
BTPS 1.75% 07/01/24	990,000.00	1,032,961.05	
BTPS 1.85% 05/15/24	380,000.00	398,031.00	
BTPS 2.05% 08/01/27	1,430,000.00	1,514,613.10	
BTPS 2.1% 07/15/26	1,470,000.00	1,563,705.15	
BTPS 2.15% 12/15/21	1,700,000.00	1,752,547.00	
BTPS 2.2% 06/01/27	1,840,000.00	1,967,815.60	
BTPS 2.25% 09/01/36	990,000.00	1,029,911.85	
BTPS 2.45% 09/01/33	990,000.00	1,066,452.75	
BTPS 2.45% 09/01/50	410,000.00	412,349.30	
BTPS 2.45% 10/01/23	870,000.00	926,093.25	
BTPS 2.5% 11/15/25	1,650,000.00	1,787,610.00	
BTPS 2.5% 12/01/24	1,300,000.00	1,399,333.00	
BTPS 2.7% 03/01/47	1,240,000.00	1,324,964.80	
BTPS 2.8% 03/01/67	600,000.00	635,493.00	
BTPS 2.8% 12/01/28	1,260,000.00	1,407,401.10	
BTPS 2.95% 09/01/38	1,100,000.00	1,237,896.00	
BTPS 2% 12/01/25	1,050,000.00	1,111,304.25	
BTPS 3.1% 03/01/40	930,000.00	1,064,915.10	
BTPS 3.25% 09/01/46	680,000.00	794,930.20	
BTPS 3.35% 03/01/35	850,000.00	1,004,929.50	
BTPS 3.45% 03/01/48	1,120,000.00	1,355,121.60	
BTPS 3.5% 03/01/30	1,950,000.00	2,305,348.50	
BTPS 3.75% 08/01/21	1,900,000.00	1,979,800.00	
BTPS 3.75% 09/01/24	1,740,000.00	1,958,926.80	

BTPS 3.85% 09/01/49	1,510,000.00	1,953,268.05
BTPS 3% 08/01/29	1,760,000.00	2,000,064.00
BTPS 4.5% 03/01/24	1,810,000.00	2,069,047.20
BTPS 4.5% 03/01/26	2,250,000.00	2,689,740.00
BTPS 4.5% 05/01/23	1,050,000.00	1,173,600.75
BTPS 4.75% 08/01/23	1,610,000.00	1,826,963.60
BTPS 4.75% 09/01/21	2,630,000.00	2,780,212.45
BTPS 4.75% 09/01/28	1,650,000.00	2,092,018.50
BTPS 4.75% 09/01/44	1,020,000.00	1,469,264.10
BTPS 4% 02/01/37	1,800,000.00	2,288,142.00
BTPS 5.0% 08/01/39	1,440,000.00	2,077,358.40
BTPS 5.25% 11/01/29	2,300,000.00	3,067,314.50
BTPS 5.5% 09/01/22	1,700,000.00	1,897,608.00
BTPS 5.5% 11/01/22	2,200,000.00	2,471,568.00
BTPS 5.75% 02/01/33	1,570,000.00	2,276,500.00
BTPS 5% 03/01/22	1,450,000.00	1,570,313.75
BTPS 5% 03/01/25	1,740,000.00	2,078,360.40
BTPS 5% 08/01/34	1,800,000.00	2,488,491.00
BTPS 5% 09/01/40	1,600,000.00	2,314,968.00
BTPS 6.5% 11/01/27	2,070,000.00	2,835,247.95
BTPS 6% 05/01/31	1,940,000.00	2,783,560.50
BTPS 7.25% 11/01/26	350,000.00	483,621.25
BTPS 9% 11/01/23	1,800,000.00	2,315,610.00
DBR 0.25% 02/15/27	2,870,000.00	3,016,872.25
DBR 0.25% 02/15/29	2,680,000.00	2,829,986.20
DBR 0.25% 08/15/28	1,300,000.00	1,372,273.50
DBR 0.5% 02/15/25	1,140,000.00	1,198,681.50
DBR 0.5% 02/15/26	2,300,000.00	2,438,908.50
DBR 0.5% 02/15/28	1,510,000.00	1,621,906.10
DBR 0.5% 08/15/27	900,000.00	964,089.00
DBR 0% 02/15/30	960,000.00	989,404.80
DBR 0% 08/15/26	1,620,000.00	1,673,419.50
DBR 0% 08/15/29	2,430,000.00	2,508,561.90
DBR 0% 08/15/50	630,000.00	594,912.15
DBR 1.25% 08/15/48	1,400,000.00	1,818,278.00
DBR 1.5% 02/15/23	950,000.00	1,005,005.00
DBR 1.5% 05/15/23	1,180,000.00	1,254,576.00
DBR 1.5% 05/15/24	1,020,000.00	1,105,323.00
DBR 1.5% 09/04/22	920,000.00	964,035.80
DBR 1.75% 02/15/24	1,250,000.00	1,359,881.25
DBR 1.75% 07/04/22	1,650,000.00	1,731,402.75
DBR 1% 08/15/24	1,610,000.00	1,718,618.65
DBR 1% 08/15/25	760,000.00	822,574.60

DBR 2.25% 09/04/21	1,950,000.00	2,018,396.25
DBR 2.5% 07/04/44	1,750,000.00	2,755,672.50
DBR 2.5% 08/15/46	2,090,000.00	3,365,652.40
DBR 2% 01/04/22	1,370,000.00	1,427,259.15
DBR 2% 08/15/23	1,890,000.00	2,049,232.50
DBR 3.25% 07/04/21	2,210,000.00	2,300,775.75
DBR 3.25% 07/04/42	1,410,000.00	2,402,308.65
DBR 4.0% 01/04/37	1,450,000.00	2,432,382.25
DBR 4.25% 07/04/39	1,470,000.00	2,668,138.20
DBR 4.75% 07/04/28	700,000.00	994,812.00
DBR 4.75% 07/04/34	1,840,000.00	3,126,086.40
DBR 4.75% 07/04/40	1,310,000.00	2,560,113.35
DBR 5.5% 01/04/31	1,780,000.00	2,880,218.00
DBR 5.625% 01/04/28	1,500,000.00	2,196,495.00
DBR 6.25% 01/04/24	1,370,000.00	1,707,746.10
DBR 6.25% 01/04/30	610,000.00	1,000,006.55
DBR 6.5% 07/04/27	1,920,000.00	2,878,137.60
FRTR 0.25% 11/25/26	2,050,000.00	2,115,938.25
FRTR 0.5% 05/25/25	3,350,000.00	3,500,750.00
FRTR 0.5% 05/25/26	2,250,000.00	2,357,842.50
FRTR 0.5% 05/25/29	1,900,000.00	1,992,378.00
FRTR 0.75% 05/25/28	2,960,000.00	3,166,918.80
FRTR 0.75% 05/25/52	630,000.00	623,457.45
FRTR 0.75% 11/25/28	2,510,000.00	2,687,406.80
FRTR 0% 02/25/22	2,970,000.00	2,996,863.65
FRTR 0% 02/25/26	790,000.00	803,449.75
FRTR 0% 03/25/23	1,880,000.00	1,907,485.60
FRTR 0% 03/25/24	2,050,000.00	2,087,494.50
FRTR 0% 03/25/25	2,850,000.00	2,904,178.50
FRTR 0% 05/25/22	1,350,000.00	1,364,721.75
FRTR 0% 11/25/29	3,300,000.00	3,299,637.00
FRTR 1.25% 05/25/34	1,830,000.00	2,074,423.95
FRTR 1.25% 05/25/36	2,010,000.00	2,281,953.00
FRTR 1.5% 05/25/31	2,950,000.00	3,405,539.00
FRTR 1.5% 05/25/50	1,520,000.00	1,823,414.80
FRTR 1.75% 05/25/23	2,600,000.00	2,775,968.00
FRTR 1.75% 05/25/66	850,000.00	1,144,856.50
FRTR 1.75% 06/25/39	2,010,000.00	2,475,546.15
FRTR 1.75% 11/25/24	1,980,000.00	2,175,525.00
FRTR 1% 05/25/27	2,480,000.00	2,688,952.40
FRTR 1% 11/25/25	2,240,000.00	2,406,196.80
FRTR 2.25% 05/25/24	2,040,000.00	2,262,451.80

FRTR 2.25% 10/25/22	1,700,000.00	1,813,475.00
FRTR 2.5% 05/25/30	2,450,000.00	3,053,520.75
FRTR 2.75% 10/25/27	2,400,000.00	2,924,688.00
FRTR 2% 05/25/48	2,140,000.00	2,833,113.90
FRTR 3.25% 05/25/45	1,770,000.00	2,827,990.95
FRTR 3.25% 10/25/21	4,120,000.00	4,333,869.20
FRTR 3.5% 04/25/26	3,120,000.00	3,824,043.60
FRTR 3% 04/25/22	3,750,000.00	4,000,143.75
FRTR 4.25% 10/25/23	2,870,000.00	3,337,465.60
FRTR 4.5% 04/25/41	2,340,000.00	4,175,624.70
FRTR 4.75% 04/25/35	1,810,000.00	2,987,233.05
FRTR 4% 04/25/55	970,000.00	1,917,025.55
FRTR 4% 04/25/60	1,080,000.00	2,240,416.80
FRTR 4% 10/25/38	1,600,000.00	2,605,784.00
FRTR 5.5% 04/25/29	2,500,000.00	3,739,712.50
FRTR 5.75% 10/25/32	2,720,000.00	4,588,939.20
FRTR 6.0% 10/25/25	1,450,000.00	1,950,018.00
FRTR 8.5% 04/25/23	1,100,000.00	1,386,858.00
IRISH 0.2% 05/15/27	530,000.00	538,570.10
IRISH 0.8% 03/15/22	750,000.00	767,051.25
IRISH 0.9% 05/15/28	440,000.00	469,902.40
IRISH 1.1% 05/15/29	400,000.00	434,508.00
IRISH 1.3% 05/15/33	530,000.00	590,573.70
IRISH 1.35% 03/18/31	340,000.00	378,896.00
IRISH 1.5% 05/15/50	260,000.00	303,040.40
IRISH 1.7% 05/15/37	560,000.00	661,138.80
IRISH 1% 05/15/26	730,000.00	779,607.15
IRISH 2.4% 05/15/30	770,000.00	935,523.05
IRISH 2% 02/18/45	580,000.00	748,797.40
IRISH 3.4% 03/18/24	420,000.00	479,648.40
IRISH 3.9% 03/20/23	580,000.00	649,631.90
IRISH 5.4% 03/13/25	700,000.00	889,241.50
NETHER 0.25% 07/15/25	630,000.00	653,262.75
NETHER 0.25% 07/15/29	800,000.00	833,028.00
NETHER 0.5% 01/15/40	620,000.00	665,244.50
NETHER 0.5% 07/15/26	1,260,000.00	1,329,608.70
NETHER 0.75% 07/15/27	900,000.00	970,042.50
NETHER 0.75% 07/15/28	790,000.00	855,779.35
NETHER 0% 01/15/22	900,000.00	908,091.00
NETHER 0% 01/15/24	550,000.00	560,873.50
NETHER 0% 07/15/30	850,000.00	861,241.25
NETHER 1.75% 07/15/23	1,170,000.00	1,254,321.90
NETHER 2.25% 07/15/22	750,000.00	795,022.50

NETHER 2.5% 01/15/33	810,000.00	1,071,889.20
NETHER 2.75% 01/15/47	1,110,000.00	1,843,965.30
NETHER 2% 07/15/24	1,560,000.00	1,723,168.20
NETHER 3.25% 07/15/21	1,330,000.00	1,385,700.40
NETHER 3.75% 01/15/23	300,000.00	334,069.50
NETHER 3.75% 01/15/42	1,010,000.00	1,787,058.65
NETHER 4% 01/15/37	970,000.00	1,604,006.55
NETHER 5.5% 01/15/28	1,010,000.00	1,459,576.25
NETHER 7.5% 01/15/23	700,000.00	848,484.00
OBL 0% 04/05/24	2,260,000.00	2,312,590.20
OBL 0% 04/08/22	1,460,000.00	1,476,614.80
OBL 0% 04/11/25	1,700,000.00	1,747,183.50
OBL 0% 04/14/23	2,110,000.00	2,148,074.95
OBL 0% 10/07/22	1,530,000.00	1,552,391.55
OBL 0% 10/08/21	1,120,000.00	1,128,797.60
OBL 0% 10/18/24	1,390,000.00	1,425,597.90
RAGB 0.5% 02/20/29	700,000.00	737,313.50
RAGB 0.5% 04/20/27	890,000.00	936,929.70
RAGB 0.75% 02/20/28	620,000.00	664,912.80
RAGB 0.75% 03/20/51	260,000.00	278,057.00
RAGB 0.75% 10/20/26	600,000.00	640,611.00
RAGB 0% 02/20/30	210,000.00	211,044.75
RAGB 0% 07/15/23	650,000.00	659,941.75
RAGB 0% 07/15/24	590,000.00	601,142.15
RAGB 0% 09/20/22	430,000.00	435,243.85
RAGB 1.2% 10/20/25	430,000.00	466,816.60
RAGB 1.5% 02/20/47	450,000.00	569,277.00
RAGB 1.5% 11/02/86	270,000.00	372,894.30
RAGB 1.65% 10/21/24	560,000.00	612,228.40
RAGB 1.75% 10/20/23	750,000.00	807,517.50
RAGB 2.1% 09/20/17	340,000.00	605,642.00
RAGB 2.4% 05/23/34	530,000.00	695,354.70
RAGB 3.15% 06/20/44	520,000.00	852,901.40
RAGB 3.4% 11/22/22	1,210,000.00	1,327,454.70
RAGB 3.5% 09/15/21	950,000.00	998,454.75
RAGB 3.65% 04/20/22	500,000.00	539,110.00
RAGB 3.8% 01/26/62	230,000.00	504,043.85
RAGB 4.15% 03/15/37	860,000.00	1,414,347.40
RAGB 4.85% 03/15/26	760,000.00	990,150.80
RAGB 6.25% 07/15/27	820,000.00	1,198,585.80
RFGB 0.125% 04/15/36	200,000.00	196,815.00
RFGB 0.5% 04/15/26	530,000.00	556,563.60

RFGB 0.5% 09/15/27	380,000.00	400,451.60
RFGB 0.5% 09/15/28	450,000.00	475,065.00
RFGB 0.5% 09/15/29	290,000.00	306,041.35
RFGB 0.75% 04/15/31	270,000.00	292,473.45
RFGB 0.875% 09/15/25	300,000.00	320,010.00
RFGB 0% 04/15/22	250,000.00	252,441.25
RFGB 0% 09/15/23	100,000.00	101,666.00
RFGB 0% 09/15/24	300,000.00	305,803.50
RFGB 1.125% 04/15/34	280,000.00	317,059.40
RFGB 1.375% 04/15/47	230,000.00	288,257.85
RFGB 1.5% 04/15/23	590,000.00	624,187.55
RFGB 1.625% 09/15/22	380,000.00	398,827.10
RFGB 2.625% 07/04/42	340,000.00	510,727.60
RFGB 2.75% 07/04/28	380,000.00	470,728.80
RFGB 2% 04/15/24	410,000.00	449,681.85
RFGB 4% 07/04/25	320,000.00	392,528.00
SPGB 0.05% 10/31/21	3,470,000.00	3,489,674.90
SPGB 0.25% 07/30/24	810,000.00	822,283.65
SPGB 0.35% 07/30/23	1,570,000.00	1,596,525.15
SPGB 0.4% 04/30/22	1,040,000.00	1,054,508.00
SPGB 0.45% 10/31/22	800,000.00	814,380.00
SPGB 0.5% 04/30/30	2,200,000.00	2,186,767.00
SPGB 0.6% 10/31/29	1,200,000.00	1,209,894.00
SPGB 0.75% 07/30/21	500,000.00	506,542.50
SPGB 0.8% 07/30/27	480,000.00	497,664.00
SPGB 0% 01/31/25	710,000.00	710,812.95
SPGB 0% 04/30/23	1,580,000.00	1,589,566.90
SPGB 1.25% 10/31/30	1,200,000.00	1,274,226.00
SPGB 1.3% 10/31/26	1,460,000.00	1,566,302.60
SPGB 1.4% 04/30/28	1,020,000.00	1,102,926.00
SPGB 1.4% 07/30/28	1,320,000.00	1,428,207.00
SPGB 1.45% 04/30/29	750,000.00	813,468.75
SPGB 1.45% 10/31/27	1,840,000.00	1,993,713.60
SPGB 1.5% 04/30/27	1,970,000.00	2,142,828.10
SPGB 1.6% 04/30/25	1,250,000.00	1,349,112.50
SPGB 1.85% 07/30/35	920,000.00	1,031,757.00
SPGB 1.95% 04/30/26	1,340,000.00	1,487,125.30
SPGB 1.95% 07/30/30	1,680,000.00	1,905,304.80
SPGB 1% 10/31/50	540,000.00	476,199.00
SPGB 2.15% 10/31/25	1,260,000.00	1,403,375.40
SPGB 2.35% 07/30/33	1,290,000.00	1,530,862.35
SPGB 2.7% 10/31/48	1,070,000.00	1,381,434.20
SPGB 2.75% 10/31/24	1,560,000.00	1,754,922.00

	SPGB 2.9% 10/31/46	1,100,000.00	1,461,135.50	
	SPGB 3.45% 07/30/66	900,000.00	1,395,126.00	
	SPGB 3.8% 04/30/24	1,500,000.00	1,730,700.00	
	SPGB 4.2% 01/31/37	1,320,000.00	1,959,124.20	
	SPGB 4.4% 10/31/23	1,320,000.00	1,525,854.00	
	SPGB 4.65% 07/30/25	1,410,000.00	1,747,145.10	
	SPGB 4.7% 07/30/41	1,300,000.00	2,131,701.00	
	SPGB 4.8% 01/31/24	1,150,000.00	1,358,201.75	
	SPGB 4.9% 07/30/40	1,310,000.00	2,173,663.35	
	SPGB 5.15% 10/31/28	750,000.00	1,042,646.25	
	SPGB 5.15% 10/31/44	890,000.00	1,590,372.15	
	SPGB 5.4% 01/31/23	920,000.00	1,057,553.80	
	SPGB 5.75% 07/30/32	1,450,000.00	2,297,496.00	
	SPGB 5.85% 01/31/22	1,780,000.00	1,961,577.80	
	SPGB 5.9% 07/30/26	1,360,000.00	1,840,134.40	
	SPGB 6.0% 01/31/29	2,350,000.00	3,455,310.75	
	ユーロ 小計	375,940,000.00	445,118,424.05 (54,420,178,524)	
イギリスポ ンド	UKT 0.125% 01/31/23	150,000.00	150,213.00	
	UKT 0.5% 07/22/22	1,800,000.00	1,818,981.00	
	UKT 0.5% 10/22/61	200,000.00	191,690.00	
	UKT 0.625% 06/07/25	2,130,000.00	2,187,712.35	
	UKT 0.75% 07/22/23	1,500,000.00	1,533,165.00	
	UKT 0.875% 10/22/29	1,130,000.00	1,192,438.15	
	UKT 1.25% 07/22/27	1,190,000.00	1,283,123.45	
	UKT 1.25% 10/22/41	350,000.00	386,961.75	
	UKT 1.5% 07/22/26	1,060,000.00	1,151,764.20	
	UKT 1.5% 07/22/47	1,310,000.00	1,556,804.00	
	UKT 1.625% 10/22/28	1,940,000.00	2,169,919.10	
	UKT 1.625% 10/22/54	600,000.00	770,430.00	
	UKT 1.625% 10/22/71	610,000.00	899,603.60	
	UKT 1.75% 01/22/49	800,000.00	1,010,052.00	
	UKT 1.75% 07/22/57	930,000.00	1,265,330.10	
	UKT 1.75% 09/07/22	1,640,000.00	1,703,878.00	
	UKT 1.75% 09/07/37	1,540,000.00	1,817,092.20	
	UKT 1% 04/22/24	1,450,000.00	1,503,751.50	
	UKT 2.25% 09/07/23	1,160,000.00	1,243,206.80	
	UKT 2.5% 07/22/65	1,260,000.00	2,189,665.80	
	UKT 2.75% 09/07/24	420,000.00	468,205.50	
	UKT 2% 09/07/25	420,000.00	463,436.40	
	UKT 3.25% 01/22/44	1,430,000.00	2,206,168.25	
UKT 3.5% 01/22/45	1,470,000.00	2,381,392.65		

	UKT 3.5% 07/22/68	1,170,000.00	2,575,912.95
	UKT 3.75% 07/22/52	1,110,000.00	2,082,765.15
	UKT 3.75% 09/07/21	1,650,000.00	1,725,495.75
	UKT 4.25% 03/07/36	1,490,000.00	2,310,431.25
	UKT 4.25% 06/07/32	1,290,000.00	1,862,244.00
	UKT 4.25% 09/07/39	1,060,000.00	1,747,404.70
	UKT 4.25% 12/07/27	750,000.00	977,632.50
	UKT 4.25% 12/07/40	1,130,000.00	1,898,151.40
	UKT 4.25% 12/07/46	1,260,000.00	2,323,465.20
	UKT 4.25% 12/07/49	930,000.00	1,796,002.05
	UKT 4.25% 12/07/55	1,040,000.00	2,212,516.80
	UKT 4.5% 09/07/34	910,000.00	1,405,317.55
	UKT 4.5% 12/07/42	1,230,000.00	2,197,456.50
	UKT 4.75% 12/07/30	1,550,000.00	2,254,273.50
	UKT 4.75% 12/07/38	880,000.00	1,511,136.00
	UKT 4% 01/22/60	1,000,000.00	2,177,690.00
	UKT 4% 03/07/22	910,000.00	973,181.30
	UKT 5% 03/07/25	1,600,000.00	1,972,336.00
	UKT 6.0% 12/07/28	450,000.00	667,329.75
	UKT 8% 06/07/21	50,000.00	53,930.75
	イギリスポンド 小計	47,950,000.00	66,269,657.90 (9,089,546,277)
スウェーデン クローナ	SGB 0.75% 05/12/28	2,800,000.00	2,973,712.00
	SGB 0.75% 11/12/29	3,770,000.00	4,012,976.50
	SGB 1.5% 11/13/23	5,670,000.00	6,014,367.45
	SGB 1% 11/12/26	4,200,000.00	4,503,534.00
	SGB 2.5% 05/12/25	4,150,000.00	4,705,124.75
	SGB 3.5% 03/30/39	2,950,000.00	4,524,769.00
	SGB 3.5% 06/01/22	6,990,000.00	7,513,516.05
	スウェーデンクローナ 小計	30,530,000.00	34,247,999.75 (401,044,077)
ノルウェー クローネ	NGB 1.375% 08/19/30	2,690,000.00	2,858,420.90
	NGB 1.5% 02/19/26	3,460,000.00	3,663,742.10
	NGB 1.75% 02/17/27	2,900,000.00	3,132,826.50
	NGB 1.75% 03/13/25	2,110,000.00	2,243,668.50
	NGB 1.75% 09/06/29	2,050,000.00	2,247,220.25
	NGB 2% 04/26/28	2,160,000.00	2,392,891.20
	NGB 2% 05/24/23	5,000,000.00	5,253,650.00
	NGB 3% 03/14/24	3,640,000.00	4,002,052.60
	ノルウェークローネ 小計	24,010,000.00	25,794,472.05 (299,731,765)
デンマーク クローネ	DGB 0.5% 11/15/27	5,450,000.00	5,770,160.25
	DGB 0.5% 11/15/29	5,780,000.00	6,151,654.00

	DGB 1.5% 11/15/23	3,890,000.00	4,156,056.55
	DGB 1.75% 11/15/25	5,030,000.00	5,624,470.55
	DGB 3% 11/15/21	5,670,000.00	5,956,845.30
	DGB 4.5% 11/15/39	8,440,000.00	15,557,536.40
デンマーククローネ 小計		34,260,000.00	43,216,723.05 (708,754,258)
ポーランド ズロチ	POLGB 0% 07/25/22	310,000.00	308,538.35
	POLGB 1.75% 07/25/21	2,050,000.00	2,086,684.75
	POLGB 2.25% 04/25/22	3,900,000.00	4,047,615.00
	POLGB 2.25% 10/25/24	1,320,000.00	1,407,720.60
	POLGB 2.5% 01/25/23	1,550,000.00	1,636,846.50
	POLGB 2.5% 04/25/24	2,180,000.00	2,338,050.00
	POLGB 2.5% 07/25/26	2,780,000.00	3,022,082.40
	POLGB 2.5% 07/25/27	1,910,000.00	2,081,689.90
	POLGB 2.75% 04/25/28	1,920,000.00	2,129,788.80
	POLGB 2.75% 10/25/29	2,200,000.00	2,471,612.00
	POLGB 3.25% 07/25/25	1,710,000.00	1,913,148.00
	POLGB 4% 10/25/23	2,550,000.00	2,848,834.50
	POLGB 5.75% 04/25/29	900,000.00	1,235,997.00
	POLGB 5.75% 09/23/22	1,500,000.00	1,686,472.50
POLGB 5.75% 10/25/21	1,130,000.00	1,216,964.80	
ポーランドズロチ 小計		27,910,000.00	30,432,045.10 (837,185,560)
オーストラ リアドル	ACGB 0.25% 11/21/24	1,310,000.00	1,302,094.15
	ACGB 1.5% 06/21/31	1,190,000.00	1,239,254.10
	ACGB 1% 12/21/30	2,220,000.00	2,201,574.00
	ACGB 2.25% 05/21/28	1,450,000.00	1,606,020.00
	ACGB 2.5% 05/21/30	2,480,000.00	2,823,752.80
	ACGB 2.75% 04/21/24	1,400,000.00	1,530,018.00
	ACGB 2.75% 05/21/41	510,000.00	595,279.65
	ACGB 2.75% 06/21/35	390,000.00	462,534.15
	ACGB 2.75% 11/21/27	1,900,000.00	2,171,595.50
	ACGB 2.75% 11/21/28	1,750,000.00	2,012,036.25
	ACGB 2.75% 11/21/29	1,440,000.00	1,667,260.80
	ACGB 2% 12/21/21	690,000.00	708,060.75
	ACGB 3.25% 04/21/25	1,750,000.00	1,988,927.50
	ACGB 3.25% 04/21/29	2,330,000.00	2,785,153.85
	ACGB 3.25% 06/21/39	550,000.00	690,178.50
	ACGB 3.75% 04/21/37	810,000.00	1,076,380.65
	ACGB 3% 03/21/47	880,000.00	1,084,358.00
	ACGB 4.25% 04/21/26	2,600,000.00	3,156,569.00
	ACGB 4.5% 04/21/33	1,220,000.00	1,704,218.00
ACGB 4.75% 04/21/27	1,750,000.00	2,228,345.00	

	ACGB 5.5% 04/21/23	1,810,000.00	2,079,599.50	
	ACGB 5.75% 07/15/22	3,920,000.00	4,367,115.20	
オーストラリアドル 小計		34,350,000.00	39,480,325.35 (2,953,523,139)	
シンガポールドドル	SIGB 1.25% 10/01/21	630,000.00	638,101.80	
	SIGB 1.75% 02/01/23	320,000.00	331,747.20	
	SIGB 1.75% 04/01/22	160,000.00	164,254.40	
	SIGB 2.125% 06/01/26	200,000.00	217,217.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	730,000.00	744,183.90	
	SIGB 2.25% 08/01/36	340,000.00	386,948.90	
	SIGB 2.375% 06/01/25	500,000.00	544,400.00	
	SIGB 2.375% 07/01/39	100,000.00	117,100.00	
	SIGB 2.625% 05/01/28	70,000.00	79,252.25	
	SIGB 2.75% 03/01/46	630,000.00	808,167.15	
	SIGB 2.75% 04/01/42	300,000.00	377,329.50	
	SIGB 2.75% 07/01/23	540,000.00	578,961.00	
	SIGB 2.875% 07/01/29	640,000.00	744,784.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	370,000.00	435,680.55	
	SIGB 2% 02/01/24	90,000.00	95,135.85	
	SIGB 3.125% 09/01/22	320,000.00	339,963.20	
	SIGB 3.375% 09/01/33	270,000.00	342,823.05	
	SIGB 3.5% 03/01/27	530,000.00	624,385.05	
	SIGB 3% 09/01/24	510,000.00	563,170.05	
	シンガポールドドル 小計		7,250,000.00	8,133,604.85 (631,086,400)
マレーシア リンギット	MGS 3.418% 08/15/22	1,220,000.00	1,249,078.70	
	MGS 3.48% 03/15/23	1,300,000.00	1,337,940.50	
	MGS 3.502% 05/31/27	100,000.00	103,957.00	
	MGS 3.62% 11/30/21	950,000.00	970,268.25	
	MGS 3.733% 06/15/28	300,000.00	316,984.50	
	MGS 3.795% 09/30/22	500,000.00	516,650.00	
	MGS 3.8% 08/17/23	550,000.00	574,211.00	
	MGS 3.844% 04/15/33	860,000.00	906,504.50	
	MGS 3.882% 03/14/25	950,000.00	1,004,577.50	
	MGS 3.885% 08/15/29	260,000.00	277,230.20	
	MGS 3.892% 03/15/27	1,200,000.00	1,271,970.00	
	MGS 3.899% 11/16/27	1,160,000.00	1,232,877.00	
	MGS 3.9% 11/30/26	360,000.00	381,879.00	
	MGS 3.955% 09/15/25	150,000.00	160,098.00	
	MGS 4.059% 09/30/24	750,000.00	794,760.00	
	MGS 4.127% 04/15/32	690,000.00	742,132.95	
	MGS 4.16% 07/15/21	2,040,000.00	2,086,532.40	

	MGS 4.181% 07/15/24	1,090,000.00	1,159,378.50	
	MGS 4.232% 06/30/31	850,000.00	933,839.75	
	MGS 4.254% 05/31/35	890,000.00	961,920.90	
	MGS 4.392% 04/15/26	1,650,000.00	1,797,039.75	
	MGS 4.498% 04/15/30	1,260,000.00	1,407,193.20	
	MGS 4.642% 11/07/33	1,300,000.00	1,469,435.50	
	MGS 4.736% 03/15/46	1,090,000.00	1,207,496.55	
	MGS 4.762% 04/07/37	1,160,000.00	1,329,748.60	
	MGS 4.893% 06/08/38	360,000.00	419,556.60	
	MGS 4.921% 07/06/48	290,000.00	335,453.15	
	MGS 4.935% 09/30/43	530,000.00	612,261.30	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,480,000.00	1,719,782.20	
	マレーシアリングット 小計	25,290,000.00	27,280,757.50 (688,293,511)	
イスラエル シェケル	ILGOV 0.75% 07/31/22	3,180,000.00	3,225,243.13	
	ILGOV 1% 03/31/30	960,000.00	978,436.60	
	ILGOV 2.25% 09/28/28	1,050,000.00	1,181,702.34	
	ILGOV 3.75% 03/31/24	2,000,000.00	2,264,511.00	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	1,040,000.00	1,476,701.72	
	ILGOV 5.5% 01/31/22	940,000.00	1,024,045.68	
	ILGOV 5.5% 01/31/42	1,270,000.00	2,200,859.58	
	ILGOV 6.25% 10/30/26	3,000,000.00	4,080,795.30	
	イスラエルシェケル 小計	13,440,000.00	16,432,295.35 (513,509,229)	
	合計		135,597,791,229 (135,597,791,229)	

## 有価証券明細表注記

- 通貨ごとの小計の欄における( )内は、邦貨換算額であります。
- 合計金額欄の記載は、邦貨額であります。( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。
- 通貨の表示は、外貨についてはその通貨の単位、邦貨については円単位で表示しております。
- 外貨建有価証券の通貨別内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカドル	国債証券 164銘柄	100.0%	45.2%
カナダドル	国債証券 27銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 305銘柄	100.0%	40.1%
イギリスポンド	国債証券 44銘柄	100.0%	6.7%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.5%

ポーランドズロチ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	22銘柄	100.0%	2.2%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリングット	国債証券	29銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券	8銘柄	100.0%	0.4%

(注)時価比率は、通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 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

注記表(デリバティブ取引に関する注記)に記載したとおりであります。

**【中間財務諸表】**

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則(昭和52年大蔵省令第38号)」並びに同規則第38条の3及び第57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)」に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期中間計算期間(2020年6月11日から2020年12月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位：円 )

	第13期 ( 2020年 6月10日現在 )	第14期中間計算期間 ( 2020年12月10日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	15,873,903	6,862,875
親投資信託受益証券	3,155,500,956	3,377,730,379
未収入金	82,460,627	22,589,430
流動資産合計	3,253,835,486	3,407,182,684
資産合計	3,253,835,486	3,407,182,684
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,058,593	4,613,911
未払受託者報酬	860,365	900,391
未払委託者報酬	9,463,919	9,904,298
未払利息	23	9
その他未払費用	86,002	89,976
流動負債合計	13,468,902	15,508,585
負債合計	13,468,902	15,508,585
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,906,104,728	1,844,844,821
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	1,334,261,856	1,546,829,278
( 分配準備積立金 )	998,005,737	937,038,736
元本等合計	3,240,366,584	3,391,674,099
純資産合計	3,240,366,584	3,391,674,099
負債純資産合計	3,253,835,486	3,407,182,684

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期中間計算期間 自 2019年 6月11日 至 2019年12月10日	第14期中間計算期間 自 2020年 6月11日 至 2020年12月10日
営業収益		
受取利息	-	34
有価証券売買等損益	232,075,649	272,180,455
営業収益合計	232,075,649	272,180,489
営業費用		
支払利息	6,083	2,521
受託者報酬	872,496	900,391
委託者報酬	9,597,457	9,904,298
その他費用	87,194	89,976
営業費用合計	10,563,230	10,897,186
営業利益又は営業損失（ ）	221,512,419	261,283,303
経常利益又は経常損失（ ）	221,512,419	261,283,303
中間純利益又は中間純損失（ ）	221,512,419	261,283,303
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	5,137,708	7,699,995
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,164,125,205	1,334,261,856
剰余金増加額又は欠損金減少額	44,594,839	42,211,088
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	44,594,839	42,211,088
剰余金減少額又は欠損金増加額	65,281,569	83,226,974
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	65,281,569	83,226,974
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,359,813,186	1,546,829,278

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

	第13期 (2020年 6月10日現在)	第14期中間計算期間 (2020年12月10日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数	1,906,104,728口	1,844,844,821口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.7000円 (17,000円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) 1.8385円 (18,385円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	第14期中間計算期間 (2020年12月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 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)」に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

	第14期中間計算期間 (2020年12月10日現在)
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

元本の移動

区分	第13期 自 2019年 6月11日 至 2020年 6月10日	第14期中間計算期間 自 2020年 6月11日 至 2020年12月10日
投資信託財産に係る元本の状況		
期首元本額	1,999,287,386円	1,906,104,728円
期中追加設定元本額	138,119,120円	58,130,037円
期中一部解約元本額	231,301,778円	119,389,944円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは親投資信託受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上されている親投資信託受益証券の状況は次のとおりであります。

なお、以下は参考情報であり、監査意見の対象外であります。

日本株式マザーファンド

貸借対照表

	2020年12月10日現在
項目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,919,647,640
株式	266,366,408,260

	2020年12月10日現在
項目	金額（円）
派生商品評価勘定	1,908,000
未収入金	278,700
未収配当金	193,480,288
差入委託証拠金	122,028,000
流動資産合計	269,603,750,888
資産合計	269,603,750,888
負債の部	
流動負債	
前受金	1,908,000
未払解約金	297,345,753
未払利息	3,876
流動負債合計	299,257,629
負債合計	299,257,629
純資産の部	
元本等	
元本	137,089,975,360
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	132,214,517,899
元本等合計	269,304,493,259
純資産合計	269,304,493,259
負債純資産合計	269,603,750,888

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日又は計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>株価指数先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段によっております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引に係るものであります。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金</p> <p>株式は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

	2020年12月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数		137,089,975,360口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9644円 (19,644円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

	2020年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 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)」に記載しております。  (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

## 元本の移動

区分	2020年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月11日
期首元本額	141,320,500,211円
期中追加設定元本額	4,523,831,211円
期中一部解約元本額	8,754,356,062円
期末元本額	137,089,975,360円
期末元本額の内訳	
日本株式インデックスファンド	640,821,144円
D C日本株式インデックスファンド	309,712,500円
D C日本株式インデックスファンドL	53,314,661,083円
D C日本株式インデックスファンドA	969,369,702円
D Cバランスファンド3 0	2,232,457,442円
D Cバランスファンド5 0	3,447,027,985円
D Cバランスファンド7 0	1,930,930,933円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	579,541,640円
日本株式インデックスe	1,572,377,447円
インデックスコレクション（国内株式）	18,763,187,489円
インデックスコレクション（バランス株式3 0）	12,263,196,074円
インデックスコレクション（バランス株式5 0）	2,443,297,840円
インデックスコレクション（バランス株式7 0）	1,882,878,879円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,621,256,492円
日本株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	2,831,088,827円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,273,091,679円
バランスVA3 0（適格機関投資家専用）	71,138,034円
バランスVA5 0（適格機関投資家専用）	782,916,252円
VAバランスファンド（株2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	90,105,202円
VAバランスファンド（株5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	206,706,678円
VAバランス株式3 0（適格機関投資家専用）	2,676,847円
VAバランスファンド（株6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	613,988,932円
バランスVA2 5（適格機関投資家専用）	1,032,415,436円
バランスVA3 7 . 5（適格機関投資家専用）	552,347,584円
バランスVA5 0 L（適格機関投資家専用）	9,234,934,274円
バランスVA7 5（適格機関投資家専用）	825,568,877円
VAバランスファンド（株4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	114,291,583円
VAポートフォリオ4 0（適格機関投資家専用）	1,460,260,527円
VAポートフォリオ2 0（適格機関投資家専用）	37,206,713円
バランスVA4 0（適格機関投資家専用）	187,378,068円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,369,434,247円

区分	2020年12月10日現在
V Aバランスファンド2（株40 / 100）（適格機関投資家専用）	68,857,812円
V Aバランス50 - 50（適格機関投資家専用）	72,861,148円
V Aファンド25（適格機関投資家専用）	29,174,119円
バランスファンドV A 2（適格機関投資家専用）	756,890,453円
バランスV A 2 5 L（適格機関投資家専用）	353,641,581円
バランスファンドV A 3（適格機関投資家専用）	5,825,111,344円
世界バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	110,100,942円
国内バランスV A 3 0（適格機関投資家専用）	46,767,235円
国内バランスV A 2 5（適格機関投資家専用）	10,717,595円
V Aバランス20 - 80（適格機関投資家専用）	156,004,573円
私募日本株式インデックスファンドA L（適格機関投資家専用）	3,582,148円

（デリバティブ取引に関する注記）

#### 株式関連

（2020年12月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	2,810,802,000	-	2,812,710,000	1,908,000
	合計	2,810,802,000	-	2,812,710,000	1,908,000

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、金融商品取引所等の発表する計算日又は計算日に知りうる直近の日の清算値段で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金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。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

#### 外国株式マザーファンド

#### 貸借対照表

	2020年12月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	5,668,074,569
コール・ローン	1,338,619,574
株式	248,963,158,825
投資信託受益証券	164,687,751
投資証券	5,470,236,866
派生商品評価勘定	245,628,073
未収入金	146,841
未収配当金	332,977,417
差入委託証拠金	2,055,417,546

	2020年12月10日現在
項目	金額（円）
流動資産合計	264,238,947,462
資産合計	264,238,947,462
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,552,941
前受金	241,687,753
未払解約金	1,795,949,499
未払利息	1,777
流動負債合計	2,049,191,970
負債合計	2,049,191,970
純資産の部	
元本等	
元本	79,341,725,572
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	182,848,029,920
元本等合計	262,189,755,492
純資産合計	262,189,755,492
負債純資産合計	264,238,947,462

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	2020年12月10日現在
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(3)投資証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所等における計算日に知りうる直近の日の最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等に基づいて評価しております。</p> <p>(1)先物取引</p>

2020年12月10日現在	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>株価指数先物取引 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p>
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 株式及び投資証券は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券は、原則として収益分配金落の売買が行われる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>(2) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(3) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2020年12月10日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	79,341,725,572口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 3.3046円 (1万口当たり純資産額) (33,046円)

## (金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2020年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券            売買目的有価証券            「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引            「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務            短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

元本の移動

区分	2020年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月11日
期首元本額	76,748,723,588円
期中追加設定元本額	10,308,990,626円
期中一部解約元本額	7,715,988,642円
期末元本額	79,341,725,572円
期末元本額の内訳	
外国株式インデックスファンド	1,608,238,718円

区分	2020年12月10日現在
D C 外国株式インデックスファンド	4,561,139,860円
D C 外国株式インデックスファンド L	22,995,221,501円
D C バランスファンド 3 0	679,511,145円
D C バランスファンド 5 0	1,394,451,225円
D C バランスファンド 7 0	870,156,265円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	346,241,366円
外国株式インデックス e	5,052,415,924円
インデックスコレクション（外国株式）	10,725,737,018円
インデックスコレクション（バランス株式 3 0）	3,674,582,508円
インデックスコレクション（バランス株式 5 0）	990,298,254円
インデックスコレクション（バランス株式 7 0）	844,581,186円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	11,881,795,261円
外国株式パッシブファンド私募 A（適格機関投資家専用）	1,534,673,235円
外国株式インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）	730,114,788円
バランス V A 3 0（適格機関投資家専用）	42,745,209円
バランス V A 5 0（適格機関投資家専用）	472,046,272円
V A バランスファンド（株 2 5 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	54,010,907円
V A バランスファンド（株 5 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	123,954,688円
V A バランス株式 3 0（適格機関投資家専用）	763,860円
V A バランスファンド（株 6 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	1,841,237,850円
バランス V A 2 5（適格機関投資家専用）	420,427,330円
バランス V A 3 7 . 5（適格機関投資家専用）	290,413,547円
バランス V A 5 0 L（適格機関投資家専用）	5,507,836,379円
バランス V A 7 5（適格機関投資家専用）	565,373,449円
V A バランスファンド（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	205,537,392円
V A ポートフォリオ 4 0（適格機関投資家専用）	875,390,452円
V A ポートフォリオ 2 0（適格機関投資家専用）	22,299,094円
バランス V A 4 0（適格機関投資家専用）	112,417,399円
V A バランスファンド 2（株 4 0 / 1 0 0）（適格機関投資家専用）	123,818,971円
V A バランス 5 0 - 5 0（適格機関投資家専用）	393,076,906円
V A ファンド 2 5（適格機関投資家専用）	17,496,768円
バランス V A 2 5 L（適格機関投資家専用）	93,261,406円
V A バランス 2 0 - 8 0（適格機関投資家専用）	280,504,701円
私募外国株式インデックスファンド A L（適格機関投資家専用）	9,954,738円

（デリバティブ取引に関する注記）

株式関連

（2020年12月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)

市場取引	株価指数先物取引 買建	7,336,806,738	-	7,578,494,491	241,687,753
	合計	7,336,806,738	-	7,578,494,491	241,687,753

## (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、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3. 計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 通貨関連

(2020年12月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	1,001,967,599	-	996,009,903	5,957,696
	アメリカドル	759,301,312	-	751,198,513	8,102,799
	ユーロ	149,055,360	-	151,164,000	2,108,640
	イギリスポンド	93,610,927	-	93,647,390	36,463
	売建	1,421,554,075	-	1,423,209,000	1,654,925
	アメリカドル	1,010,330,660	-	1,011,419,000	1,088,340
	カナダドル	77,224,075	-	77,273,000	48,925
	イギリスポンド	236,772,090	-	237,082,000	309,910
	スイスフラン	58,602,750	-	58,630,000	27,250
	オーストラリアドル	38,624,500	-	38,805,000	180,500
	合計		2,423,521,674	-	2,419,218,903

## (注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の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によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の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、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 外国債券マザーファンド

## 貸借対照表

	2020年12月10日現在
項目	金額(円)
資産の部	
流動資産	

	2020年12月10日現在
項目	金額（円）
預金	75,573,874
コール・ローン	1,553,205,688
国債証券	142,661,005,233
派生商品評価勘定	11,914,101
未収入金	4,766,002
未収利息	827,576,108
前払費用	32,383,988
差入委託証拠金	351,261,993
流動資産合計	145,517,686,987
資産合計	145,517,686,987
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,293,659
前受金	312,926
未払金	11,781,023
未払解約金	311,293,677
未払利息	2,062
流動負債合計	326,683,347
負債合計	326,683,347
純資産の部	
元本等	
元本	56,186,375,494
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	89,004,628,146
元本等合計	145,191,003,640
純資産合計	145,191,003,640
負債純資産合計	145,517,686,987

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

	2020年12月10日現在
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>移動平均法(買付約定後、最初の利払日までには個別法)に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価額、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が発表する売買参考統計値等で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>債券先物取引</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p>

	2020年12月10日現在
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>個別法に基づき、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>当ファンドにおける派生商品評価勘定は、当該先物取引及び為替予約取引に係るものであります。</p> <p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等については、「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条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>
4. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>(2) 為替予約取引による為替差損益 約定日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

	2020年12月10日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数	56,186,375,494口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産額 2.5841円 (1万口当たり純資産額) (25,841円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

	2020年12月10日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則として時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p>

	2020年12月10日現在
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は契約上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

## 元本の移動

区分	2020年12月10日現在
投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月11日
期首元本額	55,718,442,750円
期中追加設定元本額	4,113,747,379円
期中一部解約元本額	3,645,814,635円
期末元本額	56,186,375,494円
期末元本額の内訳	
外国債券インデックスファンド	2,147,847,718円
DC外国債券インデックスファンド	2,072,140,275円
DC外国債券インデックスファンドL	13,560,012,558円
DCバランスファンド30	860,986,774円
DCバランスファンド50	872,333,706円
DCバランスファンド70	165,535,377円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	423,779,871円
外国債券インデックスe	1,160,979,243円
インデックスコレクション(外国債券)	7,411,071,407円
インデックスコレクション(バランス株式30)	4,665,178,014円

区分	2020年12月10日現在
インデックスコレクション(バランス株式50)	561,220,437円
インデックスコレクション(バランス株式70)	149,217,879円
私募外国債券パッシブファンド(適格機関投資家専用)	3,855,005,336円
外国債券パッシブファンド私募A(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,715,836,755円
外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	540,182,944円
バランスVA30(適格機関投資家専用)	117,012,860円
バランスVA50(適格機関投資家専用)	561,945,386円
VAバランスファンド(株25/100)(適格機関投資家専用)	329,106,389円
VAバランスファンド(株50/100)(適格機関投資家専用)	251,740,789円
VAバランス株式30(適格機関投資家専用)	460,444円
VAバランスファンド(株60/100)(適格機関投資家専用)	1,168,712,870円
バランスVA25(適格機関投資家専用)	1,702,420,213円
バランスVA37.5(適格機関投資家専用)	624,832,128円
バランスVA50L(適格機関投資家専用)	6,522,712,524円
バランスVA75(適格機関投資家専用)	330,387,357円
VAバランスファンド(株40/100)(適格機関投資家専用)	304,401,905円
VAポートフォリオ40(適格機関投資家専用)	1,666,792,376円
VAポートフォリオ20(適格機関投資家専用)	113,233,926円
バランスVA40(適格機関投資家専用)	194,935,596円
VAバランスファンド2(株40/100)(適格機関投資家専用)	104,787,223円
VAバランス50-50(適格機関投資家専用)	55,441,154円
VAファンド25(適格機関投資家専用)	88,812,960円
バランスVA25L(適格機関投資家専用)	250,888,148円
世界バランスVA25(適格機関投資家専用)	75,886,636円
VAバランス20-80(適格機関投資家専用)	1,543,035,931円
私募外国債券インデックスファンドAL(適格機関投資家専用)	17,500,385円

(デリバティブ取引に関する注記)

#### 債券関連

(2020年12月10日現在)

区分	種類	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引 買建	1,472,503,812	-	1,472,816,738	312,926
	合計	1,472,503,812	-	1,472,816,738	312,926

(注)1.時価の算定方法

債券先物取引の時価については、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2.債券先物取引の残高は、契約金額ベースで表示しております。

3.計算日又は計算日に知りうる直近の日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しております。

4. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 通貨関連

（2020年12月10日現在）

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,257,727,190	-	1,266,074,500	8,347,310
	アメリカドル	536,519,792	-	536,939,000	419,208
	カナダドル	80,183,308	-	81,340,000	1,156,692
	ユーロ	533,707,767	-	540,411,300	6,703,533
	イギリスポンド	107,316,323	-	107,384,200	67,877
	売建	30,402,580	-	30,442,374	39,794
	イギリスポンド	30,402,580	-	30,442,374	39,794
合計		1,288,129,770	-	1,296,516,874	8,307,516

### (注)時価の算定方法

わが国における計算日又は計算日に知りうる直近の日の対顧客先物売買相場の仲値によって、以下のように評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の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によって評価しております。

計算日又は計算日に知りうる直近の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、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先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【グローバル・インデックス・バランス・ファンド】

## 【純資産額計算書】

(2020年12月30日現在)

資産総額	3,407,536,347円
負債総額	4,225,243円
純資産総額( - )	3,403,311,104円
発行済口数	1,831,983,803口
1口当たり純資産額( / )	1.8577円
(1万口当たり純資産額)	(18,577円)

(参考)

## 日本株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2020年12月30日現在)

資産総額	273,583,374,447円
負債総額	209,574,510円
純資産総額( - )	273,373,799,937円
発行済口数	136,781,317,249口
1口当たり純資産額( / )	1.9986円
(1万口当たり純資産額)	(19,986円)

## 外国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

(2020年12月30日現在)

資産総額	264,209,500,641円
負債総額	112,786,357円
純資産総額( - )	264,096,714,284円
発行済口数	78,863,401,469口
1口当たり純資産額( / )	3.3488円
(1万口当たり純資産額)	(33,488円)

## 外国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

(2020年12月30日現在)

資産総額	144,999,049,085円
負債総額	7,121,610円
純資産総額（ - ）	144,991,927,475円
発行済口数	56,021,963,860口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5881円
（1万口当たり純資産額）	（25,881円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)名義書換等

該当事項はありません。

## (2)受益者等に対する特典

該当事項はありません。

## (3)譲渡制限

該当事項はありません。

## (4)振替受益権について

当ファンドの受益権は社振法の適用を受けます。

## 受益証券の不発行

委託会社は、当ファンド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又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。

## 受益権の譲渡

イ．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又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。

ロ．上記イ．の申請のある場合には、上記イ．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及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又は記録するものとします。ただし、上記イ．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又は記録が行われるよう通知するものとします。

ハ．上記イ．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又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、委託会社が必要と認めるとき又はやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

## 受益権の譲渡の対抗要件

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

## 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、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。

#### 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載又は記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還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販売会社の名義で記載又は記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。

#### 質権口記載又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又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付、一部解約金及び償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

### 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（2020年12月30日現在）

資本金の額 : 20億円

発行可能株式総数 : 12,000株

発行済株式総数 : 3,000株

最近5年間に於ける資本金の額の増減 : 2018年10月1日に資本金を20億円に増資しています。

###### (2)委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

会社が取締役（監査等委員である取締役を除く。）を10名以内、監査等委員である取締役を5名以内おきます。取締役は、株主総会において選任され、又は解任されます。ただし、監査等委員である取締役は、それ以外の取締役と区別するものとします。

取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、取締役の選任決議は、累積投票によらないものとします。

また、監査等委員以外取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、監査等委員である取締役の解任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の3分の2以上をもって行います。

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終結の時までとします。

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終結の時までとします。また、任期の満了前に退任した監査等委員である取締役の補欠として選任された監査等委員である取締役の任期は、退任した監査等委員である取締役の任期の満了する時までとします。

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。また、代表取締役の中から社長1名を選定し、必要あるときは、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、会長、副会長、副社長、専務取締役、常務取締役各若干名を選定することができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役会においてあらかじめ定めた取締役が招集し、その議長となります。当該取締役に事故あるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順位にしたがい、ほかの取締役がその職務を代行します。

取締役会を招集するには、各取締役に対して会日の3日前までに招集通知を發します。ただし、緊急の必要あるときは、この期間を短縮することができ、取締役の全員の同意があるときは、招集の手続を経ずに取締役会を開催することができます。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

###### 投資運用の意思決定機構

###### [ PLAN（計画） ]

運用企画部担当役員を委員長とする運用・リスク委員会において、ファンドの運用戦略や運用スタイルなどを決定します。運用・リスク委員会で決定された運用の基本方針等に基づき、各運用部に

において、ファンドマネジャーが運用仕様・ガイドラインに基づき、運用の執行に関する方針を運用計画として策定します。

#### [ DO（実行） ]

各運用部のファンドマネジャーは、運用計画に沿った運用の執行、ファンドの運用状況管理を行います。

各運用部の部長等は、各ファンドマネジャーの運用実施状況を確認します。

売買発注の執行は、各運用部からの運用の実行指図に基づき、各運用部から独立したトレーディング部のトレーダーが行います。

#### [ CHECK（検証・評価） ]

運用企画部は、運用部門において各運用部から独立した立場で、毎月開催される運用・リスク委員会（委員長は運用企画部担当役員）に運用パフォーマンスに係るモニタリング状況を報告します。このモニタリング状況や討議内容は、各運用部の部長（委員会の構成員）からファンドマネジャーに速やかにフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

また、運用に関するリスク管理と法令等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運用監理部が担当します。このモニタリング結果は、毎月開催される運用・リスク委員会等に報告されます。

こうした牽制態勢のもと、PLAN - DO - CHECKのPDCサイクルによる一貫した運用プロセスにより、適切な運用体制を維持するよう努めています。

委託会社の機構は2021年 3月10日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## 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）を行っています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務等の関連する業務を行っています。

2020年12月30日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託（マザーファンドを除きます。）は次の通りです。

	本数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	524	13,396,945
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	79	302,014
単位型公社債投資信託	41	287,976
合計	644	13,986,935

## 3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託者である三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」という。）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、以下「財務諸表等規則」という。）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年内閣府令第52号）により作成しております。

また、委託者の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する

る内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表の金額については、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(2) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第34期事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）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、第35期事業年度の中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）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。

(1) 【貸借対照表】

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	23,830	24,869
金銭の信託	-	5,823
有価証券	2,268	-
前払費用	197	348
未収委託者報酬	6,351	7,284
未収運用受託報酬	5,525	5,842
未収収益	212	190
その他	2,261	4,624
流動資産合計	40,648	48,983
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 282	1 256
器具備品	1 564	1 576
その他	1 14	1 0
有形固定資産合計	861	832
無形固定資産		
ソフトウェア	1,487	3,030
その他	7	40
無形固定資産合計	1,494	3,070
投資その他の資産		
投資有価証券	11,334	8,469
関係会社株式	4,663	5,636
繰延税金資産	141	700
その他	32	35
投資その他の資産合計	16,171	14,842
固定資産合計	18,527	18,745
資産合計	59,176	67,729

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2019年3月31日現在)	当事業年度 (2020年3月31日現在)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	38	38
未払金	5,327	7,988
未払収益分配金	0	0
未払手数料	2,718	3,355
その他未払金	2,608	4,632
未払費用	178	204
未払法人税等	1,992	897
賞与引当金	132	324
その他	395	1,070
流動負債合計	8,063	10,524
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	537	600
資産除去債務	131	132
その他	0	7
固定負債合計	669	740
負債合計	8,733	11,264
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金	17,239	17,239
資本剰余金合計	17,239	17,239
利益剰余金		
利益準備金	75	305
その他利益剰余金		
別途積立金	2,100	2,100
繰越利益剰余金	28,501	35,122
利益剰余金合計	30,676	37,528
株主資本合計	49,916	56,767
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	393	587
繰延ヘッジ損益	133	284
評価・換算差額等合計	526	302
純資産合計	50,442	56,464
負債・純資産合計	59,176	67,729

## (2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	30,551	34,967
運用受託報酬	5,464	11,091
その他営業収益	283	500
営業収益合計	36,299	46,559
営業費用		
支払手数料	13,423	15,998
広告宣伝費	276	331
公告費	1	0
調査費	5,508	5,018
調査費	567	788
委託調査費	4,935	4,217
図書費	5	11
営業雑経費	2,315	3,434
通信費	45	52
印刷費	449	470
協会費	38	53
諸会費	5	16
情報機器関連費	1,657	2,726
その他営業雑経費	118	114
営業費用合計	21,525	24,783
一般管理費		
給料	3,931	5,756
役員報酬	161	244
給料・手当	3,425	4,962
賞与	343	549
退職給付費用	98	118
福利費	297	535
交際費	9	14
旅費交通費	141	190
租税公課	270	344
不動産賃借料	219	269
寄付金	8	7
減価償却費	152	334
業務委託費	657	864
諸経費	433	750
一般管理費合計	6,219	9,185
営業利益	8,554	12,589

（単位：百万円）

	前事業年度 （自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）	当事業年度 （自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）
営業外収益		
受取利息	11	15
収益分配金	8	119
投資有価証券売却益	46	483
投資有価証券償還益	0	316
為替差益	-	273
デリバティブ利益	250	666
貸倒引当金戻入	17	-
その他	5	30
営業外収益合計	340	1,906
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	1,076
投資有価証券売却損	34	4
投資有価証券償還損	1	19
固定資産除却損	7	19
為替差損	198	-
その他	3	0
営業外費用合計	245	1,118
経常利益	8,649	13,377
特別損失		
統合関連費用	286	-
システム統合費用	49	149
特別損失合計	355	149
税引前当期純利益	8,313	13,227
法人税、住民税及び事業税	2,674	4,263
法人税等調整額	125	193
法人税等合計	2,549	4,070
当期純利益	5,764	9,157

## （３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	300	350	350
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替	1,700	1,700	1,700
会社分割による増加		18,589	18,589
剰余金の配当			

当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			
当期変動額合計	1,700	16,889	16,889
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金 合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	74	2,100	22,767	24,942	25,592
当期変動額					
その他資本剰余金から 資本金への振替					-
会社分割による増加					18,589
剰余金の配当	0		30	30	30
当期純利益			5,764	5,764	5,764
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	0	-	5,734	5,734	24,323
当期末残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916

	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	0	-	0	25,592
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				18,589
剰余金の配当				30
当期純利益				5,764
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	393	133	526	526
当期変動額合計	393	133	526	24,850
当期末残高	393	133	526	50,442

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当期変動額			
その他資本剰余金から 資本金への振替			
会社分割による増加			
剰余金の配当			
当期純利益			
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			

当期変動額合計	-	-	-
当期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	75	2,100	28,501	30,676	49,916
当期変動額					
その他資本剰余金から 資本金への振替					-
会社分割による増加					-
剰余金の配当	230		2,536	2,305	2,305
当期純利益			9,157	9,157	9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	230	-	6,620	6,851	6,851
当期末残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767

	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	393	133	526	50,442
当期変動額				
その他資本剰余金から 資本金への振替				-
会社分割による増加				-
剰余金の配当				2,305
当期純利益				9,157
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	980	151	829	829
当期変動額合計	980	151	829	6,022
当期末残高	587	284	302	56,464

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 子会社株式

移動平均法による原価法によっております。

#### (2) その他有価証券

##### 時価のあるもの

決算末日の市場価格等に基づく時価法によっております。（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。）

##### 時価のないもの

移動平均法による原価法によっております。

### 2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法によっております。

### 4. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

ただし、ソフトウェア（自社利用分）については、原則として社内における利用可能期間（5年）に基づいて償却しております。

5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。

6. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 退職給付引当金

従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度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。

7. ヘッジ会計の会計処理

(1) ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によっております。

(2) ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

8. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

当事業年度より、連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度		当事業年度	
	(2019年3月31日)		(2020年3月31日)	
建 物	53	百万円	77	百万円
器具備品	351	"	285	"
そ の 他	3	"	4	"
計	408	"	367	"

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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）	3,000	-	-	3,000

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

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
2018年6月29日 定時株主総会	普通株式	30	10,000	2018年3月31日	2018年6月29日

## 4. 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	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	利益 剰余金	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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）	3,000	-	-	3,000

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 剰余金の配当に関する事項

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
2019年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,305	768,604	2019年3月31日	2019年6月28日

## 4. 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

2020年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

決議	株式の種類	配当金の 総額(百万円)	配当金の 原資	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	利益 剰余金	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

## （リ・ス取引関係）

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## （金融商品関係）

## 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、資金運用については、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を金銭の信託及び投資有価証券として保有しているほか、短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用しております。また、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金銭の信託及び投資有価証券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。

これらの必要な資金については、内部留保を充てております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えております。また、未収運用受託報酬については、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクは極めて低いものと考えており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクに晒されておりますが、顧客ごとに決済期日及び残高を管理することにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

金銭の信託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の軽減を図っております。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。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7.ヘッジ会計の会計処理」をご参照ください。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

当社では、リスク管理に係る基本方針を「リスク管理規程」として定め、以下のとおり、リスク・カテゴリー毎に管理しております。

## 信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

営業債権の管理については、顧客ごとに決済期日及び残高を管理し、また自己査定要領に基づき定期的に債権内容の検討を行うことにより回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

デリバティブ取引は、取引相手先として高格付けを有する金融機関に限定しております。

## 市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、自己勘定運用方針にて投資限度額や投資期間等を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。投資信託の為替変動リスクに対しては、それらの一部について為替予約を利用してヘッジしております。また、価格変動リスクを軽減するために、株価指数先物等のデリバティブ取引を利用しております。

## 資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

## 2. 金融商品の時価に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（注2）を参照ください）。

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額（*1）	時価（*1）	差額
(1) 現金及び預金	23,830	23,830	-
(2) 金銭の信託	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	6,351	6,351	-
(4) 未収運用受託報酬	5,525	5,525	-

(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	13,602	13,602	-
(6) 未払金	(5,327)	(5,327)	-
(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(0)	(0)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	82	82	-
デリバティブ取引計	81	81	-

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金及び預金	24,869	24,869	-
(2) 金銭の信託	5,823	5,823	-
(3) 未収委託者報酬	7,284	7,284	-
(4) 未収運用受託報酬	5,842	5,842	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	8,469	8,469	-
(6) 未払金	(7,988)	(7,988)	-
(7) デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	6	6	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(114)	(114)	-
デリバティブ取引計	(107)	(107)	-

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

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

(1) 現金及び預金

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

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

(3) 未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(6) 未払金

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

(7) デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

（単位：百万円）

区分	前事業年度 2019年3月31日	当事業年度 2020年3月31日
非上場株式	0	0

これについては、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注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

前事業年度（2019年3月31日）

（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
現金及び預金	23,830	-	-	-
未収委託者報酬	6,351	-	-	-
未収運用受託報酬	5,525	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 投資信託	2,268	491	7,800	0

当事業年度（2020年3月31日）

（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
現金及び預金	24,869	-	-	-
未収委託者報酬	7,284	-	-	-
未収運用受託報酬	5,842	-	-	-
投資有価証券 投資信託	-	9	5,605	-

(有価証券関係)

#### 1. 子会社株式

前事業年度（2019年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	4,663

当事業年度（2020年3月31日）

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

#### 2. 其他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

区分	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			
その他	4,405	3,432	973

小計	4,405	3,432	973
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	9,196	9,602	406
小計	9,196	9,602	406
合計	13,602	13,035	566

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

区分	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			
その他	891	806	84
小計	891	806	84
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	7,578	8,509	931
小計	7,578	8,509	931
合計	8,469	9,316	846

（注）非上場株式（貸借対照表計上額0百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## 3．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（2019年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,538	46	34

当事業年度（2020年3月31日）

（単位：百万円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,358	483	4

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（2019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）通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	887	-	3	3
	英ポンド	66	-	1	1
	カナダドル	3	-	0	0
	スイスフラン	7	-	0	0
	香港ドル	183	-	0	0
	ユーロ	183	-	2	2
	買建				
	米ドル	10	-	0	0
	スイスフラン	1	-	0	0
	香港ドル	0	-	0	0
ユーロ	2	-	0	0	
合計	1,346	-	7	7	

(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います。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 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	6,739	-	8	8
合計		6,739	-	8	8

(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います。

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. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	
原則的 処理方法	為替予約取引 売建					
	米ドル	有価証券 投資有価証券 子会社株式	3,432	-	13	
	英ポンド		2,575	-	50	
	カナダドル		40	-	0	
	スイスフラン		34	-	0	
	香港ドル		566	-	2	
	人民元		1,725	-	9	
	ユーロ		262	-	6	
	買建					
	ユーロ		6	-	0	
	合計		8,643	-	82	

(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。

当事業年度（2020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) 通貨関連

種類		契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	1,443	-	23	23
	英ポンド	79	-	1	1
	カナダドル	15	-	0	0
	スイスフラン	26	-	0	0
	香港ドル	247	-	4	4
	人民元	18	-	0	0
	ユーロ	223	-	2	2
合計		2,055	-	32	32

(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います。

2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(2) 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	8,412	-	358	358
合計		8,412	-	358	358

(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います。

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. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

(1) 通貨関連

ヘッジ 会計の方法	デリバティブ取引 の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的 処理方法	為替予約取引 売建				
	米ドル	投資有価証券 子会社株式	2,819	-	44
	英ポンド		2,660	-	67
	カナダドル		6	-	0
	スイスフラン		35	-	0
	香港ドル		71	-	1
	ユーロ		72	-	0
合計			5,666	-	114

(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。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

## 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

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	496	537
退職給付費用	79	74
退職給付の支払額	38	11
退職給付債務の期末残高	537	600

## (2) 退職給付債務及び年金資産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

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600
退職給付引当金	537	600
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	537	600

## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度79百万円 当事業年度74百万円

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度19百万円、当事業年度44百万円であります。

## 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
繰延税金資産				
未払事業税	125	百万円	168	百万円
賞与引当金損金算入限度超過額	40	"	99	"
退職給付引当金損金算入限度超過額	164	"	183	"
有価証券評価差額	-		259	"
その他	82	"	151	"
繰延税金資産 合計	413	"	862	"
繰延税金負債				
有価証券評価差額	173	"	-	
繰延ヘッジ損益	58	"	125	"
その他	38	"	35	"
繰延税金負債 合計	271	"	161	"
繰延税金資産の純額	141	"	700	"

## 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差異の原因となった主な項目別の内訳

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の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

## (資産除去債務関係)

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (セグメント情報等)

## [ セグメント情報 ]

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

## [ 関連情報 ]

## 1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,679百万円

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	9,534百万円

## [ 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 ]

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 ]

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 ]

該当事項はありません。

## (持分法損益等)

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

## 1. 関連当事者との取引

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

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## (ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	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）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	4,540	未収運用受託報酬	4,903
							投信販売代行手数料等	9,564	未払手数料	1,774
							投資助言費用	3,357	その他未払金	182
							吸収分割による承継 (承継資産合計) うち、投資有価証券 うち、関係会社株式 (承継負債合計) (差引純資産) (分割対価)	18,603 13,907 4,663 13 18,589 無対価	-	-

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

## 運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

## 投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

## 投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

## 吸収分割

共通支配下の取引に該当するため、承継資産及び承継負債は、分割会社の適正な帳簿価額によって引き継いでおります。また、当該会社分割は、無対価取引であるため、差引純資産と同額のその他資本剰余金を増額しております。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容又は職業	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）
親会社の子会社	三井住友信託銀行(株)	東京都千代田区	342,037	信託業務及び銀行業務	-	営業上の取引役員の兼任	運用受託報酬	9,252	未収運用受託報酬	5,176
							投信販売代行手数料等	9,656	未払手数料	1,737

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

## 運用受託報酬

各運用受託案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

## 投信販売代行手数料等

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

## (エ) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

## 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

前事業年度（2019年3月31日）

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、名古屋証券取引所に上場）

当事業年度（2020年3月31日）

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、名古屋証券取引所に上場）

（1株当たり情報）

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	16,814,137円07銭	18,821,541円72銭
1株当たり当期純利益金額	1,921,511円21銭	3,052,463円23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、潜在株式が存在し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。

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	5,764百万円	9,157百万円
普通株式の期中平均株式数	3,000株	3,000株

## 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第35期中間会計期間末

(2020年9月30日)

## 資産の部

## 流動資産

現金及び預金		22,768
金銭の信託		8,094
未収委託者報酬		7,732
未収運用受託報酬		5,430
その他		3,718
流動資産合計		47,745

## 固定資産

有形固定資産	1	801
無形固定資産		3,344
投資その他の資産		
投資有価証券		9,175
関係会社株式		5,636
繰延税金資産		261
その他		33
投資その他の資産合計		15,106

固定資産合計		19,252
--------	--	--------

資産合計		66,997
------	--	--------

## 負債の部

## 流動負債

未払金		7,364
未払法人税等		473

賞与引当金		289
その他	2	612
流動負債合計		8,740
固定負債		
退職給付引当金		614
資産除去債務		132
その他		6
固定負債合計		752
負債合計		9,493

(単位：百万円)

第35期中間会計期間末

(2020年9月30日)

純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000
資本剰余金		
その他資本剰余金		17,239
資本剰余金合計		17,239
利益剰余金		
利益準備金		500
その他利益剰余金		
別途積立金		2,100
繰越利益剰余金		35,114
利益剰余金合計		37,714
株主資本合計		56,953
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		251
繰延ヘッジ損益		299
評価・換算差額等合計		551
純資産合計		57,504
負債・純資産合計		66,997

## 中間損益計算書

(単位：百万円)

第35期中間会計期間

(自 2020年4月1日

至 2020年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		17,868
運用受託報酬		5,169
その他営業収益		206
営業収益合計		23,244
営業費用		13,137
一般管理費	1	4,842
営業利益		5,264
営業外収益	2	1,933

営業外費用	3	1,484
経常利益		5,714
特別損失		110
税引前中間純利益		5,603
法人税、住民税及び事業税		1,692
法人税等調整額		62
法人税等合計		1,754
中間純利益		3,848

## 中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本		
	資本金	資本剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000	17,239	17,239
当中間期変動額			
剰余金の配当			
中間純利益			
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	-	-	-
当中間期末残高	2,000	17,239	17,239

	株主資本				株主資本合計
	利益剰余金			利益剰余金合計	
	利益準備金	その他利益剰余金			
別途積立金		繰越利益剰余金			
当期首残高	305	2,100	35,122	37,528	56,767
当中間期変動額					
剰余金の配当	194		3,857	3,662	3,662
中間純利益			3,848	3,848	3,848
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	194	-	8	185	185
当中間期末残高	500	2,100	35,114	37,714	56,953

	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	587	284	302	56,464
当中間期変動額				
剰余金の配当				3,662
中間純利益				3,848

株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純 額）	838	15	854	854
当中間期変動額合計	838	15	854	1,040
当中間期末残高	251	299	551	57,504

## 重要な会計方針

第35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1. 資産の評価基準及び評価方法	
有価証券	
子会社株式	移動平均法による原価法によっております。
その他有価証券	
時価のあるもの	中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法によっております。 (評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定しております。)
時価のないもの	移動平均法による原価法によっております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	時価法によっております。
3. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法によっております。
4. 固定資産の減価償却の方法	
(1) 有形固定資産	定額法によっております。
(2) 無形固定資産	定額法によっております。 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。
5. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として計上しております。
6. 引当金の計上基準	
(1) 賞与引当金	従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき当中間会計期間の負担額を計上しております。
(2) 退職給付引当金	従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当事業年度末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、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。
7. ヘッジ会計の会計処理	
(1) ヘッジ会計の方法	繰延ヘッジ処理によっております。
(2) ヘッジ手段とヘッジ対象	

ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は関係会社株式及び投資有価証券であります。

(3) ヘッジ方針

自己勘定運用管理規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしております。

(4) ヘッジ有効性評価の方法

ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間において、ヘッジ対象とヘッジ手段の相場変動の累計額を比較して有効性を判定しております。

8. 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

消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

9. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

10. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第35期中間会計期間末 (2020年9月30日)	
1	有形固定資産の減価償却累計額 431百万円
2	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

第35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1	減価償却実施額
	有形固定資産 64百万円
	無形固定資産 255百万円
2	営業外収益の主要項目
	金銭の信託運用益 1,775百万円
3	営業外費用の主要項目
	デリバティブ費用 1,335百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第35期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020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）	3,000	-	-	3,000

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2020年6月26日 定時株主総会	普通株式	3,662	1,220,985	2020年3月31日	2020年6月29日

（金融商品関係）

第35期中間会計期間末（2020年9月30日）

2020年9月30日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（注2）を参照ください。）。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1)現金及び預金	22,768	22,768	-
(2)金銭の信託	8,094	8,094	-
(3)未収委託者報酬	7,732	7,732	-
(4)未収運用受託報酬	5,430	5,430	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	9,175	9,175	-
(6)未払金	(7,364)	(7,364)	-
(7)デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	(80)	(80)	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(9)	(9)	-
デリバティブ取引計	(89)	(89)	-

(\*1)負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

(\*2)デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しております。

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

## (1)現金及び預金

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

## (2)金銭の信託

信託財産は、主として投資信託で構成されております。この投資信託の時価は基準価額によっております。

## (3)未収委託者報酬、及び(4)未収運用受託報酬

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

## (5)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

## (6)未払金

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

## (7)デリバティブ取引

(デリバティブ取引関係)注記をご参照ください。

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額：投資有価証券0百万円、関係会社株式5,636百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)投資有価証券」には含めておりません。

## (有価証券関係)

第35期中間会計期間末（2020年9月30日）

## 1. 子会社株式

時価のある子会社株式はありません。

なお、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	5,636

## 2. その他有価証券

(単位：百万円)

区分	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			
その他	8,605	8,201	403
小計	8,605	8,201	403
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	570	610	40
小計	570	610	40
合計	9,175	8,812	362

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額0百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## (デリバティブ取引関係)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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)通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建			
	米ドル	1,861	-	2
	英ポンド	105	-	0
	カナダドル	19	-	0
	スイスフラン	50	-	0
	香港ドル	178	-	0
	ユーロ	306	-	3
合計	2,521	-	1	1

(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います。

## 2. 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

## (2)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	10,865	-	82	82
合計		10,865	-	82	82

(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います。

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. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

## (1)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 子会社株式			
	米ドル		3,535	-	4
	英ポンド		2,791	-	5
	カナダドル		8	-	0
	スイスフラン		55	-	0
	香港ドル		98	-	0
	ユーロ		84	-	0
合計			6,574	-	9

(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。

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

(関連情報)

第35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1)営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## (2)有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称	営業収益
三井住友信託銀行株式会社	4,593百万円
次世代通信関連 世界株式戦略ファンド(*1)	2,993百万円

(\*1)当社は約款に基づき投資信託財産から委託者報酬を得ているため、当該投資信託を顧客として上表は記載して  
おります。

(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35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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35期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)	
1株当たり純資産額	19,168,213円23銭
1株当たり中間純利益	1,282,957円88銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載していません。	

(注)1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
中間純利益	3,848百万円
普通株式に係る中間純利益	3,848百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式の期中平均株式数	3,000株

(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)自己又はその役員との取引

自己又はその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2)運用財産相互間の取引

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

## (3)通常取引条件と異なる条件での親法人等又は子法人等との取引

通常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。以下同じ。）又は子法人等（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又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

## (4)親法人等又は子法人等の利益を図るためにする不必要な取引

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行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うことを内容とした運用を行うこと。

## (5)その他親法人等又は子法人等が関与する不適切な行為

上記(3)及び(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又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、又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

2021年3月10日現在、訴訟事件その他委託会社及びファンドに重要な影響を及ぼした事実及び重要な影響を及ぼすことが予想される事実は生じておりません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1)受託会社

名称：三井住友信託銀行株式会社

資本金の額：342,037百万円（2020年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## (2)販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2020年3月末日現在）	事業の内容
野村證券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

## (1)受託会社

当ファンドの受託会社として、投資信託財産の保管・管理等を行います。

## (2)販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、一部解約の実行の請求の受付、収益分配金・償還金及び一部解約金の支払い、収益分配金の再投資、運用報告書の交付並びに口座管理機関としての業務等を行います。

## 3【資本関係】

### (1)受託会社

該当事項はありません。

### (2)販売会社

該当事項はありません。

### (参考)再信託受託会社

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

設立年月日 : 2000年6月20日

資本金の額 : 51,000百万円（2020年7月27日現在）

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約に係る信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

## 第3【その他】

(1)金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。

(2)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案及びその注釈、キャッチコピー並びにファンドの基本的性格等を記載することがあります。

(3)目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。

(4)目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。

(5)目論見書の表紙等にファンドの管理番号等を記載することがあります。

(6)交付目論見書の表紙等に委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。また、これらのアドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。

- (7)有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (8)目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (9)目論見書に投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。また、投資対象の投資信託証券等に関して、投信評価機関、投信評価会社等によるレーティング、評価情報及び評価分類等を表示することがあります。
- (10)有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

2020年6月2日

三井住友トラスト・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 藤 澤 孝 印  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹 内 知 明 印  
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」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第34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、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020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。

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2020年8月7日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子 印

## 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」に掲げられているグローバル・インデックス・バランス・ファンドの2019年6月11日から2020年6月10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、グローバル・インデックス・バランス・ファンドの2020年6月10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、三井住友トラスト・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。

## 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、継続企業的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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2020年12月1日

三井住友トラスト・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 藤 澤 孝 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹 内 知 明 印

**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」に掲げられている三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020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、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社の2020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（2020年4月1日から2020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、継続企業的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な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、継続企業的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。継続企業的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) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2021年2月10日

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 中島紀子 印

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル・インデックス・バランス・ファンドの2020年6月11日から2020年12月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、グローバル・インデックス・バランス・ファンドの2020年12月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年6月11日から2020年12月10日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生

する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。